

# 兴全合兴两年封闭运作混合型证券投资基金（LOF） 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：兴证全球基金管理有限公司

基金托管人：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 12 日（基金合同生效日）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	6
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	7
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	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	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
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>11</b>
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
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45

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 .....	45
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	45
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	45
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	46
7.12 投资组合报告附注 .....	46
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>47</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	47
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	47
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	47
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>48</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>48</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	48
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	48
10.4 基金投资策略的改变 .....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	48
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	48
10.8 其他重大事件 .....	50
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>50</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 .....	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	51
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>51</b>
12.1 备查文件目录 .....	51
12.2 存放地点 .....	51
12.3 查阅方式 .....	51

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	兴全合兴两年封闭运作混合型证券投资基金（LOF）
基金简称	兴全合兴两年封闭运作混合 LOF
场内简称	兴全合兴
基金主代码	163418
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2021 年 1 月 12 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	7,920,027,850.64 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2021 年 4 月 15 日

注：本基金基金合同生效后，前两年封闭运作，在封闭期内不开放申购、赎回业务，但投资人可在本基金上市交易后通过深圳证券交易所转让基金份额。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制投资组合风险的前提下，通过深入的基本面研究挖掘具有较好盈利能力和市场竞争力的公司，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	沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×20%+中债综合（全价）指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，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。本基金除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、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	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨卫东	龚小武
	联系电话	021-20398888	021-52629999-212056
	电子邮箱	yangwd@xqfunds.com	gongxiaowu@cib.com.cn
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	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.xqfunds.com">http://www.xqfunds.com</a>
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	A 类份额：中国证券登记结算有限责任公司 C 类份额：兴证全球基金管理有限责任公司	A 类份额：北京市西城区太平桥大街 17 号 C 类份额：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 12 日(基金合同生效日) - 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-406,604,741.82
本期利润	434,033,409.23
加权平均基金份额本期利润	0.0548
本期加权平均净值利润率	5.61%
本期基金份额净值增长率	5.48%
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	-406,604,737.87
期末可供分配基金份额利润	-0.0513
期末基金资产净值	8,354,061,262.30
期末基金份额净值	1.0548
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	5.48%

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。

4、本基金合同于 2021 年 1 月 12 日生效，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

### 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	4.12%	1.10%	-1.15%	0.58%	5.27%	0.52%
过去三个月	14.00%	1.02%	2.24%	0.70%	11.76%	0.32%
自基金合同生效起至今	5.48%	1.18%	-1.52%	0.95%	7.00%	0.23%

注：1、本基金业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×20%+中债综合（全价）指数收益率×20%。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，按下列公式计算：

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

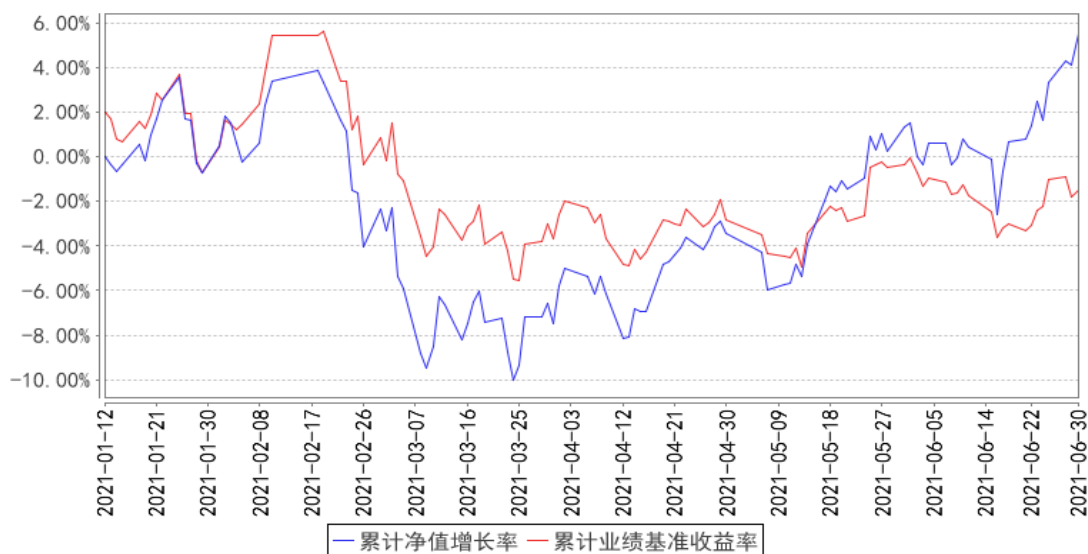
$$\text{Benchmark}_t = (1 + \text{Return}_t) \times (1 + \text{Benchmark}_{t-1}) - 1$$

