

兴全沪港深两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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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 | 7 |
| § 4 管理人报告 | 8 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 8 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 9 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 9 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 9 |
| 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 | 10 |
| 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遵规守信情况声明 | 11 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 11 |
| 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 | 11 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 11 |
| 6.1 资产负债表 | 11 |
| 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 | 15 |
| § 7 投资组合报告 | 41 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 41 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 41 |
| 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 | 42 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 46 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 47 |
| 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 | 47 |
| 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 | 47 |

| | |
|---|-----------|
| 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 | 48 |
| 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 | 48 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 48 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 48 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 48 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 49 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 49 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 49 |
| 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 | 49 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 50 |
| § 10 重大事件揭示 | 50 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 50 |
| 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 | 50 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 50 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 50 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 50 |
| 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 | 50 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 50 |
| 10.8 其他重大事件 | 52 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 53 |
| 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 | 53 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 54 |
| § 12 备查文件目录 | 54 |
| 12.1 备查文件目录 | 54 |
| 12.2 存放地点 | 54 |
| 12.3 查阅方式 | 54 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|---------------------|
| 基金名称 | 兴全沪港深两年持有期混合型证券投资基金 |
| 基金简称 | 兴全沪港深两年持有混合 |
| 基金主代码 | 009007 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2020 年 5 月 22 日 |
| 基金管理人 | 兴证全球基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 2,955,763,649.25 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 本基金通过对沪深港三地证券市场内资本动向的追踪研究，在有效控制投资组合风险的前提下，力求实现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：恒生指数收益率（使用估值汇率折算）× 80%+沪深 300 指数收益率×10%+中债综合（全价）指数收益率× 10% |
| 风险收益特征 | 本基金是一只混合型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。 本基金投资于港股通标的股票，需面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|-------------|------|-------------------------------------|---------------------------|
| 名称 | | 兴证全球基金管理有限公司 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 杨卫东 | 李申 |
| | 联系电话 | 021-20398888 | 021-60637102 |
| | 电子邮箱 | yangwd@xqfunds.com | lishen.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 4006780099, 021-38824536 | 021-60637111 |
| 传真 | | 021-20398858 | 021-60635778 |
| 注册地址 | | 上海市黄浦区金陵东路 368 号 | 北京市西城区金融大街 25 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 | 北京市西城区闹市口大街 1 号 院 1 号楼 |
| 邮政编码 | | 201204 | 100033 |
| 法定代表人 | | 杨华辉 | 田国立 |

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 | 197,590,064.14 |
| 本期利润 | 343,148,899.02 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1168 |
| 本期加权平均净值利润率 | 9.80% |
| 本期基金份额净值增长率 | 10.64% |
| 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 | 282,443,296.33 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0956 |
| 期末基金资产净值 | 3,622,681,349.65 |
| 期末基金份额净值 | 1.2256 |
| 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 | 22.56% |

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

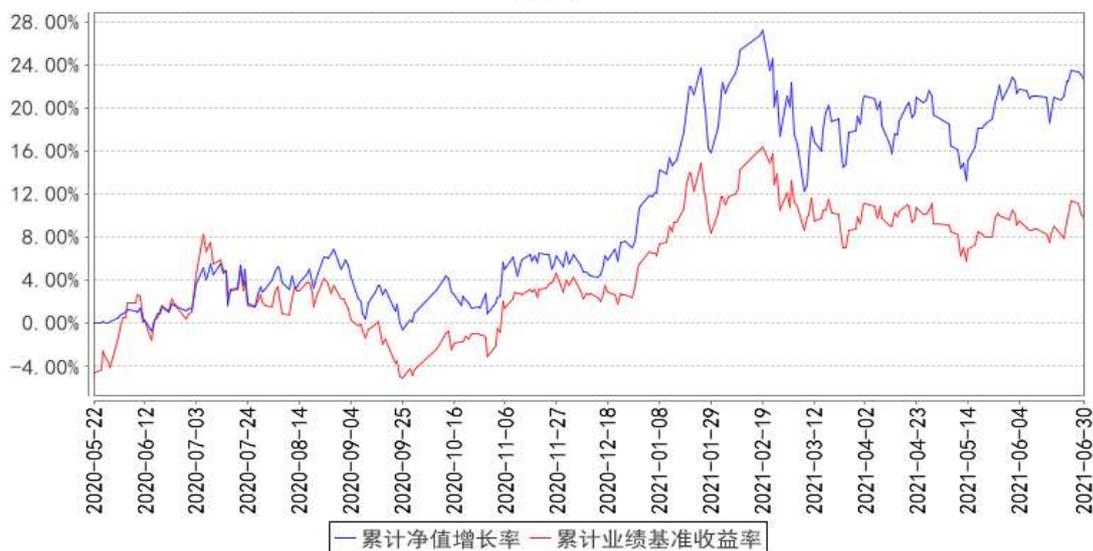
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净 | 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 | 0.38% | 0.70% | 0.04% | 0.67% | 0.34% | 0.03% |
| 过去三个月 | 3.45% | 0.94% | 0.44% | 0.76% | 3.01% | 0.18% |
| 过去六个月 | 10.64% | 1.38% | 3.95% | 1.03% | 6.69% | 0.35% |
| 过去一年 | 20.89% | 1.20% | 8.69% | 1.00% | 12.20% | 0.20% |
| 自基金合同生效起至今 | 22.56% | 1.15% | 9.71% | 1.05% | 12.85% | 0.10% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

兴全沪港深两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 6 月 30 日。

2、按照《兴全沪港深两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 2020 年 5 月 22 日至 2020 年 11 月 21 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和投资组合的比例范围。

3.3 其他指标

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

兴证全球基金管理有限公司（成立时名为“兴业基金管理有限公司”，以下简称“公司”）经证监基金字[2003]100号文批准于2003年9月30日成立。2008年1月，中国证监会批复（证监许可[2008]6号），同意全球人寿保险国际公司（AEGON International B.V）受让公司股权并成为公司股东。2008年4月9日，公司完成股权转让、变更注册资本等相关手续后，公司注册资本由9800万元变更为人民币1.2亿元，其中兴业证券股份有限公司的出资占注册资本的51%，全球人寿保险国际公司的出资占注册资本的49%。2008年7月，经中国证监会批准（证监许可[2008]888号），公司于2008年8月25日完成变更公司名称、注册资本等相关手续后，公司名称变更为“兴业全球基金管理有限公司”，注册资本增加为1.5亿元人民币，其中两股东出资比例不变。2016年12月28日，因公司发展需要，公司名称变更为“兴全基金管理有限公司”。2020年3月18日，公司名称变更为“兴证全球基金管理有限公司”。

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|----------|-----------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 林翠萍 | 本基金的基金经理 | 2020年5月22日 | - | 26年 | 硕士。历任中华经济研究院研究助理，京华(元大)证券股份有限公司研究员、自营部交易员，保诚(瀚亚)证券投资信托股份有限公司基金经理，富鼎(中国信托)证券投资信托股份有限公司投研处助理，联邦证券投资信托股份有限公司基金经理，华南永昌证券投资信托股份有限公司研究经理，金鼎(联博)证券投资信托股份有限公司基金经理，华顿证券投资信托股份有限公司资深经理，未来资产证券投资信托股份有限公司资深副总经理。中海基金管理有限公司基金经理。2016年4月至2019年5月担任中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018年3月至2019年5月担任中海沪港深多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 |

