

# 兴全安泰积极养老目标五年持有期混合型 发起式基金中基金（FOF） 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：兴业银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 08 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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	5
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
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
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
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	10
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	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>46</b>
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51

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 .....	52
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 .....	52
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 .....	52
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 .....	52
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	52
7.12 本报告期投资基金情况 .....	53
7.13 投资组合报告附注 .....	60
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>61</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	62
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 .....	62
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	62
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>62</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>63</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	63
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	63
10.4 基金投资策略的改变 .....	63
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	63
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	63
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	63
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	63
10.9 其他重大事件 .....	64
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>66</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	66
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>66</b>
12.1 备查文件目录 .....	66
12.2 存放地点 .....	67
12.3 查阅方式 .....	67

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	兴全安泰积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）
基金简称	兴全安泰积极养老五年持有混合发起式 FOF
基金主代码	010267
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 12 月 16 日
基金管理人	兴证全球基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	988,724,961.60 份
基金合同存续期	不定期

注：本基金每份基金份额的最短持有期限为 5 年。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的前提下，本基金主要通过成熟稳健的资产配置策略和公募基金精选策略进行投资，力求基金资产的长期稳健增值，满足投资者的养老资金理财需求。
投资策略	作为一只服务于投资者养老需求的基金，本基金定位为积极型的目标风险策略基金，根据特定的风险偏好设定权益类和固定收益类资产的比例，以获取养老资金的长期稳健增值。
业绩比较基准	中证偏股型基金指数收益率×70%+中债综合（全价）指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金和货币型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。

### 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	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨卫东
	联系电话	021-20398888
	电子邮箱	yangwd@xqfunds.com
客户服务电话	4006780099, 021-38824536	95561
传真	021-20398858	021-62159217
注册地址	上海市黄浦区金陵东路 368 号	福州市湖东路 154 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	上海市银城路 167 号兴业大厦 4 楼
邮政编码	201204	200041
法定代表人	杨华辉	吕家进

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网	<a href="http://www.xqfunds.com">http://www.xqfunds.com</a>

址	
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 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	13,551,811.50
本期利润	52,235,174.56
加权平均基金份额本期利润	0.0535
本期加权平均净值利润率	5.17%
本期基金份额净值增长率	5.27%
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	14,406,147.74
期末可供分配基金份额利润	0.0146
期末基金资产净值	1,052,708,501.01
期末基金份额净值	1.0647
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	6.47%

注：1、上述财务指标采用的计算公式，详见中国证券监督管理委员会发布的《证券投资基金信息披露编报规则第 1 号〈主要财务指标的计算及披露〉》、《证券投资基金会计核算业务指引》等相关法规。

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

过去一个月	0.60%	0.44%	1.53%	0.68%	-0.93%	-0.24%
过去三个月	3.94%	0.45%	8.98%	0.73%	-5.04%	-0.28%
过去六个月	5.27%	0.47%	6.23%	1.00%	-0.96%	-0.53%
自基金合同生效起至今	6.47%	0.45%	11.12%	0.98%	-4.65%	-0.53%

注：1、本基金业绩比较基准为：中证偏股型基金指数收益率×70%+中债综合（全价）指数收益率×30%。采用该业绩比较基准主要基于以下考虑：中证偏股型基金指数选取内地市场所有股票型基金以及混合型基金中以股票为主要投资对象的基金作为样本，采用净值规模加权，以较好的反映所有偏股型开放式证券投资基金的整体走势。本基金主要投资于公开募集的证券投资基金，且原则上会以70%的基金资产投资于权益类资产，因此本基金业绩比较基准中的70%选择了中证偏股型基金指数收益率。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。选用以上业绩比较基准可以有效评估本基金投资组合业绩，反映本基金的风格特点。

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：

$$\text{Return}_t = 70\% \times (\text{中证偏股型基金指数收益率}_t / \text{中证偏股型基金指数收益率}_{t-1} - 1) + 30\% \times (\text{中债综合（全价）指数收益率}_t / \text{中债综合（全价）指数收益率}_{t-1} - 1)$$

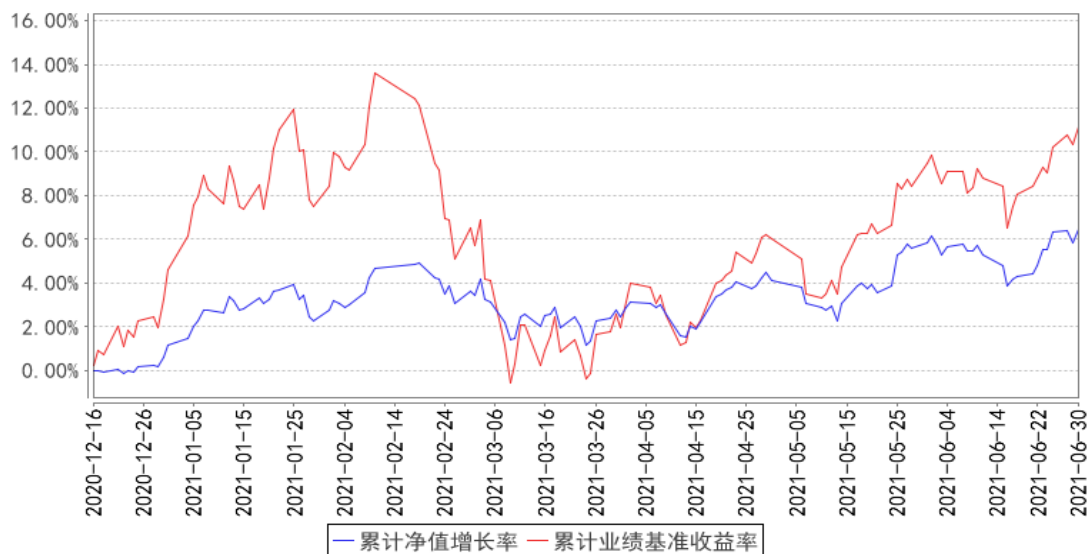
$$\text{Benchmark}_t = (1 + \text{Return}_t) \times (1 + \text{Benchmark}_{t-1}) - 1$$

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

2、本基金成立于2020年12月16日，截至2021年6月30日，本基金成立不满一年。

### 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

兴全安泰积极养老五年持有混合发起式FOF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《兴全安泰积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》的规定，本基金建仓期为 2020 年 12 月 16 日起共计六个月。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

3、本基金成立于 2020 年 12 月 16 日，截至 2021 年 06 月 30 日，本基金成立不满一年。

### 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		
林国怀	FOF 投资与金融工程部、养老金管理部总监，兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）、兴全安泰稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、兴全安泰积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基	2020 年 12 月 16 日	-	14 年	硕士。历任天相投资顾问有限公司基金分析师，瑞泰人寿保险基金组合投资经理，合众人寿资产管理中心基金组合投资经理，泰康资产管理有限公司执行总监，天安人寿资产管理中心权益投资部经理。

