

兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金

2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：兴证全球基金管理有限公司

基金托管人：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

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	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
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
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	17
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48

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	48
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	49
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	49
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	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12 投资组合报告附注	49
§ 8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
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	51
§ 9 开放式基金份额变动	51
§ 10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
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	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8 其他重大事件	54
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	54
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	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	55
§ 12 备查文件目录	55
12.1 备查文件目录	55
12.2 存放地点	55
12.3 查阅方式	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	兴全有机增长混合
基金主代码	340008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 3 月 25 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	662,921,230.08 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金投资于有机增长能力强的公司，获取当前收益及实现长期资本增值。
投资策略	本基金采取“自上而下”的方法，定性与定量研究相结合，在股票与债券等资产类别之间进行资产配置。在宏观与微观层面对各类资产的价值增长能力展开综合评估，动态优化资产配置。并借鉴海外有机增长的研究成果，构建“兴证全球有机增长筛选系统”，将有机增长投资作为本基金股票组合投资的核心理念。
业绩比较基准	沪深 300 指数×50%+中证国债指数×45%+同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，预计长期平均风险与收益低于股票型证券投资基金，高于可转债、债券型、货币型证券投资基金，属于中高风险、中高收益的证券投资基金品种。

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	http://www.xqfunds.com

基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所
------------	------------------

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	兴证全球基金管理有限公司	上海市浦东新区芳甸路 1155 号 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	387,493,025.70
本期利润	198,022,056.37
加权平均基金份额本期利润	0.2783
本期加权平均净值利润率	6.73%
本期基金份额净值增长率	6.11%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	2,044,039,520.58
期末可供分配基金份额利润	3.0834
期末基金资产净值	2,840,684,415.62
期末基金份额净值	4.2851
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	520.85%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率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	1.82%	0.89%	-1.02%	0.41%	2.84%	0.48%
过去三个月	6.88%	0.78%	2.41%	0.49%	4.47%	0.29%
过去六个月	6.11%	1.05%	1.37%	0.66%	4.74%	0.39%
过去一年	37.17%	1.18%	13.75%	0.66%	23.42%	0.52%
过去三年	98.05%	1.28%	31.64%	0.67%	66.41%	0.61%
自基金合同生效起至今	520.85%	1.31%	93.46%	0.73%	427.39%	0.58%

注：本基金业绩比较基准的选取上主要基于如下考虑：本基金采用沪深 300 指数作为股票投资部分的业绩比较基准主要是因为沪深 300 指数选取了 A 股市场上规模最大、流动性最好的 300 只股票作为其成份股，对沪深市场的覆盖度高，具有良好的市场代表性。中证国债指数是一个全面反映国债市场（包括银行间、上交所、深交所）的综合性指数，也是债券品种中比较基准的参考。

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：

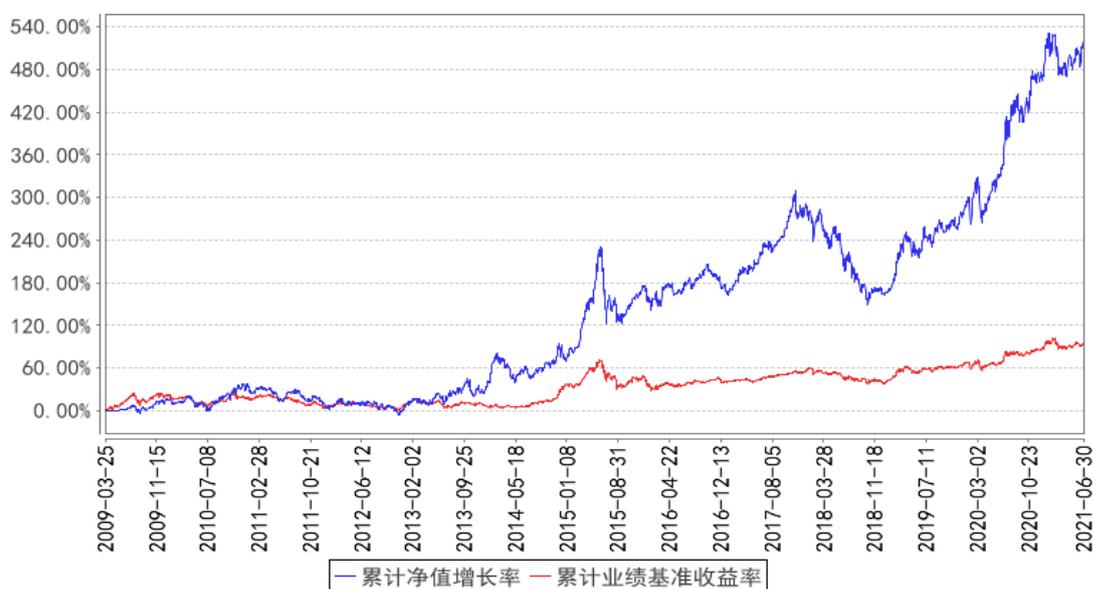
$$\text{Return}_t = 50\% \times (\text{沪深 300 指数}_t / \text{沪深 300 指数}_{t-1} - 1) + 45\% \times (\text{中证国债指数}_t / \text{中证国债指数}_{t-1} - 1) + 5\% \times (\text{同业存款利率}_t / 360)$$

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

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

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

兴全有机增长混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、净值表现所取数据截至到 2021 年 06 月 30 日。

2、按照《兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金建仓期为 2009 年 3 月 25 日至 2009 年 9 月 25 日，建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