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、《兴全沪港深两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

本基金管理人制定了《兴证全球基金管理有限公司公平交易管理办法》，并将不时进行修订。本基金管理人主要从研究的公平、决策的公平、交易的公平、公平交易的监控评估、公平交易的报告和信息披露等方面对公平交易行为进行规范，从而达到保证本基金管理人管理的不同投资组合得到公平对待、保护投资者合法权益的目的。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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。

4.4 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

我们今年初在去年年报中提到，“高估值在短期不构成问题，但放在长期，高估值反映的是较低的收益率，当前港股部分行业估值已经来到历史的高点，我们会考虑估值与成长的匹配度，适度减持估值过度扩张的股票。…继续找寻市场关注度低且具有投资价值的标的。”估值与基本面匹配成为今年投资的主要难点，因此，上半年基金投资策略以行业均衡配置来因应，投资方向则以企业盈利增长为主要考量，同时考虑估值的合理水平，在合适的估值下，持续增加成长股的投资

比重。

当前，我们对市场保持谨慎，主要是政策对个别行业的风险尚未解除，监管政策方向上趋严，覆盖面也在扩大。过去一年市场过于专注在成长股的挖掘，许多低成长的价值股，票息已出现绝对收益的空间，具有较高性价比的配置价值，我们认为找寻市场关注度低且具有投资价值的标的下半年重要的投资方向；另一方面，过去我们在做互联网选股时会担忧估值的问题，这波估值下杀后，部分过去难以下手的成长股出现低接的机会，我们也会留意这类型成长股的加仓时机。

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 1.2256 元；本报告期基金份额净值增长率为 10.64%，业绩比较基准收益率为 3.95%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来投资展望，我们关注三个大机会，第一，中国经济今年以来处于复苏阶段，我们认为大消费行业还是酝酿机会，国潮崛起下，自主品牌市占率有进一步上升的机会；第二，前期的货币宽松，在经济复苏的背景下，全球通胀压力加大，叠加碳中和限产，部分原材料出现供需紧张，持续涨价；第三，香港本地疫情控制较为良好，我们认为未来三个月与内地有免隔离通关的机会，刺激香港本地零售、房价的复苏，香港本地股股价表现闷了比较长一段时间，我们认为若是顺利通关，股价向上的弹性大。

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

上述参与估值流程人员均具备估值业务所需的专业胜任能力。上述参与估值流程各方之间不

存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《兴全沪港深两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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：兴全沪港深两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 | 469,889,803.33 | 209,752,276.77 |
| 结算备付金 | | 123,401,408.75 | 603,299.31 |

| | | | |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 存出保证金 | | 2,291,619.51 | 10,908,565.90 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 3,117,423,512.78 | 2,997,117,102.20 |
| 其中：股票投资 | | 3,026,812,512.78 | 2,905,903,703.18 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 90,611,000.00 | 91,213,399.02 |
| 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 | | 97,930.63 | 10,656.39 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 1,652,397.57 | 2,417,250.70 |
| 应收股利 | | 15,241,074.10 | 862,449.44 |
| 应收申购款 | | 228,960.38 | 331,030.21 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 3,730,226,707.05 | 3,222,002,630.92 |
| 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 | | 101,012,000.77 | 11,281,881.34 |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 4,428,787.37 | 3,897,228.69 |
| 应付托管费 | | 738,131.22 | 649,538.13 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 1,274,977.09 | 924,298.13 |
| 应交税费 | | 2,200.80 | 2,275.54 |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 89,260.15 | 140,000.00 |
| 负债合计 | | 107,545,357.40 | 16,895,221.83 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 2,955,763,649.25 | 2,893,499,522.39 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 666,917,700.40 | 311,607,886.70 |
| 所有者权益合计 | | 3,622,681,349.65 | 3,205,107,409.09 |
| 负债和所有者权益总计 | | 3,730,226,707.05 | 3,222,002,630.92 |

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.2256 元，基金份额总额 2,955,763,649.25 份。

6.2 利润表

会计主体：兴全沪港深两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 5 月 22 日（基金合 同生效日）至 2020 年 6 月 30 日 |
|----------------------------|------------|--|---|
| 一、收入 | | 380,303,122.87 | 47,849,284.91 |
| 1. 利息收入 | | 2,600,843.89 | 4,667,701.19 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 574,634.91 | 1,009,323.07 |
| 债券利息收入 | | 2,026,208.98 | 2,925,463.76 |
| 资产支持证券利息 收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产 收入 | | - | 732,914.36 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以 “-”填列） | | 232,143,444.10 | 7,349,998.43 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 207,844,844.69 | 1,127,493.25 |
| 基金投资收益 | - | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | -846,539.26 | -584,645.53 |
| 资产支持证券投资 收益 | 6.4.7.13.5 | - | - |
| 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 | 25,145,138.67 | 6,807,150.71 |
| 3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 145,558,834.88 | 35,831,585.29 |
| 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 | | 37,154,223.85 | 8,277,977.77 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 26,062,136.53 | 4,622,790.77 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 4,343,689.43 | 770,465.14 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 6,635,081.03 | 2,849,042.26 |
| 5. 利息支出 | | - | - |

| | | | |
|---------------------|----------|----------------|---------------|
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 税金及附加 | | 2,140.00 | 7,879.60 |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.20 | 111,176.86 | 27,800.00 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 343,148,899.02 | 39,571,307.14 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 343,148,899.02 | 39,571,307.14 |

注：本基金合同于 2020 年 5 月 22 日生效，上年度可比期间数据按实际存续期计算。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴全沪港深两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） | 2,893,499,522.39 | 311,607,886.70 | 3,205,107,409.09 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 343,148,899.02 | 343,148,899.02 |
| 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） | 62,264,126.86 | 12,160,914.68 | 74,425,041.54 |
| 其中：1. 基金申购款 | 62,264,126.86 | 12,160,914.68 | 74,425,041.54 |
| 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 | 2,955,763,649.25 | 666,917,700.40 | 3,622,681,349.65 |

| 权益（基金净值） | | | |
|--|---|---------------|------------------|
| 项目 | 上年度可比期间 2020年5月22日（基金合同生效日）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） | 2,870,103,924.47 | - | 2,870,103,924.47 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 39,571,307.14 | 39,571,307.14 |
| 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） | 2,870,103,924.47 | 39,571,307.14 | 2,909,675,231.61 |

注：本基金合同于 2020 年 5 月 22 日生效，上年度可比期间数据按实际存续期计算。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告-至-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

兴全沪港深两年持有期混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)，经中国证券监督管理委

员会(以下简称“中国证监会”)于 2020 年 2 月 5 日印发的证监许可[2020]222 号文的核准公开募集,由兴证全球基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法规和《兴全沪港深两年持有期混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于 2020 年 5 月 22 日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为 2,870,103,924.47 份基金份额。本基金的基金管理人为兴证全球基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《兴全沪港深两年持有期混合型证券投资基金基金合同》和《兴全沪港深两年持有期混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,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(包

括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册发行的股票)、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(包括国债、地方政