	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遵规守信情况的说明

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、《兴全安泰积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）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

2021 年上半年股票市场大幅震荡，年初在“茅指数”的带动下市场快速上涨，同时分化明显；春节后市场开始出现较大幅度的回调，前期涨幅较大的板块和个股跌幅领先，但经过 3、4 月份的市场震荡后，市场重拾升势，在新能源、半导体以及部分周期股的带动下又快速上涨。上半年，以创业板 50 为代表的成长板块涨幅居前，创业板 50 指数上涨 23.11%，创业板指上涨 17.22%；以高股息周期股为主的中证红利指数上半年上涨 12.14%；中小盘风格的中证 500 和中证 1000 分别上涨 6.93% 和 6.58%；而主流的沪深 300、上证 50 指数分别上涨 0.24% 和下跌 3.9%。从市场风格

上来看，上半年高市盈率指数和高市净率指数整体表现更为出色，价值因子再度落后；小盘风格指数优于中盘风格和大盘风格。从基金市场表现来看，偏股基金指数上半年上涨 8.32%，中长期纯债基金指数上涨 1.85%，黄金 ETF 下跌 6.91%。

资产配置层面，春节之前随着股票市场的快速上涨，不少行业和个股的估值水平已经处于历史极高位置，本基金在建仓初期节奏相对较慢；随着三月份以来市场的快速回落调整，本基金逐步提升了权益基金的仓位；二季度末，权益类资产仓位已处于合同约定范围之内，未来该基金仍将继续坚持“越跌越买”的方式。

基金选择层面，本基金前期建仓主要以价值型、GARP 型的权益基金以及偏绝对收益的基金品种为主，同时积极挖掘市场上绝对收益和相对收益的投资机会。未来随着市场逐渐趋于理性，本基金也将逐步的将组合调整到一贯的思路和策略。

#### 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 1.0647 元；本报告期基金份额净值增长率为 5.27%，业绩比较基准收益率为 6.23%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着央行的超预期降准，市场对于宏观经济的判断开始出现分歧，越来越多的投资者开始担忧后续的宏观经济，目前从宏观经济数据来看，也有边际放缓的趋势；整体市场的估值水平相对中性，但分化依然尤为明显，部分行业和板块的估值水平处于历史极高水平，同时也有部分行业和板块的估值水平处于历史极低水平。从基金的半年报的情况来看，食品饮料、医药、电子和新能源四个板块在权益基金的持仓中占据较大的权重，整体基金市场出现了较高的行业偏离现象。

我们仍然对 A 股的长期走势保持乐观，但从中短期而言，因为市场预期过于一致，机构投资者的持仓整体估值水平偏高，我们对此保持谨慎，所以在整体的组合管理过程中，我们会做好板块之间的再平衡，始终把组合的安全边际作为重要考量，积极把握市场上确定性较高的投资机会。

本基金是一只积极型的养老目标基金，我们将秉承勤勉尽责的态度进行组合管理，遵守契约要求、保持策略的稳定性，为持有人争取更高的投资回报和养老储备。

#### 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》、《兴全安泰积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》及其他相关法律法规的规定，本基金本报告期内未进行利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金为发起式基金，截至报告期末成立不满三年，本项不适用。

### § 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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，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：兴全安泰积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	21,530,106.05	169,455,198.83
结算备付金		324,170.99	-
存出保证金		179,818.01	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,030,843,886.85	803,594,234.96
其中：股票投资		146,259,562.85	134,669,208.14
基金投资		882,958,539.82	668,354,758.89
债券投资		1,625,784.18	570,267.93
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		594,002.83	5,999,986.60
应收利息	6.4.7.5	2,836.61	37,671.20
应收股利		88.51	1,032,565.90
应收申购款		35,594.74	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	14.10	142.09
资产总计		1,053,510,518.69	980,119,799.58
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年6月30日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		586,938.63	302,308.85
应付托管费		117,921.67	56,583.46
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	13,826.99	94,325.31
应交税费		19.71	0.30
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	83,310.68	10,000.00
负债合计		802,017.68	463,217.92
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	988,724,961.60	968,588,783.01
未分配利润	6.4.7.10	63,983,539.41	11,067,798.65
所有者权益合计		1,052,708,501.01	979,656,581.66
负债和所有者权益总计		1,053,510,518.69	980,119,799.58

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0647 元，基金份额总额 988,724,961.60 份。

## 6.2 利润表

会计主体：兴全安泰积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

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
一、收入		56,892,870.00
1. 利息收入		533,168.11
其中：存款利息收入	6.4.7.11	113,113.82
债券利息收入		391,780.29
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		28,274.00
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		17,675,508.07
其中：股票投资收益	6.4.7.12	11,732,053.22
基金投资收益	6.4.7.13	1,059,843.39
债券投资收益	6.4.7.14	-267,550.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-
股利收益	6.4.7.17	5,151,161.46
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	38,683,363.06
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	830.76
减：二、费用		4,657,695.44
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,440,526.33

2. 托管费	6.4.10.2.2	692,345.06
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.20	431,293.75
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		4.62
7. 其他费用	6.4.7.21	93,525.68
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		52,235,174.56
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		52,235,174.56

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴全安泰积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

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）	968,588,783.01	11,067,798.65	979,656,581.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	52,235,174.56	52,235,174.56
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）	20,136,178.59	680,566.20	20,816,744.79
其中：1. 基金申购款	20,136,178.59	680,566.20	20,816,744.79
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）	988,724,961.60	63,983,539.41	1,052,708,501.01

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

兴全安泰积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）（以下简称“本基金”）系由基金管理人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》、《兴全安泰积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》（以下简称“基金合同”）及其他有关法律法规的规定，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[2020]2167 号文准予公开募集注册。本基金为契约型、开放式基金，存续期限为不定期。本基金首次设立募集基金份额为 968,588,783.01 份，经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验证，并出具了编号为德师报（验）字（20）第 00687 号验资报告。基金合同于 2020 年 12 月 16 日正式生效。本基金的基金管理人为兴证全球基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金（包括 QDII 基金和香港互认基金）、国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板以及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、证券公司短期公司债券、可转换债券（含可分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具以及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。

本基金的业绩比较基准为：中证偏股型基金指数收益率×70%+中债综合（全价）指数收益率×30%。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定（以下简称“企业会计准则”）以及中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。



### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项。

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和基金投资。

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券和基金等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益。