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

2、本基金成立于 2021 年 01 月 12 日，截至 2021 年 06 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

兴全合兴两年封闭运作混合LOF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、净值表现所取数据截至到 2021 年 06 月 30 日。

2、按照《兴全合兴两年封闭运作混合型证券投资基金（LOF）基金合同》的规定，本基金建仓期为 2021 年 1 月 12 日起共计六个月，在该期间届满后达到本基金合同约定的比例限制及投资组合的比例范围。目前本基金还在建仓期内。

3、本基金成立于 2021 年 01 月 12 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		
陈宇	兴全精选混合型证券投资基金、兴全合兴两年封闭运作混合型证券投资基金基金经理（LOF）基金经理	2021 年 1 月 12 日	-	14 年	硕士，历任兴业证券研究员，兴证全球基金管理有限公司研究员、专户投资部投资经理、兴全可转债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、《兴全合兴两年封闭运作混合型证券投资基金（LOF）基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，确保各投资组合之间得到公平对待，保护投资者的合法权益。公司风险管理

部对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异进行统计，从不同的角度分析差异的来源、考察是否存在不公平的因素。

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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 年上半年经济走在疫情后复苏的路上，中美的货币环境都比较宽松，大宗商品和房地产销售都呈现向好的势头，加上中国 2021 年春节的就地过年政策，上半年的经济数据较好，市场在春节后的短暂下滑后很快反弹，整个上半年收涨，特别是传统经济产业链，企业盈利有较大反弹。各国疫苗加速推进，但德尔塔疫情又起，对全球的疫情重建带来一些扰动，给个别行业的供给造成困扰。

本基金已经完成建仓，主要配置了新能源车、半导体、医疗服务、军工、汽车智能化等正在快速渗透的行业。在港股市场配置了互联网行业。

#### 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 1.0548 元；本报告期基金份额净值增长率为 14.00%，业绩比较基准收益率为 2.24%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，已经发布的 6-7 月数据显示经济有所降温，财政加大投入的可能性增大，同时中美两国的抗疫宽松政策可能逐步退出。宏观数据有从高位环比走弱的可能，但细分行业的新需求仍然存在，本基金将尽量在风险可控的前提下，寻找高增长的机会。

#### 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》、《兴全合兴两年封闭运作混合型证券投资基金（LOF）基金合同》及其他相关法律法规的规定，本报告期内，本基金未实施利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

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

本基金本报告期内未发生需披露的基金份额持有人数不满两百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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：兴全合兴两年封闭运作混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	161,963,633.61
结算备付金		12,771,436.35
存出保证金		3,148,143.95
交易性金融资产	6.4.7.2	8,072,516,930.12
其中：股票投资		7,519,033,630.12
基金投资		-
债券投资		553,483,300.00
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		124,267,879.97
应收利息	6.4.7.5	2,692,138.93
应收股利		290,841.60
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		8,377,651,004.53
<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>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		5,480,045.62
应付赎回款		3.20
应付管理人报酬		9,862,565.64
应付托管费		1,643,760.94
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	6,516,908.41
应交税费		18.52
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	86,439.90
负债合计		23,589,742.23
<b>所有者权益：</b>		

实收基金	6.4.7.9	7,920,027,850.64
未分配利润	6.4.7.10	434,033,411.66
所有者权益合计		8,354,061,262.30
负债和所有者权益总计		8,377,651,004.53

注：本基金合同生效日为2021年01月12日，本报告期自基金合同生效日2021年01月12日起至2021年06月30日止。报告截止日2021年06月30日，基金份额净值1.0548元，基金份额总额7,920,027,850.64份。