府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、可交换债券、央行票据、中期票据、证券公司发行的短期债券、短期融资券、超短期融资券等)、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(但须符合中国证监会相关规定)。

本基金将根据法律法规的规定参与融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:本基金的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不低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终,在扣除股指期货和国债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。本基金的业绩比较基准为:恒生指数收益率(使用估值汇率折算)×80%+沪深 300 指数收益率×10%+中债综合(全价)指数收益率×10%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况、自 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日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 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会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》、财税 [2015] 101 号《财政部、国家税务总局、证监会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》、《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》（财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号）、财税 [2014] 81 号文《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 [2016] 127 号文《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 [2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《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 [2008] 1 号文《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》、财税 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局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 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本

基金适用的主要税项列示如下：

(a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，其股息红利所得暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金通过沪港通/深港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。基金通过沪港通/深港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。

(e) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

对于基金通过沪港通/深港通买卖、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。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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 | 469,889,803.33 |
| 定期存款 | - |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | - |
| 存款期限 1-3 个月 | - |
| 存款期限 3 个月以上 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计 | 469,889,803.33 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | | | |
|---------------|------------------------|------------------|----------------|------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 | |
| 股票 | 2,652,328,998.54 | 3,026,812,512.78 | 374,483,514.24 | |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | |
| | 银行间市场 | 90,378,993.29 | 90,611,000.00 | 232,006.71 |
| | 合计 | 90,378,993.29 | 90,611,000.00 | 232,006.71 |
| 资产支持证券 | - | - | - | |
| 基金 | - | - | - | |
| 其他 | - | - | - | |
| 合计 | 2,742,707,991.83 | 3,117,423,512.78 | 374,715,520.95 | |

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 | 45,552.73 |
| 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 | 23,006.36 |
| 应收债券利息 | 1,582,378.63 |
| 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 | 1,459.85 |
| 合计 | 1,652,397.57 |

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 | 1,274,502.09 |
| 银行间市场应付交易费用 | 475.00 |
| 合计 | 1,274,977.09 |

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 | - |
| 预提信息披露费 | 59,507.37 |
| 预提审计费用 | 29,752.78 |
| 合计 | 89,260.15 |

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 | 2,893,499,522.39 | 2,893,499,522.39 |
| 本期申购 | 62,264,126.86 | 62,264,126.86 |
| 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 | 2,955,763,649.25 | 2,955,763,649.25 |

注：申购含红利再投资、转换入份额。

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 | 81,748,348.53 | 229,859,538.17 | 311,607,886.70 |
| 本期利润 | 197,590,064.14 | 145,558,834.88 | 343,148,899.02 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 3,104,883.66 | 9,056,031.02 | 12,160,914.68 |
| 其中：基金申购款 | 3,104,883.66 | 9,056,031.02 | 12,160,914.68 |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 282,443,296.33 | 384,474,404.07 | 666,917,700.40 |

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 | 421,230.72 |
| 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 | 124,332.30 |
| 其他 | 29,071.89 |
| 合计 | 574,634.91 |

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 | 207,844,844.69 |
| 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 | 207,844,844.69 |

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 | 2,000,639,566.01 |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,792,794,721.32 |
| 买卖股票差价收入 | 207,844,844.69 |

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资证券出借差价收入。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | -846,539.26 |
| 债券投资收益——赎回差价收入 | - |
| 债券投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | -846,539.26 |

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 73,727,906.85 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 71,606,330.00 |
| 减：应收利息总额 | 2,968,116.11 |
| 买卖债券差价收入 | -846,539.26 |

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

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 | 25,145,138.67 |
| 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 | 25,145,138.67 |

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 | 145,558,834.88 |
| 股票投资 | 144,994,713.90 |
| 债券投资 | 564,120.98 |
| 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 | 145,558,834.88 |

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 | 6,634,606.03 |
| 银行间市场交易费用 | 475.00 |
| 合计 | 6,635,081.03 |

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 | 29,752.78 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行费用 | 3,616.71 |
| 账户维护费 | 18,300.00 |

| | |
|----|------------|
| 合计 | 111,176.86 |
|----|------------|

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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

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，本基金没有需要在财务报表附注中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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|------------------------|-----------------------|
| 中国建设银行股份有限公司（“建设银行”） | 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5月22日（基金合同生效日）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 | 274,531,174.00 | 7.30 | 1,013,805,961.12 | 63.66 |

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5月22日（基金合同生效日） 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 | - | - | 789,782,073.28 | 70.17 |

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 | | 上年度可比期间 2020年5月22日（基金合同生效日） 至2020年6月30日 | |
|-------|----------------------------|---------------------------|---|---------------------------|
| | 成交金额 | 占当期债券回购 成交总额的比例 （%） | 成交金额 | 占当期债券回购 成交总额的比例 （%） |
| 兴业证券 | - | - | 6,580,000,000.00 | 73.15 |

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 | 185,849.45 | 7.14 | 148,853.03 | 11.68 |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2020年5月22日（基金合同生效日）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 | 709,663.50 | 63.98 | 709,663.50 | 63.98 |

注：1、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。

2、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 5 月 22 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日 |
|-----------------|---------------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 26,062,136.53 | 4,622,790.77 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 10,385,023.93 | 1,906,891.80 |

注：支付基金管理人兴证全球基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

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 5 月 22 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 4,343,689.43 | 770,465.14 |

注：支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

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：本基金在本报告期内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：本基金在本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行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：本基金在本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行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自有资金投资本基金的情况

注：本基金的管理人在本报告期内未持有本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末未持有本基金。

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5月22日（基金合同生效日）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 |
| 建设银行 | 469,889,803.33 | 421,230.72 | 142,416,048.08 | 880,287.09 |

注：本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，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：本基金在本报告期内未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

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：本基金在本报告期内未进行过利润分配。

6.4.12 期末(2021年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|------------|----------|--------|------|--------|----------|----------|-----------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 300614 | 百川畅银 | 2021年5月18日 | 2021年11月 | 新股流通受限 | 9.19 | 40.38 | 329 | 3,023.51 | 13,285.02 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------------------|---------------------------|-------------------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
| | | 日 | 月 25 日 | | | | | | | |
| 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 | 1 |
| 300950 | 德固特 | 2021 年 2 月 24 日 | 2021 年 9 月 3 日 | 新股流 通受限 | 8.41 | 39.13 | 219 | 1,841.79 | 8,569.47 | - |
| 300952 | 恒辉安防 | 2021 年 3 月 3 日 | 2021 年 9 月 13 日 | 新股流 通受限 | 11.72 | 27.08 | 340 | 3,984.80 | 9,207.20 | - |
| 300953 | 震裕科技 | 2021 年 3 月 11 日 | 2021 年 9 月 22 日 | 新股流 通受限 | 28.77 | 99.85 | 240 | 6,904.80 | 23,964.00 | - |
| 300955 | 嘉亨 | 2021 年 | 2021 | 新股流 | 16.53 | 46.07 | 232 | 3,834.96 | 10,688.24 | - |

| | | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|-------------|--------|-------|--------|-------|-----------|------------|--|---|
| | 家化 | 3月16日 | 2021年9月24日 | 通受限 | | | | | | | |
| 300956 | 英力股份 | 2021年3月16日 | 2021年9月27日 | 新股流通受限 | 12.85 | 25.80 | 371 | 4,767.35 | 9,571.80 | | - |
| 300957 | 贝泰妮 | 2021年3月18日 | 2021年9月27日 | 新股流通受限 | 47.33 | 251.96 | 853 | 40,372.49 | 214,921.88 | | - |
| 300958 | 建工修复 | 2021年3月18日 | 2021年9月29日 | 新股流通受限 | 8.53 | 27.22 | 300 | 2,559.00 | 8,166.00 | | - |
| 300960 | 通业科技 | 2021年3月22日 | 2021年9月29日 | 新股流通受限 | 12.08 | 23.06 | 234 | 2,826.72 | 5,396.04 | | - |
| 300961 | 深水海纳 | 2021年3月23日 | 2021年9月30日 | 新股流通受限 | 8.48 | 22.07 | 394 | 3,341.12 | 8,695.58 | | - |
| 300962 | 中金辐照 | 2021年3月29日 | 2021年10月11日 | 新股流通受限 | 3.40 | 16.37 | 576 | 1,958.40 | 9,429.12 | | - |
| 300966 | 共同药业 | 2021年3月31日 | 2021年10月11日 | 新股流通受限 | 8.24 | 31.54 | 286 | 2,356.64 | 9,020.44 | | - |
| 300967 | 晓鸣股份 | 2021年4月2日 | 2021年10月13日 | 新股流通受限 | 4.54 | 11.54 | 507 | 2,301.78 | 5,850.78 | | - |
| 300968 | 格林精密 | 2021年4月6日 | 2021年10月15日 | 新股流通受限 | 6.87 | 12.07 | 1,162 | 7,982.94 | 14,025.34 | | - |
| 300971 | 博亚精工 | 2021年4月7日 | 2021年10月15日 | 新股流通受限 | 18.24 | 28.29 | 245 | 4,468.80 | 6,931.05 | | - |
| 300972 | 万辰生物 | 2021年4月8日 | 2021年10月19日 | 新股流通受限 | 7.19 | 12.65 | 430 | 3,091.70 | 5,439.50 | | - |
| 300973 | 立高食品 | 2021年4月8日 | 2021年10月15日 | 新股流通受限 | 28.28 | 115.71 | 360 | 10,180.80 | 41,655.60 | | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|-------------|--------|-------|-------|-----|----------|-----------|---|
| | | | 日 | | | | | | | |
| 300975 | 商络电子 | 2021年4月14日 | 2021年10月21日 | 新股流通受限 | 5.48 | 13.03 | 492 | 2,696.16 | 6,410.76 | - |
| 300978 | 东箭科技 | 2021年4月15日 | 2021年10月26日 | 新股流通受限 | 8.42 | 13.60 | 593 | 4,993.06 | 8,064.80 | - |
| 300985 | 致远新能 | 2021年4月21日 | 2021年10月29日 | 新股流通受限 | 24.90 | 24.81 | 295 | 7,345.50 | 7,318.95 | - |
| 300986 | 志特新材 | 2021年4月21日 | 2021年11月1日 | 新股流通受限 | 14.79 | 30.57 | 264 | 3,904.56 | 8,070.48 | - |
| 300991 | 创益通 | 2021年5月12日 | 2021年11月22日 | 新股流通受限 | 13.06 | 26.51 | 254 | 3,317.24 | 6,733.54 | - |
| 300992 | 泰福泵业 | 2021年5月17日 | 2021年11月25日 | 新股流通受限 | 9.36 | 20.32 | 200 | 1,872.00 | 4,064.00 | - |
| 300993 | 玉马遮阳 | 2021年5月17日 | 2021年11月24日 | 新股流通受限 | 12.10 | 19.29 | 410 | 4,961.00 | 7,908.90 | - |
| 300995 | 奇德新材 | 2021年5月17日 | 2021年11月26日 | 新股流通受限 | 14.72 | 23.32 | 191 | 2,811.52 | 4,454.12 | - |
| 300996 | 普联软件 | 2021年5月26日 | 2021年12月3日 | 新股流通受限 | 20.81 | 42.23 | 241 | 5,015.21 | 10,177.43 | - |
| 300997 | 欢乐家 | 2021年5月26日 | 2021年12月2日 | 新股流通受限 | 4.94 | 13.05 | 928 | 4,584.32 | 12,110.40 | - |
| 300998 | 宁波方正 | 2021年5月25日 | 2021年12月2日 | 新股流通受限 | 6.02 | 21.32 | 201 | 1,210.02 | 4,285.32 | - |
| 301002 | 崧盛股份 | 2021年5月27日 | 2021年12月7日 | 新股流通受限 | 18.71 | 57.62 | 201 | 3,760.71 | 11,581.62 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|-------------|--------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
| 301004 | 嘉益股份 | 2021年6月18日 | 2021年12月27日 | 新股流通受限 | 7.81 | 21.94 | 312 | 2,436.72 | 6,845.28 | - |
| 301007 | 德迈仕 | 2021年6月4日 | 2021年12月16日 | 新股流通受限 | 5.29 | 14.44 | 303 | 1,602.87 | 4,375.32 | - |
| 301010 | 晶雪节能 | 2021年6月9日 | 2021年12月20日 | 新股流通受限 | 7.83 | 17.61 | 218 | 1,706.94 | 3,838.98 | - |
| 301011 | 华立科技 | 2021年6月9日 | 2021年12月17日 | 新股流通受限 | 14.20 | 33.84 | 175 | 2,485.00 | 5,922.00 | - |
| 301012 | 扬电科技 | 2021年6月15日 | 2021年12月22日 | 新股流通受限 | 8.05 | 24.26 | 170 | 1,368.50 | 4,124.20 | - |
| 301016 | 雷尔伟 | 2021年6月23日 | 2021年12月30日 | 新股流通受限 | 13.75 | 32.98 | 275 | 3,781.25 | 9,069.50 | - |
| 301017 | 漱玉平民 | 2021年6月23日 | 2021年7月5日 | 新股流通受限 | 8.86 | 8.86 | 4,995 | 44,255.70 | 44,255.70 | - |
| 301017 | 漱玉平民 | 2021年6月23日 | 2022年1月5日 | 新股流通受限 | 8.86 | 8.86 | 555 | 4,917.30 | 4,917.30 | - |
| 301020 | 密封科技 | 2021年6月28日 | 2021年7月6日 | 新股流通受限 | 10.64 | 10.64 | 3,789 | 40,314.96 | 40,314.96 | - |
| 301020 | 密封科技 | 2021年6月28日 | 2022年1月6日 | 新股流通受限 | 10.64 | 10.64 | 421 | 4,479.44 | 4,479.44 | - |
| 301021 | 英诺激光 | 2021年6月28日 | 2022年1月6日 | 新股流通受限 | 9.46 | 9.46 | 290 | 2,743.40 | 2,743.40 | - |
| 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 | - |
| 605287 | 德才股份 | 2021年6月28日 | 2021年7月 | 新股流通受限 | 31.56 | 31.56 | 349 | 11,014.44 | 11,014.44 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|-----------------------|---------------------------|------------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
| | | 日 | 6 日 | | | | | | | |
| 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 | - |
| 688655 | 迅捷兴 | 2021 年 4 月 28 日 | 2021 年 11 月 11 日 | 新股流 通受限 | 7.59 | 15.77 | 3,083 | 23,399.97 | 48,618.91 | - |
| 688656 | 浩欧博 | 2021 年 1 月 6 日 | 2021 年 7 月 13 日 | 新股流 通受限 | 35.26 | 72.60 | 1,371 | 48,341.46 | 99,534.60 | - |