3.3 其他指标

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

兴证全球基金管理有限公司（成立时名为“兴业基金管理有限公司”，以下简称“公司”）经证监基金字[2003]100 号文批准于 2003 年 9 月 30 日成立。2008 年 1 月，中国证监会批复（证监许可[2008]6 号），同意全球人寿保险国际公司（AEGON International B.V）受让公司股权并成为公司股东。2008 年 4 月 9 日，公司完成股权转让、变更注册资本等相关手续后，公司注册资本由 9800 万元变更为人民币 1.2 亿元，其中兴业证券股份有限公司的出资占注册资本的 51%，全球人寿保险国际公司的出资占注册资本的 49%。2008 年 7 月，经中国证监会批准（证监许可[2008]888 号），公司于 2008 年 8 月 25 日完成变更公司名称、注册资本等相关手续后，公司名称变更为“兴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		
钱鑫	兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2020 年 12 月 9 日	-	11 年	硕士，历任上海证大投资管理有限公司投资经理助理，兴证全球基金管理有限公司研究员、基金经理助理。
季侃乐	兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2015 年 12 月 31 日	-	12 年	硕士，历任兴证全球基金管理有限公司行业研究员、兴全社会责任混合型证券投资基金基金经理助理、兴全全球视野股票型证券投资基金基金经理。
乔迁	兴全有机灵活配置混合型证券投资基金、兴全商业模式优选混合型证券投资基金（LOF）基金经理	2018 年 5 月 3 日	-	13 年	硕士，历任兴证全球基金管理有限公司行业研究员、兴全合润分级混合型证券投资基金基金经理助理、兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理。

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、乔迁、季侃乐于 2021 年 7 月 19 日起离任本基金基金经理。

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、《兴全有机增

长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，确保各投资组合之间得到公平对待，保护投资者的合法权益。公司风险管理部对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异进行统计，从不同的角度分析差异的来源、考察是否存在不公平的因素。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，不存在本投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年全球经济依旧在和疫情的对抗中艰难前行。尽管变异后的德尔塔病毒传播力更强，但凭借疫苗接种的快速覆盖以及医疗资源的大力投入，世界主要经济体的重症比例和死亡率较此前明显下降，生产和消费活动均有不同程度的恢复。中国依靠高效的社会治理，针对突发疫情进行快速反应，保证了我们全球制造中心的强势地位，出口持续保持增长。欧美则倾向于淡化疫情的严重性，逐步建立与病毒长期共存的共识基础。从大型赛事的上座率来看，线下活动已基本恢复至接近疫情前的水平。相比之下，部分发展中国家受到此轮疫情的影响较为严重，印度、越南和马来西亚等国家均被迫实施了不同程度的社交封锁，导致生产停顿。供应链的暂时断裂造成半导体等行业出现大面积缺货，涨价压力持续向制造业中游传导。总体而言，世界在从疫情中缓慢恢复，但人间并不共此冷暖。

国内经济方面，制造业继续维持较高景气度运行，而服务业表现相对弱势，背后主要受到不同需求主体购买力差异的影响。欧美受益于基础货币的扩张和直接的财政补贴，在疫情期间一如既往扮演着全球买手的角色：从去年居民购买消费品，到今年企业购置资本品，商品需求的结构在变，但总量一直保持增长。与之相对，我国在逆周期政策工具的使用上明显更为克制，以保障

而非刺激为基本目标。由于缺少来自外部的直接财务支持，居民部门出于防御性动机提高储蓄比例，导致购买力相应减弱，造成了服务业等不可贸易部门需求恢复的不及预期。结构性复苏同样也是上半年国内经济的主要特征。

报告期内，市场运行的波动明显放大，同时伴随着结构分化向越来越极致的方向演绎。赛道投资仍是主流共识，但能够承载高估值信仰的赛道日益减少。市场微观交易结构正变得越来越拥挤，结构调整的难度在不断加大。本基金组合在年初减持了前期涨幅较大的大市值白马股票，随后保持了较低的仓位以观察市场后续的发展。进入二季度后，利用股价波动买入了部分核心持仓的公司，在提升仓位和集中度的同时，将结构由消费向科技做了适当迁移，增强了组合的弹性。尽管从业绩表现来看调整的效果尚可，但后续我们大概率不会选择更为极致的风格偏移，而是会重新向一个相对均衡的结构回归。价值投资始终是我们坚守的核心原则，本基金坚持以为客户创造长期持续的价值增长为目标，希望能够与所有客户共同携手成长。

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 4.2851 元；本报告期基金份额净值增长率为 6.11%，业绩比较基准收益率为 1.37%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们或许正重新走入一个充满不确定性和波动的世界。如果观察主要央行的资产负债表，我们可以认为世界经济从未真正走出过 08 年以来的危机模式。天量的基础货币和不断突破的财政赤字在现代货币理论的统领下轮番登场，试图将每一次周期的波动化解于无形。从经济增长的单一维度来考量，这种努力到目前为止尚算成功。但引发波动的能量始终积压在系统的内部未能得到释放，导致系统内在张力不断增加——无论是社会贫富差距的扩大，还是资本市场不同行业间估值的极致分化，本质上都是这股在流动性滋养下不断壮大的不稳定力量所导致的结果。在新一轮技术革命未真正来临之前，当前系统对内生张力的承载力正逐渐接近极限。向后推演，或者我们改变政策目标，主动去释放这股张力；或者风险以某种我们所意料不到的方式完成自我的释放。前者对应整个社会运行模式的切换，后者对应黑天鹅事件的频发。无论哪一种，都会使我们既有的基于经验迭代出的投资框架变得错漏百出。