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移

也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认。

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账。

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

#### (2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本。

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法确认债券投资成本。

卖出债券于成交日确认债券投资收益；卖出债券的成本按移动加权平均法结转。

#### (3) 基金投资

买入基金于成交日确认为基金投资，基金投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账。

卖出基金于成交日确认基金投资收益，卖出基金的成本按移动加权平均法于成交日结转。

#### (4) 回购协议

基金持有的回购协议(封闭式回购)，以成本列示，按实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)在实际持有期间内逐日计提利息。

### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体

具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的不同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

(1) 对于银行间市场交易的固定收益品种，以及交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），按照第三方估值机构提供的估值确定公允价值。

(2) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。对于发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行时股票公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按照监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

(3) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

(4) 当投资品种不再存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回

基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示。

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提。

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提。

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账。

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账。

(7) 基金投资收益/（损失）于卖出基金成交日确认，并按卖出基金成交金额与其成本的差额入账。

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账。

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 的年费率逐日计提；

- (2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率逐日计提；
- (3) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；
- (4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金份额持有人持有的基金份额（原份额）所获得的红利再投资份额的持有期，按原份额的持有期计算；

(2) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(3) 每一基金份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和基金投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于基金投资，根据中基协发[2017]3号《关于发布〈基金中基金估值业务指引(试行)〉的通知》之附件《基金中基金估值业务指引(试行)》的规定在估值日对非上市基金和上市基金进行估值。

(2) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》（中基协发[2017]6号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

(3) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(中国证监会公告[2017]13 号)及《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13 号)相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(4) 根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》(中基协发[2014]24 号)，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

## 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

本基金本报告期间无会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期间无会计估计变更。

### 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[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税; 2018 年 1 月 1 日起, 公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务, 以基金管理人为增值税纳税人, 暂适用简易计税方法, 按照 3%的征收率缴纳增值税。

2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不计缴企业所得税。

3) 对基金取得的股票股息、红利收入, 由上市公司代扣代缴个人所得税; 从公开发行和转让市场取得的上市公司股票, 持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的, 暂减按 50%计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

4) 对于基金从事 A 股买卖, 出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税, 对受让方不再缴纳印花税。

5) 基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	21,530,106.05
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	21,530,106.05

##### 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	141,059,898.49	146,259,562.85	5,199,664.36
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-

债券	交易所市场	1,535,723.61	1,625,784.18	90,060.57
	银行间市场	-	-	-
	合计	1,535,723.61	1,625,784.18	90,060.57
资产支持证券		-	-	-
基金		839,168,045.74	882,958,539.82	43,790,494.08
其他		-	-	-
合计		981,763,667.84	1,030,843,886.85	49,080,219.01

#### 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	2,114.89
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	145.90
应收债券利息	494.92
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	80.90
合计	2,836.61

#### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
其他应收款	14.10
待摊费用	-
合计	14.10



#### 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	13,551.99
银行间市场应付交易费用	275.00
合计	13,826.99

#### 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	23,803.31
预提信息披露费用	59,507.37
合计	83,310.68

#### 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	968,588,783.01	968,588,783.01
本期申购	20,136,178.59	20,136,178.59
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	988,724,961.60	988,724,961.60

#### 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	670,942.70	10,396,855.95	11,067,798.65
本期利润	13,551,811.50	38,683,363.06	52,235,174.56
本期基金份额交易产生的变动数	183,393.54	497,172.66	680,566.20
其中：基金申购款	183,393.54	497,172.66	680,566.20
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,406,147.74	49,577,391.67	63,983,539.41

#### 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	105,771.08
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	5,832.33
其他	1,510.41
合计	113,113.82

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	11,732,053.22
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	11,732,053.22

##### 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	34,981,195.53
减：卖出股票成本总额	23,249,142.31
买卖股票差价收入	11,732,053.22

##### 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 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	246,256,504.78
减：卖出/赎回基金成本总额	245,196,661.39

基金投资收益	1,059,843.39
--------	--------------

#### 6.4.7.14 债券投资收益

##### 6.4.7.14.1 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	-267,550.00
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	-267,550.00

##### 6.4.7.14.2 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	50,820,590.41
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	50,652,250.00
减：应收利息总额	435,890.41
买卖债券差价收入	-267,550.00

##### 6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

##### 6.4.7.14.5 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。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

##### 6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

注：贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

#### 6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

#### 6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

#### 6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

##### 6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：

本基金本报告期内未进行衍生工具买卖交易。

##### 6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：

本基金本报告期内未进行衍生工具买卖交易。

#### 6.4.7.17 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	1,053,171.49
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	4,097,989.97
合计	5,151,161.46

#### 6.4.7.18 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	38,683,363.06
股票投资	26,797.92
债券投资	68,516.25
资产支持证券投资	-
基金投资	38,588,048.89
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	38,683,363.06

#### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
销售服务费返还	830.76
合计	830.76

#### 6.4.7.20 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	90,666.46
银行间市场交易费用	550.00
交易基金产生的费用	340,077.29
其中：申购费	35,955.13
赎回费	294,048.49
交易费	10,073.67
合计	431,293.75

#### 6.4.7.20.1 持有基金产生的费用

项目	本期费用 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	246,766.68
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	2,962,263.43
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	593,995.95

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

#### 6.4.7.21 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	23,803.31
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	3,000.00
银行费用	7,215.00
合计	93,525.68

#### 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

本报告期内与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
兴证全球基金管理有限公司(简称“兴证全球基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司(简称“兴业银行”)	基金托管人、基金销售机构
兴业证券股份有限公司(简称“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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
兴业证券	48,715,541.87	100.00

#### 6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内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

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	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
兴业证券	50,000,000.00	100.00

#### 6.4.10.1.4 基金交易

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	
	成交金额	占当期基金 成交总额的比例（%）
兴业证券	324,965,560.03	100.00

#### 6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.6 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	33,939.87	100.00	13,551.99	100.00

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股份有限公司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，

还从兴业证券股份有限公司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
当期发生的基金应支付的管理费	3,440,526.33
其中：支付销售机构的客户维护费	1,490,526.59

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.8% 的年费率计提，但本基金投资于本基金管理人所管理的基金的部分不收取管理费。计算方法如下：每日应支付的基金管理费=前一日的基金资产净值×0.8%/当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	692,345.06

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15% 的年费率计提，但本基金投资于本基金托管人所托管的基金的部分不收取托管费。计算方法如下：每日应支付的基金托管费=前一日的基金资产净值×0.15%/当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：本基金本报告期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：本基金本报告期内未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	
	基金合同生效日（2020 年 12 月 16 日）持有的基金份额	30,005,600.53
报告期初持有的基金份额	30,005,600.53	
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	30,005,600.53	
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	3.0348%	