## 6.2 利润表

会计主体：兴全合兴两年封闭运作混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2021年1月12日（基金合同生效日）至2021年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2021年1月12日（基金合同生效日）至2021年6月30日
一、收入		519,213,950.74
1. 利息收入		12,713,764.07
其中：存款利息收入	6.4.7.11	4,312,752.21
债券利息收入		389,712.71
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		8,011,299.15
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-334,137,964.38
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-349,801,402.85
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	2,540,842.05
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	13,122,596.42
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	840,638,151.05
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		85,180,541.51
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	53,788,561.36
2. 托管费	6.4.10.2.2	8,964,760.32
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	22,338,729.99
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-

6. 税金及附加		9.29
7. 其他费用	6.4.7.20	88,480.55
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		434,033,409.23
减：所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		434,033,409.23

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴全合兴两年封闭运作混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2021 年 1 月 12 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 12 日（基金合同生效日）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)	7,920,027,935.33	-	7,920,027,935.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	434,033,409.23	434,033,409.23
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)	-84.69	2.43	-82.26
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-84.69	2.43	-82.26
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)	7,920,027,850.64	434,033,411.66	8,354,061,262.30

注：本基金合同于 2021 年 1 月 12 日生效，本期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

兴全合兴两年封闭运作混合型证券投资基金（LOF）（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 11 月 2 日印发的证监许可[2020]2884 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》等相关法律法规和《兴全合兴两年封闭运作混合型证券投资基金（LOF）基金合同》发售，基金合同于 2021 年 1 月 12 日生效。本基金为上市契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为 7,920,027,935.33 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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《兴全合兴两年封闭运作混合型证券投资基金（LOF）基金合同》和《兴全合兴两年封闭运作混合型证券投资基金（LOF）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及存托凭证（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及存托凭证）、港股通标的股票、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、证券公司短期公司债券、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和转融通证券出借业务。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：本基金封闭期届满转换为开放式基金后，每个交易日日终，股票资产投资比例为基金资产的 60%—95%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%），封闭期内每个交易日日终，股票资产投资比例为基金资产的 60%—100%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%）；本基金封闭期届满转换为开放式基金后，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，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%，在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制；封闭期内每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；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：沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×20%+中债综合（全价）指数收益率×20%。

## 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金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 6.4.2 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 12 日（基金合同生效日）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

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2021 年 1 月 12 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日止。

### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

### 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

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于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，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值



变动形成的利得或损失计入当期损益。

- 应收款项以实际利率法按摊余成本计量。
- 除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金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；
- 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产的账面价值
- 因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据《企业会计准则》的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 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。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。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认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，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根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益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进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益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确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，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，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的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。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如无需在受益期内预提或分摊，则于发生时直接计入基金损益；如需采用预提或待摊的方法，预提或待摊时计入基金损益。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

封闭期间，基金收益分配采用现金方式；本基金封闭期届满转换为开放式基金后，登记在登记系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，其基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资，投资人可选择获取现金红利或将现金红利按再投日的基金份额净值自动转为相应类别的基金份额进行再投资，若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；登记在深圳证券账户的基金份额只能采取现金分红方式，不能选择红利再投资；具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定。由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，在收益分配数额方面可能有所不同。本基金同一类别内的每份基金份额享有同等分配权。基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额的基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值。法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。在符合法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

#### 6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产

生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《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》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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，根据中基协发[2017]6号《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》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《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》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

### 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[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	161,963,633.61
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	161,963,633.61

##### 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	6,678,793,429.07	7,519,033,630.12	840,240,201.05
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	3,015,300.00	-
	银行间市场	550,070,050.00	397,950.00
	合计	553,085,350.00	397,950.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	7,231,878,779.07	8,072,516,930.12	840,638,151.05

#### 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	22,911.49
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	11,488.46
应收债券利息	2,655,515.93
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	2,223.05
合计	2,692,138.93

#### 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	6,515,283.41
银行间市场应付交易费用	1,625.00
合计	6,516,908.41

#### 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	57,626.60
预提审计费用	28,813.30
合计	86,439.90

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 12 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	7,920,027,935.33	7,920,027,935.33
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-84.69	-84.69
- 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	7,920,027,850.64	7,920,027,850.64

注：申购含红利再投资、转入转换份额，赎回含转换转出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-406,604,741.82	840,638,151.05	434,033,409.23
本期基金份额交易产生的变动数	3.95	-1.52	2.43
其中：基金申购款	-	-	-