和身体一样，人的理性精神也需要通过不停地磨炼才能得以进步。如果说身体是通过对抗某种外加的负载来实现锻炼的目的，那么理性的培养就是在一次次面对不确定性的决策中得以实践。我们所有平抑周期的努力，都是为了创造一个充满确定性的安稳现世。但在这样的一个世界里，人的思维模式容易固化，理性也得不到充分发展。长此以往，当需要重新迎接不确定性挑战的时候，直觉和情感便替代理性，成为主要的决策力量。但直觉反应是随机的，情感则容易出现大幅

的波动，这在微观层面解释了一个致力于内部高度稳定的系统为何终将不可避免地趋向混乱。追逐短期利益、情绪化表达、极致性演绎……这些现象都可以视作个体理性下降导致的群体非理性行为。

投射到证券市场，不确定性的上升已然导致了诸多热门赛道抱团的瓦解，同时市场整体的波动率显著放大。我们认为风险正在结构性行情的发展中不断累积，但后续可能引发调整的变量无法提前预判：也许是实体经济被证实走向衰退，也许是美联储正式开始缩表，也有可能是久违的高通胀卷土重来。但有一点可以确定，那就是风险从来不会被消灭，趋势越发展到后期，越要系好安全带。过去不代表未来，在拐点附近的线性外推会是我们犯过最昂贵的错误。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：1、估值委员会制定旗下基金的估值政策和流程，选取适当的估值方法、定期对估值政策和程序进行评价。采用的基金估值方法、政策和程序应经估值委员会审议，并报管理层批准后方可实施。2、估值方法确立后，由 IT 人员或 IT 人员协助估值系统开发商及时对系统中的参数或模型作相应的调整或对系统进行升级，以适应新的估值方法的需要。3、基金会计具体负责执行估值委员会确定的估值策略，并通过与托管行核对等方法确保估值准确无误；4、投资人员（包括基金经理）积极关注市场环境变化及证券发行机构有关影响证券价格的重大事件等可能对给估值造成影响的因素，并就可能带来的影响提出建议和意见；5、监察稽核人员参与估值方案的制定，确保估值方案符合相关法律法规及基金合同的约定，定期对估值流程、系统估值模型及估值结果进行检查，确保估值委员会决议的有效执行，负责基金估值业务的定期和临时信息披露。

上述参与估值流程人员均具备估值业务所需的专业胜任能力。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，本报告期内未进行利润分配，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：兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	218,587,189.19	92,164,851.93
结算备付金		2,128,561.84	7,574,721.53
存出保证金		818,143.31	1,217,025.57
交易性金融资产	6.4.7.2	2,654,337,946.76	3,320,348,564.17
其中：股票投资		2,185,252,328.65	2,683,013,922.20
基金投资		-	-
债券投资		469,085,618.11	637,334,641.97
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		-	215,783.67

应收利息	6.4.7.5	3,272,555.06	2,619,767.36
应收股利		-	-
应收申购款		1,728,474.99	2,262,595.85
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,880,872,871.15	3,426,403,310.08
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		19,755,630.79	14,024,713.40
应付赎回款		15,077,769.65	15,936,696.91
应付管理人报酬		3,442,941.71	4,257,833.78
应付托管费		573,823.62	709,638.96
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,214,221.41	1,649,363.54
应交税费		3,706.40	5,478.82
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	120,361.95	213,129.46
负债合计		40,188,455.53	36,796,854.87
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	662,921,230.08	839,341,884.31
未分配利润	6.4.7.10	2,177,763,185.54	2,550,264,570.90
所有者权益合计		2,840,684,415.62	3,389,606,455.21
负债和所有者权益总计		2,880,872,871.15	3,426,403,310.08

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 4.2851 元，基金份额总额 662,921,230.08 份。

6.2 利润表

会计主体：兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		229,694,052.26	510,955,481.73

1. 利息收入		2,726,815.95	2,798,045.30
其中：存款利息收入	6.4.7.11	401,556.60	834,764.06
债券利息收入		2,325,259.35	1,959,173.29
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	4,107.95
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		415,378,602.44	547,206,820.09
其中：股票投资收益	6.4.7.12	397,519,593.21	506,706,082.27
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	5,559,486.39	23,604,434.70
资产支持证券投资	6.4.7.13.5	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	12,299,522.84	16,896,303.12
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-189,470,969.33	-39,716,659.64
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	1,059,603.20	667,275.98
减：二、费用		31,671,995.89	34,791,787.27
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	21,950,150.76	20,350,876.31
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,658,358.40	3,391,812.76
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	5,954,627.16	10,755,876.51
5. 利息支出		-	185,197.78
其中：卖出回购金融资产支出		-	185,197.78
6. 税金及附加		2,664.78	1,356.89
7. 其他费用	6.4.7.20	106,194.79	106,667.02
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		198,022,056.37	476,163,694.46
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		198,022,056.37	476,163,694.46

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	839,341,884.31	2,550,264,570.90	3,389,606,455.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	198,022,056.37	198,022,056.37
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)	-176,420,654.23	-570,523,441.73	-746,944,095.96
其中：1. 基金申购款	96,550,510.45	304,260,169.33	400,810,679.78
2. 基金赎回款	-272,971,164.68	-874,783,611.06	-1,147,754,775.74
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)	662,921,230.08	2,177,763,185.54	2,840,684,415.62
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,301,543,156.10	2,113,370,697.08	3,414,913,853.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	476,163,694.46	476,163,694.46
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)	-451,433,311.53	-783,945,575.21	-1,235,378,886.74
其中：1. 基金申购款	227,678,406.99	410,604,906.65	638,283,313.64

2. 基金赎回款	-679, 111, 718. 52	-1, 194, 550, 481. 86	-1, 873, 662, 200. 38
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）	850, 109, 844. 57	1, 805, 588, 816. 33	2, 655, 698, 660. 90