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

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

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未持有本基金。

#### 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	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行	21,530,106.05	105,771.08

##### 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：本基金本报告期末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

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本报告期末本基金持有基金管理人兴证全球基金管理有限公司所管理的基金合计 151,494,803.64 元，占本基金资产净值的比例为 14.39%。

## 6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

项目	本期费用
	2021年1月1日至2021年6月30日
当期交易基金产生的申购费（元）	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	22,992.49
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	830.76
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	638,136.91
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	126,058.95
-	-

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

## 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
000723	美锦能源	2021年1月28日	2021年08月04日	非公开发行流通受限	5.60	7.33	357,143	2,000,000.80	2,617,858.19	-
002139	拓邦股份	2021年6月1日	2021年12月3日	非公开发行流通受限	11.40	16.38	263,158	3,000,001.20	4,310,528.04	-
300460	惠伦晶体	2021年5月7日	2021年11月12日	非公开发行流通受限	12.37	21.94	161,681	1,999,993.97	3,547,281.14	-
300497	富祥药业	2021年1月19日	2021年7月21日	非公开发行流通受限	12.68	12.31	157,728	1,999,991.04	1,941,631.68	-
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							
300942	易瑞生物	2021年 2月2日	2021 年8月 9日	新股流 通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖智控	2021年 2月3日	2021 年8月 10日	新股流 通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300948	冠中生态	2021年 2月18 日	2021 年8月 25日	新股流 通受限	13.00	27.42	216	2,808.00	5,922.72	-
300948	冠中生态	2021年 6月4日	2021 年8月 25日	新股流 通受限 -转增	-	27.42	108	-	2,961.36	1
300950	德固特	2021年 2月24 日	2021 年9月 3日	新股流 通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300952	恒辉安防	2021年 3月3日	2021 年9月 13日	新股流 通受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
300953	震裕科技	2021年 3月11 日	2021 年9月 22日	新股流 通受限	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300955	嘉亨家化	2021年 3月16 日	2021 年9月 24日	新股流 通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300956	英力股份	2021年 3月16 日	2021 年9月 27日	新股流 通受限	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300957	贝泰妮	2021年 3月18 日	2021 年9月 27日	新股流 通受限	47.33	251.96	558	26,410.14	140,593.68	-
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	新股流 通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-

			日							
300966	共同药业	2021年3月31日	2021年10月11日	新股流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300967	晓鸣股份	2021年4月2日	2021年10月13日	新股流通受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300968	格林精密	2021年4月6日	2021年10月15日	新股流通受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300971	博亚精工	2021年4月7日	2021年10月15日	新股流通受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300972	万辰生物	2021年4月8日	2021年10月19日	新股流通受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300973	立高食品	2021年4月8日	2021年10月15日	新股流通受限	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月21日	新股流通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	新股流通受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300985	致远新能	2021年4月21日	2021年10月29日	新股流通受限	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月1日	新股流通受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021年4月28日	2021年11月11日	新股流通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-

300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	新股流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300992	泰福泵业	2021年5月17日	2021年11月25日	新股流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300993	玉马遮阳	2021年5月17日	2021年11月24日	新股流通受限	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300995	奇德新材	2021年5月17日	2021年11月26日	新股流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联软件	2021年5月26日	2021年12月3日	新股流通受限	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300997	欢乐家	2021年5月26日	2021年12月2日	新股流通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月2日	新股流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	新股流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301004	嘉益股份	2021年6月18日	2021年12月27日	新股流通受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
301007	德迈仕	2021年6月4日	2021年12月16日	新股流通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301010	晶雪节能	2021年6月9日	2021年12月20日	新股流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301011	华立科技	2021年6月9日	2021年12月17日	新股流通受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-

301012	扬电科技	2021年6月15日	2021年12月22日	新股流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	新股流通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月30日	新股流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
301017	漱玉平民	2021年6月23日	2021年7月5日	新股流通受限	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
301017	漱玉平民	2021年6月23日	2022年1月5日	新股流通受限	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-
301020	密封科技	2021年6月28日	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	-
600059	古越龙山	2021年4月28日	2021年10月26日	非公开发行流通受限	9.31	12.15	214,822	1,999,992.82	2,610,087.30	-
600584	长电科技	2021年4月29日	2021年10月26日	非公开发行流通受限	28.30	35.44	70,671	1,999,989.30	2,504,580.24	-
603703	盛洋科技	2021年1月5日	2021年7月1日	非公开发行流通受限	9.61	12.70	208,116	1,999,994.76	2,643,073.20	-
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	-

688067	爱威科技	2021年6月7日	2021年12月16日	新股流通受限	14.71	24.83	1,259	18,519.89	31,260.97	-
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	-
688191	智洋创新	2021年3月30日	2021年10月8日	新股流通受限	11.38	17.74	3,203	36,450.14	56,821.22	-
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	-
688260	昀冢科技	2021年3月25日	2021年10月8日	新股流通受限	9.63	16.41	2,990	28,793.70	49,065.90	-
688323	瑞华泰	2021年4月21日	2021年10月28日	新股流通受限	5.97	22.78	4,513	26,942.61	102,806.14	-
688329	艾隆科技	2021年3月16日	2021年9月29日	新股流通受限	16.81	50.04	1,846	31,031.26	92,373.84	-
688367	工大高科	2021年6月21日	2021年12月28日	新股流通受限	11.53	17.94	1,717	19,797.01	30,802.98	-
688661	和林微纳	2021年3月19日	2021年9月29日	新股流通受限	17.71	84.01	1,452	25,714.92	121,982.52	-
688663	新风光	2021年4月6日	2021年10月13日	新股流通受限	14.48	19.21	3,279	47,479.92	62,989.59	-
688696	极米科技	2021年2月23日	2021年9月3日	新股流通受限	133.73	780.24	1,252	167,429.96	976,860.48	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113050	南银转债	2021年6月17日	2021年7月1日	新债未上市	100.00	100.00	2,700	270,000.00	270,000.00	-

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。

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：本基金本报告期末未持有临时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参加因转融通证券业务而出借的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、风险管理部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（不含证券投资基金）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（不含证券投资基金），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	1,076,844.30	-
AAA 以下	548,939.88	570,267.93
未评级	-	-
合计	1,625,784.18	570,267.93

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在开放赎回日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，除在附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购

金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等；持有的利率敏感性负债主要是卖出回购金融资产款。

##### 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	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
------------------	-------	-------	--------	------	------	-----	----