基金赎回款	3.95	-1.52	2.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-406,604,737.87	840,638,149.53	434,033,411.66

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月12日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
活期存款利息收入	3,574,849.78	
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	678,997.03	
其他	58,905.40	
合计	4,312,752.21	

#### 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12日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入	-349,801,402.85	
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	-349,801,402.85	

##### 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12日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
卖出股票成交总额	5,994,839,625.24	
减：卖出股票成本总额	6,344,641,028.09	
买卖股票差价收入	-349,801,402.85	

##### 6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

## 6.4.7.13 债券投资收益

## 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月12日（基金合同生效日）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	2,540,842.05
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	2,540,842.05

## 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12日（基金合同生效日）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	9,331,631.25
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	6,788,400.00
减：应收利息总额	2,389.20
买卖债券差价收入	2,540,842.05

## 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

## 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

## 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

## 6.4.7.14 贵金属投资收益

## 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 12 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	13,122,596.42
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	13,122,596.42

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021 年 1 月 12 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	840,638,151.05
股票投资	840,240,201.05
债券投资	397,950.00
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	840,638,151.05

#### 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 12 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	22,337,104.99
银行间市场交易费用	1,625.00
合计	22,338,729.99

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 12 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	28,813.30
信息披露费	57,626.60
证券出借违约金	-
账户维护费用	1,500.00
银行费用	540.65
合计	88,480.55

#### 6.4.7.21 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 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（“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（“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（“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12日（基金合同生效日）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	7,853,706,963.36	41.64

#### 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12日（基金合同生效日）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	11,626,100,000.00	22.81

#### 6.4.10.1.4 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。

#### 6.4.10.1.5 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12日（基金合同生效日）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	5,805,655.67	45.13	3,195,951.56	49.05

#### 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12日（基金合同生效日）至2021年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中：支付销售机构的客户维护费	22,638,860.44

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50%的年费率计提。计算方法如下：每日应支付的基金管理费=前一日的基金资产净值×1.50%/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12日（基金合同生效日）至2021年6月30日
	当期发生的基金应支付的托管费

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

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

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

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

注：本基金本报告期内无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

#### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期内无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本报告期内基金管理人未运用自有资金投资本基金。

##### 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：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12日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行	161,963,633.61	3,574,849.78

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内未在承销期内直接购入关联方承销证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末(2021年6月30日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002044	美年健康	2021年1月15日	2021年7月15日	大宗交易购入	12.49	8.95	6,000,000	74,940,000.00	53,700,000.00	-

			日	流通受限						
002607	中公教育	2021年2月1日	2021年8月2日	大宗交易购入流通受限	36.08	20.11	2,800,000	101,024,000.00	56,308,000.00	-
300948	冠中生态	2021年2月18日	2021年8月25日	新股流通受限	13.00	27.42	216	2,808.00	5,922.72	-
300948	冠中生态	2021年6月4日	2021年8月25日	新股流通受限-转增	-	27.42	108	-	2,961.36	注1
300950	德固特	2021年2月24日	2021年9月3日	新股流通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
301021	英诺	2021	2021	新股	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-



	激光	年6月28日	年7月6日	流通受限						
301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	新股流通受限	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
600456	宝钛股份	2021年2月25日	2021年8月23日	非公开发行流通受限	42.20	41.19	1,895,734	79,999,974.80	78,085,283.46	-
603799	华友钴业	2021年2月18日	2021年8月9日	非公开发行流通受限	84.00	108.54	892,857	74,999,988.00	96,910,698.78	-
603899	晨光文具	2021年1月15日	2021年7月15日	大宗交易购入流通受限	85.89	83.61	470,000	40,368,300.00	39,296,700.00	-
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	-
688677	海泰新光	2021年2月18日	2021年8月26日	新股流通受限	35.76	103.23	1,768	63,223.68	182,510.64	-

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
127038	国微转债	2021年6月10日	2021年7月14日	新债未上市	100.00	100.00	30,153	3,015,300.00	3,015,300.00	-

注：1、本基金持有的新股冠中生态，于2021年6月4日实施2020年年度权益分派方案，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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600460	士兰微	2021年6月30日	重大事项停牌	56.35	2021年7月1日	59.49	2,472,269	79,221,094.50	139,312,358.15	-

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、风险管理部和合规管理部以及审计部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值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
AAA	-
AAA 以下	3,015,300.00
未评级	-
合计	3,015,300.00