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

杨华辉

庄园芳

詹鸿飞

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金（原名兴业有机增长灵活配置混合型证券投资基金）（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2008]1395 号文《关于核准兴业有机增长灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》的核准，由兴证全球基金管理有限公司作为管理人向社会公开发行募集，基金合同于 2009 年 3 月 25 日正式生效，首次设立募集规模为 1,980,254,871.35 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为兴证全球基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。本基金于 2011 年 1 月 1 日起更名为兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括依法公开发行上市的股票、国债、金融债、企业债、公司债、回购、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具。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。本基金为混合型基金，股票投资比例为基金资产的 30%-80%；债券投资比例为基金资产的 0%-65%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不小于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资组合中突出有机增长特征的股票合计投资比例不低于股票资产的 80%。如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

本基金的业绩比较基准为“沪深 300 指数×50%+中证国债指数×45%+同业存款利率×5%”。

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、2021 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》(财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号)、财税 [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。

(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。

(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	218,587,189.19
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	218,587,189.19

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	1,955,364,532.84	2,185,252,328.65	229,887,795.81
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	475,422,888.18	469,085,618.11
	银行间市场	-	-
	合计	475,422,888.18	469,085,618.11
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,430,787,421.02	2,654,337,946.76	223,550,525.74

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	18,767.12
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	862.11
应收债券利息	3,252,589.35
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	5.10
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	331.38
合计	3,272,555.06

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,214,221.41
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,214,221.41

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	33,581.50
应付证券出借违约金	-
预提信息披露费	59,507.37
预提审计费	27,273.08
合计	120,361.95

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	839,341,884.31	839,341,884.31
本期申购	96,550,510.45	96,550,510.45
本期赎回 (以“-”号填列)	-272,971,164.68	-272,971,164.68
- 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	662,921,230.08	662,921,230.08

注：申购含红利再投资、转入转换份额，赎回含转换转出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,172,184,994.64	378,079,576.26	2,550,264,570.90
本期利润	387,493,025.70	-189,470,969.33	198,022,056.37
本期基金份额交易产生的变动数	-515,638,499.76	-54,884,941.97	-570,523,441.73
其中：基金申购款	288,240,571.67	16,019,597.66	304,260,169.33
基金赎回款	-803,879,071.43	-70,904,539.63	-874,783,611.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,044,039,520.58	133,723,664.96	2,177,763,185.54

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	367,429.75
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	25,532.78
其他	8,594.07
合计	401,556.60

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	397,519,593.21
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	397,519,593.21

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	2,598,856,692.12
减：卖出股票成本总额	2,201,337,098.91
买卖股票差价收入	397,519,593.21

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	5,559,486.39
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	5,559,486.39

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	516,091,050.41
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	508,804,897.77
减：应收利息总额	1,726,666.25
买卖债券差价收入	5,559,486.39

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：本基金本报告期内未进行衍生工具买卖交易。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	12,299,522.84
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	12,299,522.84

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-189,470,969.33
股票投资	-190,222,903.80
债券投资	751,934.47
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	-189,470,969.33

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,049,140.25
基金转换费收入	10,462.95
合计	1,059,603.20

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	5,954,627.16
银行间市场交易费用	-
合计	5,954,627.16

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

审计费用	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	814.34
其他	600.00
账户维护费用	18,000.00
合计	106,194.79

6.4.7.21 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须做披露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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	21,950,150.76	20,350,876.31
其中：支付销售机构的客户维护费	5,641,244.62	5,546,888.82

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。计算方法如下：每日应计提的基金管理费=前一日的基金资产净值×1.5%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,658,358.40	3,391,812.76

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2009 年 3 月 25 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	4,151,718.98	4,151,718.98
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份 额	-	-
报告期末持有的基金份额	4,151,718.98	4,151,718.98
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.6263%	0.4884%

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：无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	218,587,189.19	367,429.75	73,067,373.51	762,421.32

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：本报告期内本基金未进行利润分配，符合基金合同的规定。

6.4.12 期末(2021年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002064	华峰化学	2020年2月4日	2022年2月7日	非公开发行流通受限	5.43	12.87	2,302,026	12,500,001.18	29,627,074.62	注1
002182	云海金属	2021年3月23日	2021年9月23日	大宗交易购入流通受限	9.69	11.55	3,090,000	29,942,100.00	35,689,500.00	-
002405	四维图新	2021年2月23日	2021年08月26日	非公开发行流通受限	12.50	14.07	1,600,000	20,000,000.00	22,512,000.00	-
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	新股流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300926	博俊	2020	2021	新股	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-

	科技	年 12 月 29 日	年 07 月 12 日	流通受限							
300927	江天化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-	
300929	华骐环保	2021 年 1 月 12 日	2021 年 07 月 21 日	新股流通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-	
300931	通用电梯	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	新股流通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-	
300932	三友联众	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股流通受限	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-	
300933	中辰股份	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股流通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-	
300937	药易购	2021 年 1 月 20 日	2021 年 7 月 27 日	新股流通受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-	
300942	易瑞生物	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股流通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-	
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	-	注 2
300950	德固	2021	2021	新股	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-	