日							
资产							
银行存款	21,530,106.05	-	-	-	-	-	21,530,106.05
结算备付金	324,170.99	-	-	-	-	-	324,170.99
存出保证金	179,818.01	-	-	-	-	-	179,818.01
交易性金融资产	-	-	-	548,939.88	1,076,844.30	1,029,218,102.67	1,030,843,886.85
应收利息	-	-	-	-	-	2,836.61	2,836.61
应收股利	-	-	-	-	-	88.51	88.51
应收申购款	9,163.23	-	-	-	-	26,431.51	35,594.74
应收证券清算款	-	-	-	-	-	594,002.83	594,002.83
其他资产	-	-	-	-	-	14.10	14.10
资产总计	22,043,258.28	-	-	548,939.88	1,076,844.30	1,029,841,476.23	1,053,510,518.69
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	586,938.63	586,938.63
应付托管费	-	-	-	-	-	117,921.67	117,921.67
应付交易费用	-	-	-	-	-	13,826.99	13,826.99
应交税费	-	-	-	-	-	19.71	19.71
其他负债	-	-	-	-	-	83,310.68	83,310.68
负债总计	-	-	-	-	-	802,017.68	802,017.68
利率敏感度缺口	22,043,258.28	-	-	548,939.88	1,076,844.30	1,029,039,458.55	1,052,708,501.01
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	169,455,198.83	-	-	-	-	-	169,455,198.83
交易性金融资产	-	-	-	-	570,267.93	803,023,967.03	803,594,234.96
应收利息	-	-	-	-	-	37,671.20	37,671.20
应收股利	-	-	-	-	-	1,032,565.90	1,032,565.90
应收证券清算款	-	-	-	-	-	5,999,986.60	5,999,986.60
其他资产	-	-	-	-	-	142.09	142.09
资产总计	169,455,198.83	-	-	-	570,267.93	810,094,332.82	980,119,799.58

负债							
应付管理人报酬		-	-	-	-	302,308.85	302,308.85
应付托管费		-	-	-	-	56,583.46	56,583.46
应付交易费用		-	-	-	-	94,325.31	94,325.31
应交税费		-	-	-	-	0.30	0.30
其他负债		-	-	-	-	10,000.00	10,000.00
负债总计		-	-	-	-	463,217.92	463,217.92
利率敏感度缺口	169,455,198.83					570,267.93	809,631,14.90
							979,656,581.66

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

注：无。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金投资于经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金的资产比例不低于基金资产的 80%，其中，本基金投资于权益类资产（股票、股票型基金、混合型基金）的战略配置目标比例中枢为 70%，投资比例范围为基金资产的 60%-75%。本基金应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	146,259,562.85	13.89	134,669,208.14	13.75
交易性金融资产—基金投资	882,958,539.82	83.87	668,354,758.89	68.22
交易性金融资产—债券投资	1,625,784.18	0.15	570,267.93	0.06
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	1,030,843,886.85	97.92	803,594,234.96	82.03

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假设单个证券的公允价值和市场组合的公允价值依照资本-资产定价模型(CAPM)描述的规律进行变动		
	使用本基金业绩比较基准所对应的市场组合进行分析		
	在业绩基准变化10%时，对单个证券相应的公允价值变化进行加总得到基金净值的变化		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	业绩比较基准+10%	71,351,102.62	34,013,579.24
	业绩比较基准-10%	-71,351,102.62	-34,013,579.24

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	146,259,562.85	13.88
	其中：股票	146,259,562.85	13.88
2	基金投资	882,958,539.82	83.81
3	固定收益投资	1,625,784.18	0.15
	其中：债券	1,625,784.18	0.15
	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	21,854,277.04	2.07
8	其他各项资产	812,354.80	0.08
9	合计	1,053,510,518.69	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	11,290.28	0.00
B	采矿业	3,179,817.00	0.30
C	制造业	91,861,398.27	8.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,214,166.00	0.12
E	建筑业	1,004,719.44	0.10
F	批发和零售业	754,553.22	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	1,036,490.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,687,346.26	0.73
J	金融业	22,314,214.10	2.12
K	房地产业	8,852,206.00	0.84
L	租赁和商务服务业	1,848,124.00	0.18
M	科学研究和技术服务业	1,634,799.60	0.16
N	水利、环境和公共设施管理业	39,030.68	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	845,408.00	0.08
R	文化、体育和娱乐业	3,976,000.00	0.38
S	综合	-	-
	合计	146,259,562.85	13.89

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	111,300	7,154,364.00	0.68
2	002415	海康威视	102,625	6,619,312.50	0.63
3	600036	招商银行	86,900	4,709,111.00	0.45
4	002139	拓邦股份	263,158	4,310,528.04	0.41
5	000002	万科A	163,000	3,881,030.00	0.37
6	300460	惠伦晶体	161,681	3,547,281.14	0.34
7	601658	邮储银行	683,700	3,432,174.00	0.33
8	002050	三花智控	134,300	3,220,514.00	0.31
9	601128	常熟银行	468,000	2,901,600.00	0.28
10	300760	迈瑞医疗	6,000	2,880,300.00	0.27
11	002920	德赛西威	25,600	2,818,048.00	0.27
12	600309	万华化学	25,300	2,753,146.00	0.26
13	002475	立讯精密	58,900	2,709,400.00	0.26
14	600690	海尔智家	102,700	2,660,957.00	0.25
15	601601	中国太保	91,800	2,659,446.00	0.25
16	603703	盛洋科技	208,116	2,643,073.20	0.25
17	600048	保利地产	219,400	2,641,576.00	0.25
18	000723	美锦能源	357,143	2,617,858.19	0.25
19	600059	古越龙山	214,822	2,610,087.30	0.25
20	601012	隆基股份	29,260	2,599,458.40	0.25
21	002444	巨星科技	75,200	2,562,816.00	0.24
22	600584	长电科技	70,671	2,504,580.24	0.24
23	002841	视源股份	20,000	2,485,800.00	0.24
24	300454	深信服	9,000	2,335,320.00	0.22
25	600383	金地集团	227,500	2,329,600.00	0.22
26	600426	华鲁恒升	71,549	2,214,441.55	0.21
27	002851	麦格米特	69,700	2,176,731.00	0.21
28	300144	宋城演艺	120,700	2,027,760.00	0.19
29	601799	星宇股份	8,900	2,008,908.00	0.19