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

本基金合同生效后两年之内（含两年）为封闭期，在此期间投资者不能申购、赎回基金份额。本基金管理人针对基金特定的运作方式，建立了相应的流动性风险监控与预警机制。本基金管理人每日预测基金的流动性需求，通过独立的风险管理部门设置流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，并按照基金类型建立并定期开展专项的流动性压力测试工作，对流动性风险进行预警。

本基金所持的证券在证券交易所上市或可于银行间同业市场交易。截止本报告期末，单一投资者持有基金份额比例未超过基金总份额 50%，本基金投资未违背法律法规对流通受限资产的相关比例要求。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月 30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	161,963,633.61	-	-	-	-	-	161,963,633.61
结算备付金	12,771,436.35	-	-	-	-	-	12,771,436.35
存出保证金	3,148,143.95	-	-	-	-	-	3,148,143.95
交易性金融资产	-	-	550,468,000.00	-	3,015,300.00	7,519,033.630.12	8,072,516,930.12
应收利息	-	-	-	-	-	-2,692,138.93	2,692,138.93

						93	
应收股利	-	-	-	-	-	290,841.60	290,841.60
应收证券清算款	-	-	-	-	-	124,267,879.97	124,267,879.97
资产总计	177,883,213.91		550,468,000.00		3,015,300.00	7,646,284,490.62	8,377,651,004.53
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	3.20	3.20
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	9,862,565.64	9,862,565.64
应付托管费	-	-	-	-	-	1,643,760.94	1,643,760.94
应付证券清算款	-	-	-	-	-	5,480,045.62	5,480,045.62
应付交易费用	-	-	-	-	-	6,516,908.41	6,516,908.41
应交税费	-	-	-	-	-	18.52	18.52
其他负债	-	-	-	-	-	86,439.90	86,439.90
负债总计	-	-	-	-	-	23,589,742.23	23,589,742.23
利率敏感度缺口	177,883,213.91		550,468,000.00		3,015,300.00	7,622,694,748.39	8,354,061,262.30

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)。	
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)
	市场利率下降 1%	4,420,490.88
	市场利率上升 1%	-4,350,554.80

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基

金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

#### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民 币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资 产	-	810,699,331.63	-	810,699,331.63
资产合计	-	810,699,331.63	-	810,699,331.63
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净 额	-	810,699,331.63	-	810,699,331.63

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变	
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2021 年 6 月 30 日）
分析	所有外币相对人民币升值 5%	40,534,966.58
	所有外币相对人民币贬值 5%	-40,534,966.58

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险，主要是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。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，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其他价格风险，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，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

#### 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	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	7,519,033,630.12	90.00
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—债券投资	553,483,300.00	6.63
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	8,072,516,930.12	96.63

#### 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)
分析	业绩比较基准上升 10%	1,351,951,552.78
	业绩比较基准下降 10%	-1,351,951,552.78

#### 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	7,519,033,630.12	89.75
	其中：股票	7,519,033,630.12	89.75
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	553,483,300.00	6.61
	其中：债券	553,483,300.00	6.61
	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	174,735,069.96	2.09
8	其他各项资产	130,399,004.45	1.56
9	合计	8,377,651,004.53	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人民币810,699,331.63元，占净值比例9.70%。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	4,264,135,696.19	51.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	251,115.78	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	191,679,718.88	2.29
H	住宿和餐饮业	112,766,695.00	1.35
I	信息传输、软件和信息技术服务业	461,419,455.53	5.52
J	金融业	222,785,097.00	2.67
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	119,109,690.00	1.43
M	科学研究和技术服务业	466,790,234.94	5.59
N	水利、环境和公共设施管理业	8,884.08	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	58,227,791.00	0.70
Q	卫生和社会工作	595,124,452.68	7.12



R	文化、体育和娱乐业	95,408,468.40	1.14
S	综合	120,626,999.01	1.44
	合计	6,708,334,298.49	80.30

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	-	-
非日常生活消费品	219,703,348.44	2.63
日常消费品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	117,623,028.50	1.41
工业	-	-
信息技术	211,086,880.47	2.53
通信服务	214,814,246.06	2.57
公用事业	-	-
房地产	47,471,828.16	0.57
合计	810,699,331.63	9.70