	特	年 2 月 24 日	年 9 月 3 日	流通 受限						
300952	恒辉 安防	2021 年 3 月 3 日	2021 年 9 月 13 日	新股 流通 受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
300953	震裕 科技	2021 年 3 月 11 日	2021 年 9 月 22 日	新股 流通 受限	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300955	嘉亨 家化	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 24 日	新股 流通 受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300956	英力 股份	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 27 日	新股 流通 受限	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300957	贝泰 妮	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 27 日	新股 流通 受限	47.33	251.96	853	40,372.49	214,921.88	-
300958	建工 修复	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 29 日	新股 流通 受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300960	通业 科技	2021 年 3 月 22 日	2021 年 9 月 29 日	新股 流通 受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水 海纳	2021 年 3 月 23 日	2021 年 9 月 30 日	新股 流通 受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金 辐照	2021 年 3 月 29 日	2021 年 10 月 11 日	新股 流通 受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300966	共同 药业	2021 年 3 月 31 日	2021 年 10 月 11 日	新股 流通 受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300967	晓鸣	2021	2021	新股	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-

	股份	年 4 月 2 日	年 10 月 13 日	流通 受限						
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	-
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	2021	2021	新股	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-

	遮阳	2021年5月17日	2021年11月24日	流通受限						
300995	奇德新材	2021年5月17日	2021年11月26日	新股流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联软件	2021年5月26日	2021年12月3日	新股流通受限	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300997	欢乐家	2021年5月26日	2021年12月2日	新股流通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月2日	新股流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	新股流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301004	嘉益股份	2021年6月18日	2021年12月27日	新股流通受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
301007	德迈仕	2021年6月4日	2021年12月16日	新股流通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301010	晶雪节能	2021年6月9日	2021年12月20日	新股流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301011	华立科技	2021年6月9日	2021年12月17日	新股流通受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬电科技	2021年6月15日	2021年12月22日	新股流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301016	雷尔	2021	2021	新股	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-

	伟	2021年6月23日	2021年12月30日	流通受限							
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	-	
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	-	
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	2021年7月6日	新股流通受限	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-	
301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	新股流通受限	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-	
600754	锦江酒店	2021年3月23日	2021年9月22日	非公开发行流通受限	44.60	54.68	672,646	30,000,011.60	36,780,283.28	-	
603486	科沃斯	2021年1月26日	2021年7月26日	大宗交易购入流通受限	109.37	222.09	200,000	21,874,000.00	44,418,000.00	-	
603816	顾家家居	2021年1月26日	2021年7月26日	大宗交易购入流通受限	71.09	75.26	200,000	14,218,000.00	15,052,000.00	-	
605287	德才股份	2021年6月	2021年7	新股流通	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-	

		28 日	月 6 日	受限						
688076	诺泰生物	2021 年 5 月 12 日	2021 年 11 月 22 日	新股流通受限	15.57	48.55	4,984	77,600.88	241,973.20	-
688087	英科再生	2021 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 10 日	新股流通受限	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688217	睿昂基因	2021 年 5 月 7 日	2021 年 11 月 17 日	新股流通受限	18.42	58.40	1,040	19,156.80	60,736.00	-
688226	威腾电气	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688314	康拓医疗	2021 年 5 月 11 日	2021 年 11 月 18 日	新股流通受限	17.34	74.48	1,085	18,813.90	80,810.80	-
688315	诺禾致源	2021 年 4 月 2 日	2021 年 10 月 13 日	新股流通受限	12.76	39.20	3,711	47,352.36	145,471.20	-
688395	正弦电气	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 29 日	新股流通受限	15.95	22.37	1,627	25,950.65	36,395.99	-
688626	翔宇医疗	2021 年 3 月 23 日	2021 年 10 月 08 日	新股流通受限	28.82	104.16	3,652	105,250.64	380,392.32	-
688686	奥普特	2020 年 12 月 24 日	2021 年 7 月 1 日	新股流通受限	78.49	451.00	2,330	182,881.70	1,050,830.00	-
688689	银河微电	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 27 日	新股流通受限	14.01	35.62	3,258	45,644.58	116,049.96	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券	证券	成功	可流	流通	认购	期末估	数量	期末	期末估值总额	备注
----	----	----	----	----	----	-----	----	----	--------	----

代码	名称	认购日	通日	受限类型	价格	值单价	(单位:张)	成本总额		
113050	南银转债	2021年6月17日	2021年7月1日	新发未上市	100.00	100.00	7,330	733,000.00	733,000.00	-

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

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

3、上述流通受限证券可流通日系基金根据上市公司公告暂估确定，最终日期以上市公司公告为准。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600460	士兰微	2021年6月30日	重大事项停牌	56.35	2021年7月1日	59.49	600,000	22,027,732.91	33,810,000.00	-

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

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与因转融通证券出借业务而出借的证券。

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市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

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

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	70,272,011.60	74,308,978.20
AAA 以下	279,120,606.51	417,646,772.27
未评级	-	-
合计	349,392,618.11	491,955,750.47

注：此处列示的信用证券不包括国债、央行票据、政策性金融债券等非信用债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

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

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易。因此，除在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、权证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	218,587,189.19	-	-	-	-	-	218,587,189.19
结算备付金	2,128,561.84	-	-	-	-	-	2,128,561.84
存出保证金	818,143.31	-	-	-	-	-	818,143.31
交易性金融资产	99,631,000.00	-	20,062,000.00	196,050,919.20	153,341,698.91	2,185,252,328.65	2,654,337,946.76
应收利息	-	-	-	-	-	3,272,555.06	3,272,555.06
应收申购款	38,661.81	-	-	-	-	1,689,813.18	1,728,474.99
资产总计	321,203,556.15	-	20,062,000.00	196,050,919.20	153,341,698.91	2,190,214,696.89	2,880,872,871.15
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	15,077,769.65	15,077,769.65
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,442,941.71	3,442,941.71
应付托管费	-	-	-	-	-	573,823.62	573,823.62
应付证券清算款	-	-	-	-	-	19,755,630.79	19,755,630.79
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,214,221.41	1,214,221.41
应交税费	-	-	-	-	-	3,706.40	3,706.40
其他负债	-	-	-	-	-	120,361.95	120,361.95
负债总计	-	-	-	-	-	40,188,455.53	40,188,455.53
利率敏感度缺口	321,203,556.15	-	20,062,000.00	196,050,919.20	153,341,698.91	2,150,026,241.36	2,840,684,415.62
上年度末 2020年12月	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