30	002001	新 和 成	68,520	1,965,153.60	0.19
31	002311	海大集团	24,000	1,958,400.00	0.19
32	300413	芒果超媒	28,400	1,948,240.00	0.19
33	300497	富祥药业	157,728	1,941,631.68	0.18
34	603816	顾家家居	24,200	1,870,176.00	0.18
35	002027	分众传媒	196,400	1,848,124.00	0.18
36	688099	晶晨股份	16,407	1,840,865.40	0.17
37	601899	紫金矿业	183,000	1,773,270.00	0.17
38	002007	华兰生物	46,500	1,705,620.00	0.16
39	603259	药明康德	10,440	1,634,799.60	0.16
40	600741	华域汽车	62,100	1,631,367.00	0.15
41	000333	美的集团	22,500	1,605,825.00	0.15
42	002429	兆驰股份	261,000	1,584,270.00	0.15
43	002600	领益智造	167,800	1,542,082.00	0.15
44	600887	伊利股份	40,100	1,476,883.00	0.14
45	603369	今世缘	27,100	1,467,736.00	0.14
46	600031	三一重工	49,800	1,447,686.00	0.14
47	002938	鹏鼎控股	40,300	1,445,964.00	0.14
48	000001	平安银行	62,900	1,422,798.00	0.14
49	300271	华宇软件	73,600	1,416,800.00	0.13
50	601168	西部矿业	117,900	1,406,547.00	0.13
51	000651	格力电器	26,900	1,401,490.00	0.13
52	002555	三七互娱	52,300	1,256,246.00	0.12
53	600900	长江电力	58,600	1,209,504.00	0.11
54	002138	顺络电子	30,700	1,190,239.00	0.11
55	600754	锦江酒店	18,200	1,036,490.00	0.10
56	000768	中航西飞	39,300	1,032,804.00	0.10
57	300699	光威复材	13,500	1,025,325.00	0.10
58	000938	紫光股份	46,080	1,008,230.40	0.10
59	601668	中国建筑	213,700	993,705.00	0.09
60	603707	健友股份	23,400	976,950.00	0.09
61	688696	极米科技	1,252	976,860.48	0.09
62	000538	云南白药	8,300	960,476.00	0.09
63	688233	神工股份	16,882	911,628.00	0.09
64	600276	恒瑞医药	13,200	897,204.00	0.09
65	002044	美年健康	92,800	845,408.00	0.08
66	002398	垒知集团	118,401	844,199.13	0.08
67	000895	双汇发展	24,900	791,820.00	0.08
68	600521	华海药业	36,500	762,120.00	0.07
69	600050	中国联通	173,800	750,816.00	0.07
70	603368	柳药股份	34,500	681,030.00	0.06
71	688690	纳微科技	3,477	408,547.50	0.04



72	300957	贝泰妮	558	140,593.68	0.01
73	688661	和林微纳	1,452	121,982.52	0.01
74	688323	瑞华泰	4,513	102,806.14	0.01
75	688329	艾隆科技	1,846	92,373.84	0.01
76	688663	新风光	3,279	62,989.59	0.01
77	688191	智洋创新	3,203	56,821.22	0.01
78	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
79	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
80	688260	昀冢科技	2,990	49,065.90	0.00
81	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
82	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
83	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
84	688067	爱威科技	1,259	31,260.97	0.00
85	688367	工大高科	1,717	30,802.98	0.00
86	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
87	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
88	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
89	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
90	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
91	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
92	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
93	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
94	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
95	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
96	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
97	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
98	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
99	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
100	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
101	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
102	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
103	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
104	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
105	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
106	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
107	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
108	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
109	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
110	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
111	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
112	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
113	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00

114	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
115	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
116	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
117	300991	创益通	254	6,733.54	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	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
121	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
122	300972	万辰生物	430	5,439.50	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

## 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	601318	中国平安	5,564,335.00	0.57
2	002139	拓邦股份	3,000,001.20	0.31
3	000723	美锦能源	2,000,000.80	0.20
4	603703	盛洋科技	1,999,994.76	0.20
5	300460	惠伦晶体	1,999,993.97	0.20
6	600059	古越龙山	1,999,992.82	0.20
7	300497	富祥药业	1,999,991.04	0.20
8	600584	长电科技	1,999,989.30	0.20
9	600690	海尔智家	1,792,371.00	0.18
10	000001	平安银行	1,299,775.00	0.13
11	601601	中国太保	1,093,582.00	0.11
12	002138	顺络电子	996,200.00	0.10
13	603707	健友股份	993,965.00	0.10
14	688233	神工股份	499,848.34	0.05
15	601168	西部矿业	499,290.00	0.05
16	002600	领益智造	498,160.00	0.05
17	000002	万科 A	496,820.00	0.05
18	688425	铁建重工	302,621.41	0.03
19	688083	中望软件	276,468.50	0.03
20	300957	贝泰妮	264,006.74	0.03

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	000858	五粮液	3,338,963.00	0.34
2	600519	贵州茅台	2,930,210.00	0.30
3	601012	隆基股份	2,414,399.74	0.25
4	600009	上海机场	1,907,505.00	0.19
5	300015	爱尔眼科	1,836,226.74	0.19
6	601995	中金公司	1,633,567.00	0.17
7	300999	金龙鱼	1,508,070.00	0.15
8	600031	三一重工	1,255,268.00	0.13
9	603288	海天味业	971,850.00	0.10
10	300957	贝泰妮	832,451.00	0.08
11	688083	中望软件	772,986.74	0.08
12	603259	药明康德	661,530.00	0.07
13	002773	康弘药业	626,676.00	0.06
14	688131	皓元医药	624,138.00	0.06
15	688425	铁建重工	553,692.94	0.06
16	688660	电气风电	494,237.66	0.05
17	688276	百克生物	414,843.60	0.04
18	688076	诺泰生物	385,050.42	0.04
19	688687	凯因科技	373,854.10	0.04
20	688161	威高骨科	349,559.10	0.04

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	34,812,699.10
卖出股票收入（成交）总额	34,981,195.53

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）	1,625,784.18	0.15
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,625,784.18	0.15

## 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	110079	杭银转债	5,660	644,504.20	0.06
2	127017	万青转债	4,903	548,939.88	0.05
3	113050	南银转债	2,700	270,000.00	0.03
4	123107	温氏转债	1,510	162,340.10	0.02

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：股指期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

## 7.12 本报告期投资基金情况

### 7.12.1 投资政策及风险说明

作为一只服务于投资者养老需求的基金，本基金定位为积极型的目标风险策略基金，根据特定的风险偏好设定权益类和固定收益类资产的比例，以获取养老资金的长期稳健增值。

本基金为养老目标基金，致力于满足投资者的养老资金理财需求，但养老目标基金并不代表收益保障或其他任何形式的收益承诺，存在投资者承担亏损的可能性。本基金为基金中基金，在控制风险的基础上，主要通过成熟稳健的资产配置策略和公募基金精选策略进行投资。因此各类资产股票市场、债券市场等的变化将影响到本基金业绩表现。本基金管理人将发挥投资和研究优势，持续优化组合配置，以控制特定风险。本基金定位为积极型目标风险策略基金，投资于权益类资产（股票、股票型基金、混合型基金）的战略配置目标比例中枢为 70%，投资比例范围为基金资产的 60%-75%。因此，相比平衡型和稳健型的目标风险策略基金，本基金的预期收益和预期风险水平可能更高，运作过程中基金净值的波动也可能更剧烈。