注：1、本基金持有的新股流通受限股票冠中生态，于 2021 年 6 月 4 日实施 2020 年年度权益分配方案，向全体股东每 10 股派发现金股利人民币 0.80 元（含税），同时，以资本公积金向全体股东每 10 股转增 5 股。本基金新增 108 股。

2、上述流通受限证券可流通日系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、风险管理部及合规管理部和审计部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

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

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA | - | - |
| AAA 以下 | 20,226,000.00 | 20,716,399.02 |
| 未评级 | - | - |
| 合计 | 20,226,000.00 | 20,716,399.02 |

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。

本基金所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易。因此，除在本报告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 | 469,889,803.33 | - | - | - | - | - | 469,889,803.33 |
| 结算备付金 | 123,401,408.75 | - | - | - | - | - | 123,401,408.75 |
| 存出保证金 | 2,291,619.51 | - | - | - | - | - | 2,291,619.51 |
| 交易性金融资产 | - | - | 70,385,000.00 | 20,226,000.00 | - | 3,026,812,512.78 | 3,117,423,512.78 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 1,652,397.57 | 1,652,397.57 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | 15,241,074.10 | 15,241,074.10 |
| 应收申购款 | 9,686.31 | - | - | - | - | 219,274.07 | 228,960.38 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 97,930.63 | 97,930.63 |
| 资产总计 | 595,592,517.90 | - | 70,385,000.00 | 20,226,000.00 | - | 3,044,023,189.15 | 3,730,226,707.05 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 4,428,787.37 | 4,428,787.37 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 738,131.22 | 738,131.22 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | 101,012,000.77 | 101,012,000.77 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 1,274,977.09 | 1,274,977.09 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 2,200.80 | 2,200.80 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 89,260.15 | 89,260.15 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 107,545,357.40 | 107,545,357.40 |

| | | | | | | | |
|--------------------------|----------------|--------|---------------|---------------|------------|------------------|------------------|
| 利率敏感度缺口 | 595,592,517.90 | - | 70,385,000.00 | 20,226,000.00 | - | 2,936,477,831.75 | 3,622,681,349.65 |
| 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 | 209,752,276.77 | - | - | - | - | - | 209,752,276.77 |
| 结算备付金 | 603,299.31 | - | - | - | - | - | 603,299.31 |
| 存出保证金 | 10,908,565.90 | - | - | - | - | - | 10,908,565.90 |
| 交易性金融资产 | - | - | 70,497,000.00 | 19,942,000.00 | 774,399.02 | 2,905,903,703.18 | 2,997,117,102.20 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 2,417,250.70 | 2,417,250.70 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | 862,449.44 | 862,449.44 |
| 应收申购款 | 30,990.35 | - | - | - | - | 300,039.86 | 331,030.21 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 10,656.39 | 10,656.39 |
| 资产总计 | 221,295,132.33 | - | 70,497,000.00 | 19,942,000.00 | 774,399.02 | 2,909,494,099.57 | 3,222,002,630.92 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 3,897,228.69 | 3,897,228.69 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 649,538.13 | 649,538.13 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | 11,281,881.34 | 11,281,881.34 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 924,298.13 | 924,298.13 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 2,275.54 | 2,275.54 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 140,000.00 | 140,000.00 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 16,895,221.83 | 16,895,221.83 |
| 利率敏感度缺口 | 221,295,132.33 | - | 70,497,000.00 | 19,942,000.00 | 774,399.02 | 2,892,598,877.74 | 3,205,107,409.09 |

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)。 | | |
| | 其他影响债券公允价值的变量保持不变，仅利率发生变动； | | |
| | 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 | 1. 市场利率下降 1% | 635,874.83 | 688,059.10 |
| | 2. 市场利率上升 1% | -624,863.53 | -673,927.24 |

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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。本基金持有非记账本位币人民币计价的资产，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。

本报告期末基金各外币资产负债项目汇率风险敞口如下。本出于列报考虑，风险敞口金额以人民币列示，以资产负债表日即期汇率折算。

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 | - | 2,763,854,777.29 | - | 2,763,854,777.29 |
| 资产合计 | - | 2,763,854,777.29 | - | 2,763,854,777.29 |

| | | | | |
|---------------|--------------------------|------------------|------------|------------------|
| | | 29 | | |
| 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 | - | 2,763,854,777.29 | - | 2,763,854,777.29 |
| 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 | - | 2,539,770,673.34 | - | 2,539,770,673.34 |
| 资产合计 | - | 2,539,770,673.34 | - | 2,539,770,673.34 |
| 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 | - | 2,539,770,673.34 | - | 2,539,770,673.34 |

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

| | | | |
|-----------|-----------------------------|------------------------|-----------------|
| 假设 | 除汇率以外的其他变量不变 | | |
| 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 | 所有外币对人民币升值 5% | 138,192,738.86 | 127,031,656.14 |
| | 所有外币对人民币贬值 5% | -138,192,738.86 | -127,031,656.14 |

6.4.13.4.3 其他价格风险

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 | 3,026,812,512.78 | 83.55 | 2,905,903,703.18 | 90.66 |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—债券投资 | 90,611,000.00 | 2.50 | 91,213,399.02 | 2.85 |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产—权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 3,117,423,512.78 | 86.05 | 2,997,117,102.20 | 93.51 |

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) |
| 分析 | 1. 业绩比较基准上升 10% | 418,697,663.77 | 231,042,635.73 |
| | 2. 业绩比较基准下降 10% | -418,697,663.77 | -231,042,635.73 |

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 | 3,026,812,512.78 | 81.14 |
| | 其中：股票 | 3,026,812,512.78 | 81.14 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 90,611,000.00 | 2.43 |
| | 其中：债券 | 90,611,000.00 | 2.43 |
| | 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 | 593,291,212.08 | 15.90 |
| 8 | 其他各项资产 | 19,511,982.19 | 0.52 |
| 9 | 合计 | 3,730,226,707.05 | 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 2,763,854,777.29 元，占净值比例 76.29%。

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 | 12,474,262.28 | 0.34 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 232,495,194.01 | 6.42 |
| 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 | 68,689.00 | 0.00 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |

| | | | |
|---|-----------------|----------------|------|
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 17,732,269.43 | 0.49 |
| J | 金融业 | - | - |
| 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 | 131,868.00 | 0.00 |
| 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 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 262,957,735.49 | 7.26 |

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 | 1,092,754.02 | 0.03 |
| 非日常生活消费品 | 815,964,697.58 | 22.52 |
| 日常消费品 | 71,079,601.92 | 1.96 |
| 能源 | 52,665,205.56 | 1.45 |
| 金融 | 482,529,640.62 | 13.32 |
| 医疗保健 | 426,722,611.65 | 11.78 |
| 工业 | 131,837,293.05 | 3.64 |
| 信息技术 | 157,765,122.19 | 4.35 |
| 通信服务 | 289,181,873.68 | 7.98 |
| 公用事业 | 36,494,030.30 | 1.01 |
| 房地产 | 298,521,946.72 | 8.24 |
| 合计 | 2,763,854,777.29 | 76.29 |