31 日							
资产							
银行存款	92,164,851.93	-	-	-	-	-	92,164,851.93
结算备付金	7,574,721.53	-	-	-	-	-	7,574,721.53
存出保证金	1,217,025.57	-	-	-	-	-	1,217,025.57
交易性金融资产	45,877,411.80	99,501,479.70	110,376,040.02	381,579,710.45	2,683,013,922.20	3,320,348,564.17	
应收利息	-	-	-	-	2,619,767.36	2,619,767.36	
应收申购款	20,452.53	-	-	-	2,242,143.32	2,262,595.85	
应收证券清算款	-	-	-	-	215,783.67	215,783.67	
资产总计	146,854,463.36	99,501,479.70	110,376,040.02	381,579,710.45	2,688,091,616.55	3,426,403,310.08	
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	15,936,696.91	15,936,696.91	
应付管理人报酬	-	-	-	-	4,257,833.78	4,257,833.78	
应付托管费	-	-	-	-	709,638.96	709,638.96	
应付证券清算款	-	-	-	-	14,024,713.40	14,024,713.40	
应付交易费用	-	-	-	-	1,649,363.54	1,649,363.54	
应交税费	-	-	-	-	5,478.82	5,478.82	
其他负债	-	-	-	-	213,129.46	213,129.46	
负债总计	-	-	-	-	36,796,854.87	36,796,854.87	
利率敏感度缺口	146,854,463.36	99,501,479.70	110,376,040.02	381,579,710.45	2,651,294,761.68	3,389,606,455.21	

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他影响债券公允价值的变量保持不变，仅利率发生变动；
	假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化(即平移收益率曲线)。

	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	市场利率下降 1%	121,395.55	546,982.46
	市场利率上升 1%	-120,759.84	-541,321.52

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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		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	2,185,252,328.65	76.93	2,683,013,922.20	79.15
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	469,085,618.11	16.51	637,334,641.97	18.80
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	2,654,337,946.76	93.44	3,320,348,564.17	97.96
----	------------------	-------	------------------	-------

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假设单个证券的公允价值和市场组合的公允价值依照资本-资产定价模型 (CAPM) 描述的规律进行变动		
	使用本基金业绩比较基准所对应的市场组合进行分析		
	在业绩基准变化 10% 时, 对单个证券相应的公允价值变化进行加总得到基金净值的变化		
	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%	422,931,791.22	557,623,059.84
	业绩比较基准-10%	-422,931,791.22	-557,623,059.84

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	2,185,252,328.65	75.85
	其中: 股票	2,185,252,328.65	75.85
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	469,085,618.11	16.28
	其中: 债券	469,085,618.11	16.28
	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	220,715,751.03	7.66
8	其他各项资产	5,819,173.36	0.20

9	合计	2,880,872,871.15	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	49,151,807.94	1.73
C	制造业	1,606,230,924.35	56.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,662.00	0.00
E	建筑业	11,014.44	0.00
F	批发和零售业	14,672,422.51	0.52
G	交通运输、仓储和邮政业	19,726,000.00	0.69
H	住宿和餐饮业	81,781,148.18	2.88
I	信息传输、软件和信息技术服务业	285,013,713.55	10.03
J	金融业	38,463,409.32	1.35
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	44,871,227.10	1.58
M	科学研究和技术服务业	822,272.65	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	44,438.33	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	44,447,998.00	1.56
S	综合	-	-
	合计	2,185,252,328.65	76.93

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	600703	三安光电	4,317,497	138,375,778.85	4.87
2	600690	海尔智家	5,256,828	136,204,413.48	4.79
3	002415	海康威视	1,756,497	113,294,056.50	3.99
4	600754	锦江酒店	1,462,828	81,781,148.18	2.88
5	688099	晶晨股份	719,684	80,748,544.80	2.84
6	300316	晶盛机电	1,539,775	77,758,637.50	2.74