### 7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	003949	兴全稳泰债券 A	契约型开放式	38,321,517.53	41,011,688.06	3.90	是
2	004933	招商丰拓灵活混合 C	契约型开放式	20,531,070.35	32,673,145.35	3.10	否
3	163417	兴全合宜混合 A	上市契约型开放式 (LOF)	15,502,822.00	32,241,218.91	3.06	是
4	003344	鹏华弘惠混合 C	契约型开放式	26,216,997.24	32,160,390.51	3.06	否
5	005141	华夏睿磐泰荣混合	契约型开	24,966,711.05	32,074,733.69	3.05	否

		C	放式				
6	110037	易方达纯 债债券 A	契约 型开 放式	27,722,767.36	30,661,380.70	2.91	否
7	040040	华安纯债 债券 A	契约 型开 放式	28,437,104.36	30,592,636.87	2.91	否
8	000186	华泰柏瑞 季季红债 券	契约 型开 放式	28,915,662.65	30,477,108.43	2.90	否
9	163402	兴全趋势 投资混合 (LOF)	上市 契约 型开 放式 (LOF)	30,056,721.00	30,008,630.25	2.85	是
10	163415	兴全商业 模式混合 (LOF)	上市 契约 型开 放式 (LOF)	7,264,820.00	28,725,098.28	2.73	是
11	000628	大成高新 技术产业 股票 A	契约 型开 放式	7,871,811.59	25,874,644.70	2.46	否
12	169101	东方红睿 丰混合 (LOF)	上市 契约 型开 放式 (LOF)	9,340,511.16	22,678,761.10	2.15	否
13	000082	嘉实研究 阿尔法股 票	契约 型开 放式	10,229,667.51	21,789,191.80	2.07	否
14	000011	华夏大盘 精选混合 A/B	契约 型开 放式	1,053,857.51	21,556,655.37	2.05	否
15	161131	易方达科 润混合	上市 契约	18,399,200.00	21,453,467.20	2.04	否

		(LOF)	型开 放式 (LOF)				
16	510900	易方达恒 生中国企 业 ETF(QDII)	交易 型开 放式 (ETF)	18,509,500.00	21,396,982.00	2.03	否
17	002088	国富新机 遇混合 C	契约 型开 放式	13,745,704.47	21,319,587.63	2.03	否
18	002262	中银宝利 混合 C	契约 型开 放式	18,450,184.50	20,922,509.22	1.99	否
19	166001	中欧新趋 势混合 (LOF)A	上市 契约 型开 放式 (LOF)	11,841,271.63	20,893,923.79	1.98	否
20	000251	工银金融 地产混合 A	契约 型开 放式	7,870,523.42	20,849,016.54	1.98	否
21	450009	国富中小 盘股票	契约 型开 放式	7,366,278.30	20,809,736.20	1.98	否
22	000305	中银中高 等级债券 A	契约 型开 放式	19,301,940.88	20,460,057.33	1.94	否
23	006551	中庚价值 领航混合	契约 型开 放式	11,151,036.46	20,260,318.14	1.92	否
24	168103	九泰锐益	上市 契约 型开 放式 (LOF)	9,899,818.00	20,027,331.81	1.90	否
25	160142	优势产业	上市	16,646,735.00	19,393,446.28	1.84	否

			契约 型开 放式 (LOF)				
26	000124	华宝服务 优选混合	契约 型开 放式	3,596,341.94	15,021,920.28	1.43	否
27	512800	华宝中证 银行 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	11,243,900.00	13,829,997.00	1.31	否
28	519773	交银数据 产业灵活 配置混合	契约 型开 放式	6,101,469.86	13,752,713.06	1.31	否
29	159920	恒生 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	8,728,700.00	13,136,693.50	1.25	否
30	515080	招商中证 红利 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	8,647,400.00	12,262,013.20	1.16	否
31	000020	景顺长城 品质投资 混合	契约 型开 放式	2,703,893.99	11,832,240.10	1.12	否
32	100032	富国中证 红利指数 增强 A	契约 型开 放式	9,919,941.07	11,467,451.88	1.09	否
33	002808	泓德优势 领航混合	契约 型开 放式	4,745,159.45	10,882,548.68	1.03	否
34	166009	中欧新动 力混合 (LOF) A	上市 契约 型开 放式 (LOF)	2,938,203.40	10,421,513.64	0.99	否



35	000191	富国信用 债债券 A	契约 型开 放式	8,974,957.36	10,300,558.56	0.98	否
36	100058	富国产业 债债券 A	契约 型开 放式	8,954,061.07	10,280,157.51	0.98	否
37	004042	华夏鼎茂 债券 A	契约 型开 放式	8,839,285.71	10,260,642.85	0.97	否
38	002169	永赢稳益 债券	契约 型开 放式	9,570,198.11	10,257,338.33	0.97	否
39	163412	兴全轻资 产混合 (LOF)	上市 契约 型开 放式 (LOF)	2,518,711.00	9,709,630.91	0.92	是
40	118001	易方达亚 洲精选股 票(QDII)	契约 型开 放式	7,086,463.50	9,531,293.41	0.91	否
41	166019	中欧价值 智选混合 A	契约 型开 放式	1,790,117.14	8,752,777.76	0.83	否
42	510050	华夏上证 50ETF	交易 型开 放式 (ETF)	1,725,700.00	6,065,835.50	0.58	否
43	511880	银华交易 型货币 A	交易 型开 放式 (ETF)	58,400.00	5,909,612.80	0.56	否
44	006179	富国品质 生活混合 A	契约 型开 放式	2,312,745.78	5,352,156.28	0.51	否
45	168105	九泰泰富	上市 契约	2,483,600.00	5,153,470.00	0.49	否

			型开 放式 (LOF)				
46	160627	鹏华策略 优选混合	契约 型开 放式	1,685,434.93	5,042,821.31	0.48	否
47	161728	招商瑞智 优选混合 (LOF)	上市 契约 型开 放式 (LOF)	3,880,122.00	4,527,714.36	0.43	否
48	163409	兴全绿色	上市 契约 型开 放式 (LOF)	1,984,228.00	4,490,307.96	0.43	是
49	510100	易方达上 证 50ETF	交易 型开 放式 (ETF)	2,670,600.00	3,698,781.00	0.35	否
50	510880	华泰柏瑞 上证红利 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	1,153,900.00	3,290,922.80	0.31	否
51	511990	华宝添益 货币 A	交易 型开 放式 (ETF)	30,813.00	3,081,084.31	0.29	否
52	501025	鹏华香港 银行指数 (LOF)A	上市 契约 型开 放式 (LOF)	3,070,600.00	3,027,611.60	0.29	否
53	163409	兴全绿色 投资混合 (LOF)	上市 契约 型开 放式	972,860.00	2,207,419.34	0.21	是