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	600763	通策医疗	928,945	381,796,395.00	4.57
2	300750	宁德时代	607,891	325,100,106.80	3.89
3	002371	北方华创	1,092,600	303,065,388.00	3.63
4	002049	紫光国微	1,562,677	240,949,166.63	2.88
5	300059	东方财富	6,794,300	222,785,097.00	2.67
6	002920	德赛西威	1,988,878	218,935,690.24	2.62
7	00700	腾讯控股	442,064	214,814,246.06	2.57
8	002415	海康威视	3,312,400	213,649,800.00	2.56
9	00780	同程艺龙	11,974,400	193,693,526.14	2.32
10	601111	中国国航	24,637,496	191,679,718.88	2.29
11	603986	兆易创新	975,916	183,374,616.40	2.20
12	600703	三安光电	5,613,372	179,908,572.60	2.15
13	300012	华测检测	5,627,038	179,389,971.44	2.15
14	603259	药明康德	1,128,031	176,638,374.29	2.11
15	688005	容百科技	1,365,750	165,528,900.00	1.98
16	300015	爱尔眼科	2,248,916	159,628,057.68	1.91
17	600809	山西汾酒	346,218	155,105,664.00	1.86
18	600460	士兰微	2,472,269	139,312,358.15	1.67
19	600882	妙可蓝多	1,920,707	134,065,348.60	1.60

20	300327	中颖电子	1,433,213	122,152,743.99	1.46
21	000009	中国宝安	6,602,463	120,626,999.01	1.44
22	300896	爱美客	152,206	120,072,269.28	1.44
23	601888	中国中免	396,900	119,109,690.00	1.43
24	300595	欧普康视	1,147,462	118,819,690.10	1.42
25	688699	明微电子	412,330	117,645,995.60	1.41
26	600754	锦江酒店	1,980,100	112,766,695.00	1.35
27	000799	酒鬼酒	439,087	112,230,637.20	1.34
28	600315	上海家化	1,766,306	106,225,642.84	1.27
29	300454	深信服	400,746	103,985,572.08	1.24
30	600110	诺德股份	8,365,600	101,893,008.00	1.22
31	02013	微盟集团	7,136,000	101,653,815.71	1.22
32	603799	华友钴业	892,857	96,910,698.78	1.16
33	300413	芒果超媒	1,390,794	95,408,468.40	1.14
34	002460	赣锋锂业	762,538	92,335,726.42	1.11
35	601012	隆基股份	1,018,640	90,495,977.60	1.08
36	600519	贵州茅台	43,557	89,583,681.90	1.07
37	300760	迈瑞医疗	168,211	80,749,690.55	0.97
38	600456	宝钛股份	1,895,734	78,085,283.46	0.93
39	688008	澜起科技	1,185,137	73,928,846.06	0.88
40	688188	柏楚电子	168,392	73,418,912.00	0.88
41	002139	拓邦股份	3,847,200	69,211,128.00	0.83
42	688111	金山办公	173,406	68,460,688.80	0.82
43	600132	重庆啤酒	343,800	68,055,210.00	0.81
44	02382	舜宇光学科技	327,200	66,811,763.75	0.80
45	002475	立讯精密	1,382,800	63,608,800.00	0.76
46	06078	海吉亚医疗	696,800	59,138,921.09	0.71
47	688383	新益昌	415,157	58,541,288.57	0.70
48	002607	中公教育	2,891,900	58,227,791.00	0.70
49	601865	福莱特	1,400,696	55,369,512.88	0.66
50	000858	五粮液	185,500	55,258,595.00	0.66
51	002044	美年健康	6,000,000	53,700,000.00	0.64
52	688131	皓元医药	154,699	53,555,246.81	0.64
53	603899	晨光文具	606,876	50,870,934.56	0.61
54	06098	碧桂园服务	680,000	47,471,828.16	0.57
55	300496	中科创达	290,738	45,663,310.28	0.55
56	300685	艾德生物	421,477	43,867,326.16	0.53
57	01347	华虹半导体	1,194,000	42,621,301.01	0.51
58	688599	天合光能	1,435,638	40,700,337.30	0.49
59	300782	卓胜微	72,706	39,079,475.00	0.47
60	300502	新易盛	1,175,706	36,740,812.50	0.44
61	00460	四环医药	13,086,000	36,150,148.28	0.43