7	300253	卫宁健康	4,599,496	74,833,799.92	2.63
8	002920	德赛西威	640,482	70,504,258.56	2.48
9	002182	云海金属	5,925,326	69,656,705.48	2.45
10	603707	健友股份	1,251,647	52,256,262.25	1.84
11	603816	顾家家居	648,124	49,683,022.72	1.75
12	601899	紫金矿业	5,072,426	49,151,807.94	1.73
13	603799	华友钴业	420,000	47,964,000.00	1.69
14	002371	北方华创	172,676	47,896,868.88	1.69
15	600315	上海家化	768,800	46,235,632.00	1.63
16	300662	科锐国际	740,205	44,871,227.10	1.58
17	300413	芒果超媒	647,930	44,447,998.00	1.56
18	603486	科沃斯	200,000	44,418,000.00	1.56
19	002212	天融信	2,224,920	43,986,668.40	1.55
20	600521	华海药业	2,079,629	43,422,653.52	1.53
21	002332	仙琚制药	3,381,424	42,403,056.96	1.49
22	002475	立讯精密	850,000	39,100,000.00	1.38
23	000001	平安银行	1,698,881	38,428,688.22	1.35
24	002960	青鸟消防	1,388,152	36,314,056.32	1.28
25	002555	三七互娱	1,500,000	36,030,000.00	1.27
26	002398	垒知集团	4,951,215	35,302,162.95	1.24
27	300115	长盈精密	1,686,428	34,740,416.80	1.22
28	002390	信邦制药	3,293,151	34,512,222.48	1.21
29	600460	士兰微	600,000	33,810,000.00	1.19
30	300223	北京君正	300,000	30,276,000.00	1.07
31	000538	云南白药	261,406	30,249,902.32	1.06
32	002064	华峰化学	2,302,026	29,627,074.62	1.04
33	000895	双汇发展	881,305	28,025,499.00	0.99
34	603989	艾华集团	841,451	27,422,888.09	0.97
35	600398	海澜之家	3,417,306	24,741,295.44	0.87
36	300271	华宇软件	1,275,930	24,561,652.50	0.86
37	600309	万华化学	224,900	24,473,618.00	0.86
38	600893	航发动力	450,000	23,935,500.00	0.84
39	002405	四维图新	1,600,000	22,512,000.00	0.79
40	601012	隆基股份	237,020	21,056,856.80	0.74
41	603128	华贸物流	1,400,000	19,726,000.00	0.69
42	002050	三花智控	750,000	17,985,000.00	0.63
43	601865	福莱特	400,000	15,812,000.00	0.56
44	002460	赣锋锂业	124,982	15,134,070.38	0.53
45	603515	欧普照明	517,140	13,274,983.80	0.47
46	002241	歌尔股份	300,000	12,822,000.00	0.45
47	688006	杭可科技	150,000	12,750,000.00	0.45
48	300207	欣旺达	383,325	12,481,062.00	0.44

49	002466	天齐锂业	200,017	12,405,054.34	0.44
50	603579	荣泰健康	280,200	11,510,616.00	0.41
51	002036	联创电子	799,960	10,519,474.00	0.37
52	300892	品渥食品	199,898	9,171,320.24	0.32
53	603076	乐惠国际	168,000	8,929,200.00	0.31
54	603187	海容冷链	194,876	8,356,282.88	0.29
55	002254	泰和新材	387,571	7,856,064.17	0.28
56	300327	中颖电子	72,900	6,213,267.00	0.22
57	000785	居然之家	894,961	5,432,413.27	0.19
58	600873	梅花生物	272,600	1,526,560.00	0.05
59	300785	值得买	13,727	1,304,065.00	0.05
60	688686	奥普特	2,330	1,050,830.00	0.04
61	688083	中望软件	1,837	1,014,575.10	0.04
62	688131	皓元医药	1,955	676,801.45	0.02
63	605288	凯迪股份	4,200	438,816.00	0.02
64	688690	纳微科技	3,477	408,547.50	0.01
65	688626	翔宇医疗	3,652	380,392.32	0.01
66	688276	百克生物	3,486	364,565.88	0.01
67	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.01
68	688076	诺泰生物	4,984	241,973.20	0.01
69	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.01
70	301002	崧盛股份	2,001	159,001.62	0.01
71	688510	航亚科技	5,991	157,563.30	0.01
72	688315	诺禾致源	3,711	145,471.20	0.01
73	300888	稳健医疗	1,000	123,620.00	0.00
74	688689	银河微电	3,258	116,049.96	0.00
75	002938	鹏鼎控股	2,942	105,558.96	0.00
76	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.00
77	301004	嘉益股份	3,115	90,654.98	0.00
78	688314	康拓医疗	1,085	80,810.80	0.00
79	688217	睿昂基因	1,040	60,736.00	0.00
80	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
81	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
82	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
83	300894	火星人	628	42,704.00	0.00
84	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
85	688395	正弦电气	1,627	36,395.99	0.00
86	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
87	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
88	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
89	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
90	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00

91	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
92	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
93	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
94	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
95	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
96	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
97	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
98	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
99	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
100	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
101	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
102	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
103	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
104	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
105	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
106	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
107	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
108	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
109	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
110	600031	三一重工	300	8,721.00	0.00
111	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
112	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
113	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
114	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
115	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
116	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
117	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
118	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
119	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
120	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
121	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
122	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
123	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
124	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
125	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
126	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
127	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
128	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
129	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
130	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
131	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
132	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00

133	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
134	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
135	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	600703	三安光电	120,302,643.57	3.55
2	600460	士兰微	116,756,306.74	3.44
3	601899	紫金矿业	94,368,519.97	2.78
4	300253	卫宁健康	79,182,085.54	2.34
5	002960	青鸟消防	72,042,052.98	2.13
6	600754	锦江酒店	70,174,213.18	2.07
7	000001	平安银行	67,681,224.78	2.00
8	300316	晶盛机电	63,534,370.87	1.87
9	002920	德赛西威	62,246,933.08	1.84
10	600315	上海家化	50,234,561.80	1.48
11	603799	华友钴业	46,589,918.48	1.37
12	002466	天齐锂业	43,389,862.38	1.28
13	002371	北方华创	42,855,274.80	1.26
14	002555	三七互娱	40,992,178.00	1.21
15	300662	科锐国际	40,418,717.19	1.19
16	002182	云海金属	39,700,676.00	1.17
17	000807	云铝股份	38,990,656.66	1.15
18	002938	鹏鼎控股	37,682,142.40	1.11
19	603989	艾华集团	32,655,769.31	0.96
20	002475	立讯精密	31,649,599.83	0.93

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	600460	士兰微	149,473,769.32	4.41
2	603486	科沃斯	129,536,860.17	3.82
3	601318	中国平安	125,812,678.08	3.71
4	002600	领益智造	116,007,987.80	3.42
5	600660	福耀玻璃	102,861,578.49	3.03
6	002064	华峰化学	101,576,689.64	3.00
7	600754	锦江酒店	83,554,140.30	2.47
8	000895	双汇发展	79,750,466.78	2.35
9	002594	比亚迪	77,395,445.65	2.28