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 | 00700 | 腾讯控股 | 472,900 | 229,798,529.09 | 6.34 |
| 2 | 06098 | 碧桂园服务 | 2,227,000 | 155,470,237.22 | 4.29 |
| 3 | 01999 | 敏华控股 | 6,816,000 | 105,829,392.84 | 2.92 |
| 4 | 00388 | 香港交易所 | 251,100 | 96,695,251.29 | 2.67 |
| 5 | 03968 | 招商银行 | 1,668,000 | 91,949,000.40 | 2.54 |
| 6 | 02318 | 中国平安 | 1,452,000 | 91,882,101.17 | 2.54 |
| 7 | 00868 | 信义玻璃 | 3,434,000 | 90,435,530.09 | 2.50 |
| 8 | 02382 | 舜宇光学科技 | 408,400 | 83,392,189.23 | 2.30 |

| | | | | | |
|----|--------|----------|------------|---------------|------|
| 9 | 00867 | 康哲药业 | 4,869,000 | 82,851,079.28 | 2.29 |
| 10 | 01066 | 威高股份 | 5,260,000 | 79,306,543.30 | 2.19 |
| 11 | 00881 | 中升控股 | 1,464,000 | 78,693,466.75 | 2.17 |
| 12 | 01658 | 邮储银行 | 16,619,000 | 72,322,205.23 | 2.00 |
| 13 | 00291 | 华润啤酒 | 1,204,000 | 69,877,246.32 | 1.93 |
| 14 | 03606 | 福耀玻璃 | 1,532,800 | 69,765,048.65 | 1.93 |
| 15 | 01299 | 友邦保险 | 812,200 | 65,216,183.78 | 1.80 |
| 16 | 01928 | 金沙中国有限公司 | 2,387,200 | 64,953,363.00 | 1.79 |
| 17 | 01398 | 工商银行 | 16,990,000 | 64,464,898.75 | 1.78 |
| 18 | 02020 | 安踏体育 | 423,000 | 64,340,086.75 | 1.78 |
| 19 | 01691 | J S 环球生活 | 3,463,500 | 62,969,713.40 | 1.74 |
| 20 | 00960 | 龙湖集团 | 1,700,000 | 61,532,316.00 | 1.70 |
| 21 | 01177 | 中国生物制药 | 9,566,500 | 60,655,911.10 | 1.67 |
| 22 | 01268 | 美东汽车 | 1,714,000 | 60,398,939.83 | 1.67 |
| 23 | 02359 | 药明康德 | 364,660 | 55,011,186.88 | 1.52 |
| 24 | 600031 | 三一重工 | 1,816,600 | 52,808,562.00 | 1.46 |
| 25 | 00883 | 中国海洋石油 | 7,168,000 | 52,665,205.56 | 1.45 |
| 26 | 00880 | 澳博控股 | 7,452,000 | 52,581,598.16 | 1.45 |
| 27 | 02333 | 长城汽车 | 2,479,500 | 51,784,873.24 | 1.43 |
| 28 | 02013 | 微盟集团 | 3,608,000 | 51,396,716.24 | 1.42 |
| 29 | 03690 | 美团-W | 179,800 | 47,934,398.07 | 1.32 |
| 30 | 02500 | 启明医疗-B | 792,500 | 42,697,665.15 | 1.18 |
| 31 | 02196 | 复星医药 | 808,000 | 42,154,504.13 | 1.16 |
| 32 | 02338 | 潍柴动力 | 2,751,000 | 39,509,038.90 | 1.09 |
| 33 | 00669 | 创科实业 | 347,500 | 39,208,441.68 | 1.08 |
| 34 | 002050 | 三花智控 | 1,617,800 | 38,794,844.00 | 1.07 |
| 35 | 02313 | 申洲国际 | 224,600 | 36,648,181.44 | 1.01 |
| 36 | 00270 | 粤海投资 | 3,930,000 | 36,494,030.30 | 1.01 |
| 37 | 600521 | 华海药业 | 1,688,500 | 35,255,880.00 | 0.97 |
| 38 | 00941 | 中国移动 | 865,000 | 34,943,823.66 | 0.96 |
| 39 | 600309 | 万华化学 | 318,800 | 34,691,816.00 | 0.96 |
| 40 | 02269 | 药明生物 | 268,500 | 31,791,738.20 | 0.88 |
| 41 | 603068 | 博通集成 | 324,592 | 26,713,921.60 | 0.74 |
| 42 | 02869 | 绿城服务 | 2,572,000 | 25,809,723.71 | 0.71 |
| 43 | 00552 | 中国通信服务 | 7,570,000 | 24,439,520.93 | 0.67 |
| 44 | 00027 | 银河娱乐 | 468,000 | 24,202,045.30 | 0.67 |
| 45 | 06862 | 海底捞 | 670,000 | 22,801,488.24 | 0.63 |
| 46 | 300124 | 汇川技术 | 298,938 | 22,199,135.88 | 0.61 |
| 47 | 01209 | 华润万象生活 | 490,600 | 21,696,810.51 | 0.60 |
| 48 | 01833 | 平安好医生 | 260,500 | 20,960,386.43 | 0.58 |
| 49 | 688339 | 亿华通 | 73,332 | 20,730,956.40 | 0.57 |