			(LOF)				
54	163407	兴全沪深 300 指数 (LOF)A	上市 契约 型开 放式 (LOF)	762,243.00	2,034,274.12	0.19	是
55	160726	嘉实瑞享	上市 契约 型开 放式 (LOF)	1,298,747.00	1,679,279.87	0.16	否
56	161912	社会责任	上市 契约 型开 放式 (LOF)	807,735.00	1,514,503.13	0.14	否
57	169102	东证睿阳	上市 契约 型开 放式 (LOF)	349,100.00	750,565.00	0.07	否
58	501081	中欧科创 主题 3 年 封闭运作 灵活配置 混合	上市 契约 型开 放式 (LOF)	273,209.00	501,884.93	0.05	否
59	163415	兴全模式	上市 契约 型开 放式 (LOF)	128,800.00	500,903.20	0.05	是
60	163402	兴全趋势	上市 契约 型开 放式 (LOF)	502,000.00	496,478.00	0.05	是

61	501186	华夏兴融混合(LOF)	上市契约型开放式(LOF)	343,331.00	374,574.12	0.04	否
62	501076	鹏华科创3年封闭混合	上市契约型开放式(LOF)	230,227.00	366,060.93	0.03	否
63	501071	泓德三年封闭丰泽混合	契约型开放式	179,500.00	299,406.00	0.03	否
64	501046	财通福鑫定开混合发起	上市契约型开放式(LOF)	108,200.00	250,591.20	0.02	否
65	160526	博时优势	上市契约型开放式(LOF)	110,857.00	150,765.52	0.01	否
66	169106	东证创优	上市契约型开放式(LOF)	111,100.00	111,211.10	0.01	否
67	340005	兴全货币A	契约型开放式	69,154.61	69,154.61	0.01	是

### 7.13 投资组合报告附注

#### 7.13.1 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本期未出现被监管部门立案调查，并且未在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 7.13.2 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。

### 7.13.3 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	179,818.01
2	应收证券清算款	594,002.83
3	应收股利	88.51
4	应收利息	2,836.61
5	应收申购款	35,594.74
6	其他应收款	14.10
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	812,354.80

### 7.13.4 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	127017	万青转债	548,939.88	0.05

### 7.13.5 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	002139	拓邦股份	4,310,528.04	0.41	非公开流通受限
2	300460	惠伦晶体	3,547,281.14	0.34	非公开流通受限

### 7.13.6 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 (%)

61,885	15,976.81	32,371,297.04	3.27	956,353,664.56	96.73
--------	-----------	---------------	------	----------------	-------

## 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	5,627,340.96	0.5692

## 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	>100

注：本基金的基金经理也是本公司 FOF 投资部门负责人，故上述两点统计数据有重合部分。

## 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额 占基金总 份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占 基金总份 额比例(%)	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有资 金	30,005,600.53	3.03	30,005,600.53	3.03	3 年
基金管理人高级管 理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	30,005,600.53	3.03	30,005,600.53	3.03	-

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020 年 12 月 16 日） 基金份额总额	968,588,783.01
本报告期期初基金份额总额	968,588,783.01
本报告期基金总申购份额	20,136,178.59
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	988,724,961.60

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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

### 10.6 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。

### 10.7 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。

### 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.8.1 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	3	48,715,541.87	100.00%	33,939.87	100.00%	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-

招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中国中金财 富证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力、客户服务质量的基础上，选择基金专用交易席位。

### 10.8.2 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
兴业证券	-	-	50,000,000.00	100.00%	-	-	324,965,560.03	100.00%
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国中金财富 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 10.9 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盛洋科技(603703)非公开发行股票的公告	中国证券报、指定互联网网站	2021-01-07
2	关于增加北京汇成基金销售有限公司	中国证券报、指定互联	2021-01-14



	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	网网站	
3	关于旗下部分基金投资富祥药业(300497)非公开发行股票的公告	中国证券报、指定互联网网站	2021-01-21
4	关于旗下部分基金投资美锦能源(000723)非公开发行股票的公告	中国证券报、指定互联网网站	2021-02-01
5	关于旗下部分基金投资范围增加存托凭证并修改基金合同和托管协议的公告	中国证券报、指定互联网网站	2021-02-09
6	关于增加中原证券为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、指定互联网网站	2021-03-05
7	关于兴全安泰积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）开放日常申购、定期定额投资业务的公告	中国证券报、指定互联网网站	2021-03-10
8	关于兴全安泰积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）参加部分销售机构申购、定投费率优惠活动的公告	中国证券报、指定互联网网站	2021-03-11
9	关于旗下部分基金投资古越龙山(600059)非公开发行股票的公告	中国证券报、指定互联网网站	2021-04-30
10	关于旗下部分基金投资长电科技(600584)非公开发行股票的公告	中国证券报、指定互联网网站	2021-05-06
11	关于旗下部分基金投资惠伦晶体(300460)非公开发行股票的公告	中国证券报、指定互联网网站	2021-05-11
12	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	中国证券报、指定互联网网站	2021-05-17
13	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、指定互联网网站	2021-05-19
14	关于增加陆金所为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、指定互联网网站	2021-06-01
15	关于旗下部分基金投资拓邦股份(002139)非公开发行股票的公告	中国证券报、指定互联网网站	2021-06-03
16	关于增加北京新浪仓石基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、指定互联网网站	2021-06-16
17	关于增加泛华普益基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、指定互联网网站	2021-06-17
18	关于调整网上直销基金转换、赎回申购、汇款交易优惠费率的公告	中国证券报、指定互联网网站	2021-06-18

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况,故不涉及本项特有风险。							

注：1、“申购金额”包含份额申购、转换转入、分红再投资等导致投资者持有份额增加的情形。

2、“赎回份额”包含份额赎回、转换转出等导致投资者持有份额减少的情形。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金每份基金份额的最短持有期为 5 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 5 年内无法赎回的风险。

本基金为养老目标基金，“养老”名称不代表收益保障或任何形式的收益承诺。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1、中国证监会关于准予兴全安泰积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）注册的批复文件

2、《兴全安泰积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》

3、《兴全安泰积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）托管协议》

4、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、中国证监会规定的其它文件

## 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