10	000333	美的集团	72,425,741.38	2.14
11	603816	顾家家居	63,141,488.75	1.86
12	000501	鄂武商 A	62,962,006.81	1.86
13	002398	垒知集团	57,493,064.14	1.70
14	600309	万华化学	49,260,343.34	1.45
15	600398	海澜之家	48,371,412.95	1.43
16	600031	三一重工	44,010,241.00	1.30
17	688036	传音控股	42,819,549.74	1.26
18	002415	海康威视	40,996,372.52	1.21
19	002466	天齐锂业	37,890,166.00	1.12
20	600690	海尔智家	37,812,553.00	1.12

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,893,798,409.16
卖出股票收入（成交）总额	2,598,856,692.12

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	119,693,000.00	4.21
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）	349,392,618.11	12.30
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	469,085,618.11	16.51

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

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	019640	20 国债 10	996,310	99,631,000.00	3.51
2	110045	海澜转债	528,690	59,017,664.70	2.08
3	113606	荣泰转债	283,670	35,515,484.00	1.25
4	110072	广汇转债	366,490	33,618,127.70	1.18

5	113563	柳药转债	271,510	29,114,017.30	1.02
---	--------	------	---------	---------------	------

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 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	818,143.31
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	3,272,555.06
5	应收申购款	1,728,474.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,819,173.36

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110045	海澜转债	59,017,664.70	2.08
2	113606	荣泰转债	35,515,484.00	1.25
3	110072	广汇转债	33,618,127.70	1.18
4	113563	柳药转债	29,114,017.30	1.02
5	113579	健友转债	28,080,452.40	0.99
6	113578	全筑转债	26,353,655.60	0.93
7	113044	大秦转债	24,525,511.20	0.86
8	110051	中天转债	22,120,851.20	0.78
9	123081	精研转债	13,950,204.84	0.49
10	110075	南航转债	13,517,900.00	0.48
11	128032	双环转债	12,538,400.00	0.44
12	113011	光大转债	9,720,278.00	0.34
13	113014	林洋转债	9,105,600.00	0.32
14	128135	洽洽转债	6,852,000.00	0.24
15	127024	盈峰转债	2,306,909.70	0.08

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600754	锦江酒店	36,780,283.28	1.29	非公开发行流通受限
2	002182	云海金属	35,689,500.00	1.26	大宗交易购入流通受限

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
295,036	2,246.92	44,104,281.90	6.65	618,816,948.18	93.35

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	3,186,954.15	0.4807

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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2009 年 3 月 25 日) 基金份额总额	1,980,254,871.35
本报告期期初基金份额总额	839,341,884.31
本报告期基金总申购份额	96,550,510.45
减：本报告期基金总赎回份额	272,971,164.68
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	662,921,230.08

注：总申购份额含红利再投资、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 报告期内基金管理人无重大人事变动。

(2) 报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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	
东方财富证券	2	1,051,783,879.03	23.95%	453,958.95	15.49%	-
申万宏源证券	1	828,835,157.02	18.88%	606,129.97	20.68%	-
华泰证券	1	790,995,717.67	18.01%	578,669.72	19.74%	-
中泰证券	1	427,171,078.84	9.73%	312,390.94	10.66%	-
湘财证券	2	367,430,202.68	8.37%	342,187.04	11.68%	-
东吴证券	1	309,111,208.60	7.04%	195,143.50	6.66%	-
信达证券	1	169,695,430.34	3.86%	124,100.58	4.23%	-
长江证券	1	165,694,029.08	3.77%	121,172.04	4.13%	-
国信证券	2	142,232,347.64	3.24%	89,790.99	3.06%	-
海通证券	1	108,025,865.05	2.46%	79,000.31	2.70%	-
招商证券	1	29,942,100.00	0.68%	28,322.53	0.97%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-

渤海证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
第一创业 证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	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。

10.7.2 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
东方财富证券	410,852,118.58	54.00%	-	-	-	-
申万宏源证券	26,601,053.63	3.50%	-	-	-	-
华泰证券	176,883,538.90	23.25%	-	-	-	-
中泰证券	44,315,120.00	5.82%	-	-	-	-
湘财证券	7,216,340.52	0.95%	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	42,590,457.20	5.60%	-	-	-	-
长江证券	52,407,098.07	6.89%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
第一创业 证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

华融证券	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于旗下部分基金投资范围增加存托凭证并修改基金合同和托管协议的公告	证券时报、指定互联网网站	2021-02-09
2	关于调整旗下基金在湘财证券费率优惠活动的公告	证券时报、指定互联网网站	2021-02-10
3	关于旗下部分基金投资四维图新(002405)非公开发行股票的公告	证券时报、指定互联网网站	2021-02-25
4	关于增加中原证券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	2021-03-05
5	关于旗下部分基金投资锦江酒店(600754)非公开发行股票的公告	证券时报、指定互联网网站	2021-03-25
6	关于增加阳光人寿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	2021-04-01
7	关于增加北京新浪仓石基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、指定互联网网站	2021-06-16
8	关于增加泛华普益基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、指定互联网网站	2021-06-17
9	关于调整网上直销基金转换、赎回申购、汇款交易优惠费率的公告	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

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、 中国证监会批准本基金设立的文件
- 2、 《兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、 《兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 4、 《兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书》
- 5、 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 6、 本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站（<http://www.xqfunds.com>）查阅，或在营业时间内至基金管理人、基金托管人办公场所免费查阅。

基金管理人客户服务电话：400-678-0099，021-38824536。

兴证全球基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日