| | | | | | |
|----|--------|--------|-----------|---------------|------|
| 50 | 03669 | 永达汽车 | 1,560,000 | 18,042,822.72 | 0.50 |
| 51 | 002624 | 完美世界 | 741,200 | 17,722,092.00 | 0.49 |
| 52 | 03888 | 金山软件 | 408,000 | 15,803,196.19 | 0.44 |
| 53 | 00873 | 世茂服务 | 705,000 | 15,750,650.34 | 0.43 |
| 54 | 002299 | 圣农发展 | 521,900 | 12,462,972.00 | 0.34 |
| 55 | 00780 | 同程艺龙 | 687,600 | 11,122,366.76 | 0.31 |
| 56 | 00683 | 嘉里建设 | 472,000 | 10,054,189.06 | 0.28 |
| 57 | 09997 | 康基医疗 | 797,500 | 8,573,502.70 | 0.24 |
| 58 | 09983 | 建业新生活 | 759,000 | 4,982,919.40 | 0.14 |
| 59 | 00341 | 大家乐集团 | 330,000 | 4,382,398.94 | 0.12 |
| 60 | 00016 | 新鸿基地产 | 33,500 | 3,225,100.48 | 0.09 |
| 61 | 00285 | 比亚迪电子 | 73,500 | 3,119,051.88 | 0.09 |
| 62 | 01810 | 小米集团-W | 109,800 | 2,466,784.37 | 0.07 |
| 63 | 01888 | 建滔积层板 | 109,500 | 1,587,184.28 | 0.04 |
| 64 | 00460 | 四环医药 | 561,000 | 1,549,765.64 | 0.04 |
| 65 | 00586 | 海螺创业 | 55,500 | 1,510,100.39 | 0.04 |
| 66 | 06808 | 高鑫零售 | 250,000 | 1,202,355.60 | 0.03 |
| 67 | 01873 | 维亚生物 | 141,500 | 1,170,328.84 | 0.03 |
| 68 | 03323 | 中国建材 | 144,000 | 1,092,754.02 | 0.03 |
| 69 | 02128 | 中国联塑 | 24,000 | 382,623.67 | 0.01 |
| 70 | 688161 | 威高骨科 | 3,069 | 325,467.45 | 0.01 |
| 71 | 01797 | 新东方在线 | 37,500 | 303,605.19 | 0.01 |
| 72 | 300957 | 贝泰妮 | 853 | 214,921.88 | 0.01 |
| 73 | 688621 | 阳光诺和 | 1,485 | 131,868.00 | 0.00 |
| 74 | 688656 | 浩欧博 | 1,371 | 99,534.60 | 0.00 |
| 75 | 300919 | 中伟股份 | 610 | 99,430.00 | 0.00 |
| 76 | 688087 | 英科再生 | 2,469 | 54,219.24 | 0.00 |
| 77 | 301017 | 漱玉平民 | 5,550 | 49,173.00 | 0.00 |
| 78 | 688655 | 迅捷兴 | 3,083 | 48,618.91 | 0.00 |
| 79 | 301020 | 密封科技 | 4,210 | 44,794.40 | 0.00 |
| 80 | 300894 | 火星人 | 628 | 42,704.00 | 0.00 |
| 81 | 300973 | 立高食品 | 360 | 41,655.60 | 0.00 |
| 82 | 301021 | 英诺激光 | 2,899 | 27,424.54 | 0.00 |
| 83 | 300953 | 震裕科技 | 240 | 23,964.00 | 0.00 |
| 84 | 001207 | 联科科技 | 682 | 22,581.02 | 0.00 |
| 85 | 300932 | 三友联众 | 492 | 15,601.32 | 0.00 |
| 86 | 300968 | 格林精密 | 1,162 | 14,025.34 | 0.00 |
| 87 | 300614 | 百川畅银 | 329 | 13,285.02 | 0.00 |
| 88 | 300937 | 药易购 | 244 | 13,105.24 | 0.00 |
| 89 | 300942 | 易瑞生物 | 443 | 12,634.36 | 0.00 |
| 90 | 300997 | 欢乐家 | 928 | 12,110.40 | 0.00 |
| 91 | 300933 | 中辰股份 | 1,112 | 11,609.28 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-----|-----------|------|
| 92 | 301002 | 崧盛股份 | 201 | 11,581.62 | 0.00 |
| 93 | 605287 | 德才股份 | 349 | 11,014.44 | 0.00 |
| 94 | 300955 | 嘉亨家化 | 232 | 10,688.24 | 0.00 |
| 95 | 300996 | 普联软件 | 241 | 10,177.43 | 0.00 |
| 96 | 300956 | 英力股份 | 371 | 9,571.80 | 0.00 |
| 97 | 300962 | 中金辐照 | 576 | 9,429.12 | 0.00 |
| 98 | 300952 | 恒辉安防 | 340 | 9,207.20 | 0.00 |
| 99 | 301016 | 雷尔伟 | 275 | 9,069.50 | 0.00 |
| 100 | 300966 | 共同药业 | 286 | 9,020.44 | 0.00 |
| 101 | 300948 | 冠中生态 | 324 | 8,884.08 | 0.00 |
| 102 | 300931 | 通用电梯 | 672 | 8,809.92 | 0.00 |
| 103 | 300961 | 深水海纳 | 394 | 8,695.58 | 0.00 |
| 104 | 300950 | 德固特 | 219 | 8,569.47 | 0.00 |
| 105 | 300958 | 建工修复 | 300 | 8,166.00 | 0.00 |
| 106 | 300986 | 志特新材 | 264 | 8,070.48 | 0.00 |
| 107 | 300978 | 东箭科技 | 593 | 8,064.80 | 0.00 |
| 108 | 300926 | 博俊科技 | 359 | 7,969.80 | 0.00 |
| 109 | 300993 | 玉马遮阳 | 410 | 7,908.90 | 0.00 |
| 110 | 300985 | 致远新能 | 295 | 7,318.95 | 0.00 |
| 111 | 300971 | 博亚精工 | 245 | 6,931.05 | 0.00 |
| 112 | 301004 | 嘉益股份 | 312 | 6,845.28 | 0.00 |
| 113 | 300991 | 创益通 | 254 | 6,733.54 | 0.00 |
| 114 | 300927 | 江天化学 | 217 | 6,531.70 | 0.00 |
| 115 | 300975 | 商络电子 | 492 | 6,410.76 | 0.00 |
| 116 | 301011 | 华立科技 | 175 | 5,922.00 | 0.00 |
| 117 | 300967 | 晓鸣股份 | 507 | 5,850.78 | 0.00 |
| 118 | 300972 | 万辰生物 | 430 | 5,439.50 | 0.00 |
| 119 | 300929 | 华骐环保 | 183 | 5,407.65 | 0.00 |
| 120 | 300960 | 通业科技 | 234 | 5,396.04 | 0.00 |
| 121 | 300995 | 奇德新材 | 191 | 4,454.12 | 0.00 |
| 122 | 301007 | 德迈仕 | 303 | 4,375.32 | 0.00 |
| 123 | 300998 | 宁波方正 | 201 | 4,285.32 | 0.00 |
| 124 | 301012 | 扬电科技 | 170 | 4,124.20 | 0.00 |
| 125 | 300992 | 泰福泵业 | 200 | 4,064.00 | 0.00 |
| 126 | 301010 | 晶雪节能 | 218 | 3,838.98 | 0.00 |
| 127 | 06690 | 海尔智家 | 100 | 2,254.94 | 0.00 |
| 128 | 06110 | 滔搏 | 20 | 211.68 | 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 | 00291 | 华润啤酒 | 66,845,511.94 | 2.09 |
| 2 | 01999 | 敏华控股 | 66,338,919.55 | 2.07 |
| 3 | 03606 | 福耀玻璃 | 62,806,139.81 | 1.96 |
| 4 | 01691 | JS 环球生活 | 59,169,213.12 | 1.85 |
| 5 | 300014 | 亿纬锂能 | 57,915,761.60 | 1.81 |
| 6 | 02500 | 启明医疗-B | 57,393,418.40 | 1.79 |
| 7 | 00883 | 中国海洋石油 | 53,562,656.85 | 1.67 |
| 8 | 00867 | 康哲药业 | 53,021,585.90 | 1.65 |
| 9 | 01810 | 小米集团-W | 52,819,388.70 | 1.65 |
| 10 | 02333 | 长城汽车 | 52,799,277.78 | 1.65 |
| 11 | 00941 | 中国移动 | 51,332,377.24 | 1.60 |
| 12 | 00868 | 信义玻璃 | 51,099,231.23 | 1.59 |
| 13 | 02338 | 潍柴动力 | 50,738,890.79 | 1.58 |
| 14 | 00839 | 中教控股 | 49,759,193.35 | 1.55 |
| 15 | 02359 | 药明康德 | 48,565,025.91 | 1.52 |
| 16 | 06078 | 海吉亚医疗 | 47,018,281.50 | 1.47 |
| 17 | 603799 | 华友钴业 | 42,392,658.80 | 1.32 |
| 18 | 603068 | 博通集成 | 40,058,070.97 | 1.25 |
| 19 | 02196 | 复星医药 | 39,456,108.97 | 1.23 |
| 20 | 00688 | 中国海外发展 | 37,049,207.17 | 1.16 |