62	002555	三七互娱	1,489,593	35,780,023.86	0.43
63	688202	美迪西	65,656	34,134,554.40	0.41
64	300171	东富龙	835,000	33,942,750.00	0.41
65	300957	贝泰妮	116,773	31,709,226.68	0.38
66	002390	信邦制药	2,619,900	27,456,552.00	0.33
67	02020	安踏体育	171,000	26,009,822.30	0.31
68	688301	奕瑞科技	83,731	23,444,680.00	0.28
69	300887	谱尼测试	256,080	22,890,991.20	0.27
70	01093	石药集团	2,388,000	22,333,959.13	0.27
71	688690	纳微科技	182,183	21,406,502.50	0.26
72	688083	中望软件	29,797	16,456,883.10	0.20
73	688696	极米科技	1,252	1,041,664.00	0.01
74	688276	百克生物	3,486	364,565.88	0.00
75	688076	诺泰生物	4,984	339,958.64	0.00
76	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.00
77	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.00
78	688677	海泰新光	1,768	182,510.64	0.00
79	688315	诺禾致源	3,711	181,096.80	0.00
80	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
81	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
82	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
83	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
84	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
85	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
86	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
87	300987	川网传媒	301	8,069.81	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600703	三安光电	504,280,813.92	6.04
2	002371	北方华创	414,230,829.44	4.96
3	00700	腾讯控股	352,511,106.42	4.22
4	603799	华友钴业	275,869,342.90	3.30
5	600763	通策医疗	272,925,608.35	3.27
6	600690	海尔智家	270,442,231.74	3.24
7	300750	宁德时代	268,250,698.87	3.21
8	601111	中国国航	259,168,622.54	3.10
9	600036	招商银行	248,638,195.36	2.98

10	002460	赣锋锂业	237,164,754.28	2.84
10	01772	赣锋锂业	7,700,623.43	0.09
11	002049	紫光国微	239,651,460.06	2.87
12	002920	德赛西威	207,732,644.22	2.49
13	002415	海康威视	203,041,157.60	2.43
14	601899	紫金矿业	202,129,940.70	2.42
15	601601	中国太保	189,672,290.65	2.27
16	300059	东方财富	189,107,638.84	2.26
17	300896	爱美客	183,199,599.18	2.19
18	600809	山西汾酒	182,106,636.11	2.18
19	300012	华测检测	180,616,630.03	2.16
20	600456	宝钛股份	180,214,546.62	2.16
21	00780	同程艺龙	175,918,403.87	2.11

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600703	三安光电	299,228,805.74	3.58
2	600036	招商银行	247,138,064.55	2.96
3	600690	海尔智家	230,642,577.30	2.76
4	601899	紫金矿业	213,203,565.87	2.55
5	603799	华友钴业	186,455,493.61	2.23
6	601601	中国太保	155,813,962.11	1.87
7	002371	北方华创	150,272,787.38	1.80
8	600309	万华化学	145,653,270.83	1.74
9	002460	赣锋锂业	138,901,990.10	1.66
9	01772	赣锋锂业	6,419,059.95	0.08
10	600862	中航高科	140,105,765.56	1.68
11	603533	掌阅科技	139,107,370.64	1.67
12	000001	平安银行	130,377,585.89	1.56
13	03888	金山软件	128,148,705.69	1.53
14	300896	爱美客	122,361,250.89	1.46
15	00700	腾讯控股	120,131,284.91	1.44
16	002466	天齐锂业	111,702,261.81	1.34
17	03690	美团-W	104,797,535.88	1.25
18	300369	绿盟科技	103,573,712.22	1.24
19	600456	宝钛股份	97,092,774.04	1.16
20	300529	健帆生物	96,579,808.35	1.16

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	13,023,434,457.16
卖出股票收入（成交）总额	5,994,839,625.24

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	550,468,000.00	6.59
	其中：政策性金融债	550,468,000.00	6.59
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）	3,015,300.00	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	553,483,300.00	6.63

## 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	210206	21 国开 06	4,800,000	480,048,000.00	5.75
2	190207	19 国开 07	700,000	70,420,000.00	0.84
3	127038	国微转债	30,153	3,015,300.00	0.04