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 | 01093 | 石药集团 | 113,768,807.04 | 3.55 |
| 2 | 688099 | 晶晨股份 | 89,504,272.57 | 2.79 |
| 3 | 01810 | 小米集团-W | 85,354,568.94 | 2.66 |
| 4 | 06690 | 海尔智家 | 79,772,520.84 | 2.49 |
| 5 | 002475 | 立讯精密 | 74,516,304.42 | 2.32 |
| 6 | 300124 | 汇川技术 | 74,354,957.36 | 2.32 |
| 7 | 300014 | 亿纬锂能 | 64,377,209.43 | 2.01 |
| 8 | 00968 | 信义光能 | 61,454,393.11 | 1.92 |
| 9 | 06078 | 海吉亚医疗 | 59,101,383.16 | 1.84 |
| 10 | 01109 | 华润置地 | 54,094,239.71 | 1.69 |
| 11 | 00839 | 中教控股 | 53,402,203.74 | 1.67 |
| 12 | 00522 | ASM PACIFIC | 52,850,224.87 | 1.65 |
| 13 | 06865 | 福莱特玻璃 | 51,788,263.67 | 1.62 |

| | | | | |
|----|--------|----------|---------------|------|
| 14 | 603799 | 华友钴业 | 50,788,621.40 | 1.58 |
| 15 | 03888 | 金山软件 | 47,167,139.28 | 1.47 |
| 16 | 002044 | 美年健康 | 42,942,578.20 | 1.34 |
| 17 | 00813 | 世茂集团 | 42,608,280.37 | 1.33 |
| 18 | 01112 | H&H 国际控股 | 38,780,637.50 | 1.21 |
| 19 | 00011 | 恒生银行 | 37,590,572.57 | 1.17 |
| 20 | 01458 | 周黑鸭 | 37,507,701.38 | 1.17 |

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 | 1,768,708,817.02 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 2,000,639,566.01 |

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 | 70,385,000.00 | 1.94 |
| | 其中：政策性金融债 | 70,385,000.00 | 1.94 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 20,226,000.00 | 0.56 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 90,611,000.00 | 2.50 |

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 | 160218 | 16 国开 18 | 700,000 | 70,385,000.00 | 1.94 |
| 2 | 102000391 | 20 重庆钢铁 MTN001B | 200,000 | 20,226,000.00 | 0.56 |

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：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。

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、招商银行股份有限公司、中国平安保险（集团）股份有限公司、山东威高集团医用高分子制品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未超出基金合同规定的备选股票库。

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 | 2,291,619.51 |
| 2 | 应收证券清算款 | 97,930.63 |
| 3 | 应收股利 | 15,241,074.10 |
| 4 | 应收利息 | 1,652,397.57 |
| 5 | 应收申购款 | 228,960.38 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 19,511,982.19 |

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（%） |
| 75,138 | 39,337.80 | 51,372,946.37 | 1.74 | 2,904,390,702.88 | 98.26 |

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 | 1,833,086.78 | 0.0620 |

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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 10~50 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|-------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2020年5月22日） 基金份额总额 | 2,870,103,924.47 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 2,893,499,522.39 |
| 本报告期基金总申购份额 | 62,264,126.86 |
| 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 | 2,955,763,649.25 |

注：申购含红利再投资、转换入份额。

§ 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

本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 | 佣金 | 占当期佣金 | |
| | | | | | | |

| | | | 比例 | | 总量的比例 | |
|------------|---|------------------|--------|------------|--------|---|
| 华泰证券 | 2 | 1,041,136,598.04 | 27.68% | 708,359.34 | 27.21% | - |
| 西部证券 | 2 | 798,885,667.04 | 21.24% | 553,435.84 | 21.26% | - |
| 申万宏源 证券 | 2 | 499,228,183.45 | 13.27% | 368,258.59 | 14.15% | - |
| 东方证券 | 1 | 377,747,181.28 | 10.04% | 261,924.36 | 10.06% | - |
| 兴业证券 | 2 | 274,531,174.00 | 7.30% | 185,849.45 | 7.14% | - |
| 中信建投 证券 | 2 | 249,715,326.25 | 6.64% | 173,112.35 | 6.65% | - |
| 东方财富 证券 | 2 | 233,212,183.35 | 6.20% | 114,828.77 | 4.41% | - |
| 长江证券 | 1 | 133,884,578.50 | 3.56% | 124,687.54 | 4.79% | - |
| 中金公司 | 1 | 128,961,094.70 | 3.43% | 90,266.14 | 3.47% | - |
| 银河证券 | 1 | 23,764,759.37 | 0.63% | 22,132.52 | 0.85% | - |
| 爱建证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 德邦证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国都证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国元证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华宝证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华鑫证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |

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 |
| 华泰证券 | 759,906.85 | 100.00% | - | - | - | - |
| 西部证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东方财富证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - |
| 爱建证券 | - | - | - | - | - | - |
| 德邦证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国都证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - |
| 国元证券 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华宝证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华鑫证券 | - | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - |

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 | 关于增加北京汇成基金销售有限公司、长量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站 | 2021-01-14 |
| 2 | 关于兴全沪港深两年持有期混合型证券投资基金暂停申购、转换转入、定期定额投资业务的公告 | 上海证券报及规定互联网站 | 2021-02-03 |
| 3 | 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站 | 2021-02-09 |

| | | | |
|----|--|---------------|------------|
| 4 | 关于增加中原证券为旗下部分基金销售机构的公告 | 上海证券报及规定互联网网站 | 2021-03-05 |
| 5 | 关于兴全沪港深两年持有期混合型证券投资基金暂停申购、转换转入、定期定额投资业务的公告 | 上海证券报及规定互联网网站 | 2021-03-29 |
| 6 | 关于兴全沪港深两年持有期混合型证券投资基金暂停申购、转换转入、定期定额投资业务的公告 | 上海证券报及规定互联网网站 | 2021-04-26 |
| 7 | 关于兴全沪港深两年持有期混合型证券投资基金暂停申购、转换转入、定期定额投资业务的公告 | 上海证券报及规定互联网网站 | 2021-05-17 |
| 8 | 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 |
| 9 | 关于增加北京新浪仓石基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告 | 上海证券报及规定互联网网站 | 2021-06-16 |
| 10 | 关于增加泛华普益基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告 | 上海证券报及规定互联网网站 | 2021-06-17 |
| 11 | 关于调整网上直销基金转换、赎回转购、汇款交易优惠费率的公告 | 上海证券报及规定互联网网站 | 2021-06-18 |
| 12 | 关于兴全沪港深两年持有期混合型证券投资基金暂停申购、转换转入、定期定额投资业务的公告 | 上海证券报及规定互联网网站 | 2021-06-28 |

§ 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限为 2 年。

§ 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沪港深两年持有期混合型证券投资基金募集注册的文件；
2. 《兴全沪港深两年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《兴全沪港深两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沪港深两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