## 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，腾讯控股有限公司具有在报告编制日前一年内受到市场监管总局处罚的情况，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。

除上述情况外，本基金投资的前十名证券的发行主体中，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。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,148,143.95
2	应收证券清算款	124,267,879.97
3	应收股利	290,841.60
4	应收利息	2,692,138.93
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	130,399,004.45

#### 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 (%)
267,633	29,592.87	36,962,063.56	0.47	7,883,065,787.08	99.53

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	励丹骏	4,513,372.00	0.87
2	武凝	3,221,685.00	0.62
3	李颀	2,928,804.00	0.56
4	银泰通信有限公司	2,899,516.00	0.56
5	王凌	2,606,637.00	0.50
6	苏伟枢	2,460,196.00	0.47
7	李亚楠	2,329,571.00	0.45
8	苏伟昂	2,100,097.00	0.40
9	林萍	2,050,163.00	0.39
10	陈顺利	2,050,163.00	0.39

注：持有人为 LOF 基金场内持有人。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	3,310,568.91	0.0418

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	50~100

本基金基金经理持有本开放式基金	50~100
-----------------	--------

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021 年 1 月 12 日） 基金份额总额	7,920,027,935.33
基金合同生效日起至报告期期末基金 总申购份额	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金 总赎回份额	84.69
基金合同生效日起至报告期期末基金 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	7,920,027,850.64

注：卖出/赎回总份额含低于最低持有份额而强制赎回的份额。

## § 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比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
兴业证券	2	7,853,706,963.36	41.64%	5,805,655.67	45.13%	-
长江证券	1	5,121,463,512.10	27.15%	3,324,751.77	25.85%	-
华泰证券	2	3,673,198,398.33	19.48%	2,319,463.79	18.03%	-
招商证券	2	837,336,195.53	4.44%	528,616.34	4.11%	-
华创证券	1	707,309,652.50	3.75%	460,371.61	3.58%	-
浙商证券	2	260,372,900.73	1.38%	165,965.36	1.29%	-
中信证券	2	163,058,850.74	0.86%	102,930.43	0.80%	-
中国中金 财富证券	2	143,332,331.09	0.76%	90,490.53	0.70%	-
光大证券	1	101,024,000.00	0.54%	65,252.41	0.51%	-

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

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
兴业证券	-	-	11,626,100,000.00	22.81%	-	-
长江证券	6,623,862.34	70.98%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	39,349,900,000.00	77.19%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	2,707,768.91	29.02%	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中国中金 财富证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-

## 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	关于兴全合兴两年封闭运作混合型证券投资基金（LOF）认购申请确认比例结果的公告	证券时报、指定互联网网站	2021-01-07
2	关于旗下部分基金投资华友钴业（603799）非公开发行股票的公告	证券时报、指定互联网网站	2021-02-20
3	关于旗下部分基金投资宝钛股份（600456）非公开发行股票的公告	证券时报、指定互联网网站	2021-02-27
4	关于兴全合兴两年封闭运作混合型证券投资基金（LOF）开通跨系统转托管业务公告	证券时报、指定互联网网站	2021-04-12
5	兴全合兴两年封闭运作混合型证券投资基金（LOF）上市交易公告书	证券时报、指定互联网网站	2021-04-12
6	兴全合兴两年封闭运作混合型证券投资基金（LOF）上市交易提示性公告	证券时报、指定互联网网站	2021-04-15
7	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	证券时报、指定互联网网站	2021-05-17
8	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、指定互联网网站	2021-05-19
9	关于增加陆金所为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、指定互联网网站	2021-06-01
10	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	证券时报、指定互联网网站	2021-06-16
11	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	证券时报、指定互联网网站	2021-06-17
12	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	证券时报、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

本基金基金合同生效后，前两年封闭运作，在封闭期内不开放申购、赎回业务，但投资人可在本基金上市交易后通过深圳证券交易所转让基金份额。

## § 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合兴两年封闭运作混合型证券投资基金（LOF）注册的批复
- 2、《兴全合兴两年封闭运作混合型证券投资基金（LOF）基金合同》
- 3、《兴全合兴两年封闭运作混合型证券投资基金（LOF）托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 5、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 6、关于申请募集注册兴全合兴两年封闭运作混合型证券投资基金（LOF）的法律意见书
- 7、登记协议
- 8、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