

# 兴全社会价值三年持有期混合型证券投资 基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：兴证全球基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 03 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。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况</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 .....	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况 .....	9
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	11
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 .....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	13
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明 .....	13
4.10 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 .....	13
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	14
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>14</b>
6.1 审计报告基本信息 .....	14
6.2 审计报告的基本内容 .....	14
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>16</b>
7.1 资产负债表 .....	16
7.2 利润表 .....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	19
7.4 报表附注 .....	20
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>55</b>

8.1 期末基金资产组合情况 .....	55
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	55
8.3 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 .....	56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	60
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	61
8.6 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 .....	61
8.7 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 .....	62
8.8 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 .....	62
8.9 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 .....	62
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	62
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	62
8.12 投资组合报告附注 .....	62
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>63</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	63
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	64
9.3 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 .....	64
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>64</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>64</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	64
11.2 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 .....	64
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	64
11.4 基金投资策略的改变 .....	64
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	65
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	65
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	65
11.8 其他重大事件 .....	68
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>68</b>
12.1 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 .....	68
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	69
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>69</b>
13.1 备查文件目录 .....	69
13.2 存放地点 .....	70
13.3 查阅方式 .....	70

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

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

注：本基金每份基金份额最短持有期为三年；本基金为逐笔计提业绩报酬的基金。

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		兴证全球基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨卫东	张燕
	联系电话	021-20398888	0755-83199084
	电子邮箱	yangwd@xqfunds.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4006780099, 021-38824536	95555
传真		021-20398858	0755-83195201
注册地址		上海市黄浦区金陵东路368号	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		上海市浦东新区芳甸路1155号嘉里城办公楼28-30楼	深圳市深南大道7088号招商银行大厦

邮政编码	201204	518040
法定代表人	杨华辉	缪建民

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.xqfunds.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市延安东路 222 号 30 楼
注册登记机构	兴证全球基金管理有限公司	上海市浦东新区芳甸路 1155 号浦东嘉里城办公楼 28-30 楼

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2021 年	2020 年	2019 年 12 月 26 日（基金合同生效日）-2019 年 12 月 31 日
本期已实现收益	1,074,267,130.44	1,239,796,642.41	-1,025,423.79
本期利润	147,038,389.26	2,330,410,593.22	7,281,824.02
加权平均基金份额本期利润	0.0495	0.7850	0.0025
本期加权平均净值利润率	2.66%	60.28%	0.25%
本期基金份额净值增长率	2.77%	78.30%	0.25%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	2,313,038,349.06	1,238,771,218.62	-1,025,423.79
期末可供分配基金份额利润	0.7792	0.4173	-0.0003
期末基金资产净值	5,453,327,910.37	5,306,289,521.11	2,975,878,927.89

期末基金份额净值	1.8370	1.7875	1.0025
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	83.70%	78.75%	0.25%

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	5.28%	0.97%	-0.27%	0.60%	5.55%	0.37%
过去六个月	-6.67%	1.09%	-7.13%	0.81%	0.46%	0.28%
过去一年	2.77%	1.16%	-5.79%	0.87%	8.56%	0.29%
自基金合同生效起至今	83.70%	1.39%	9.32%	0.98%	74.38%	0.41%

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

股市场总体发展趋势，适合作为本基金境内股票投资业绩比较基准。

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

中债综合（全价）指数由中央国债登记结算有限公司编制，旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况，是具有代表性的债券市场指数，适合作为本基金债券投资业绩的比较基准。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，按下列公式计算：

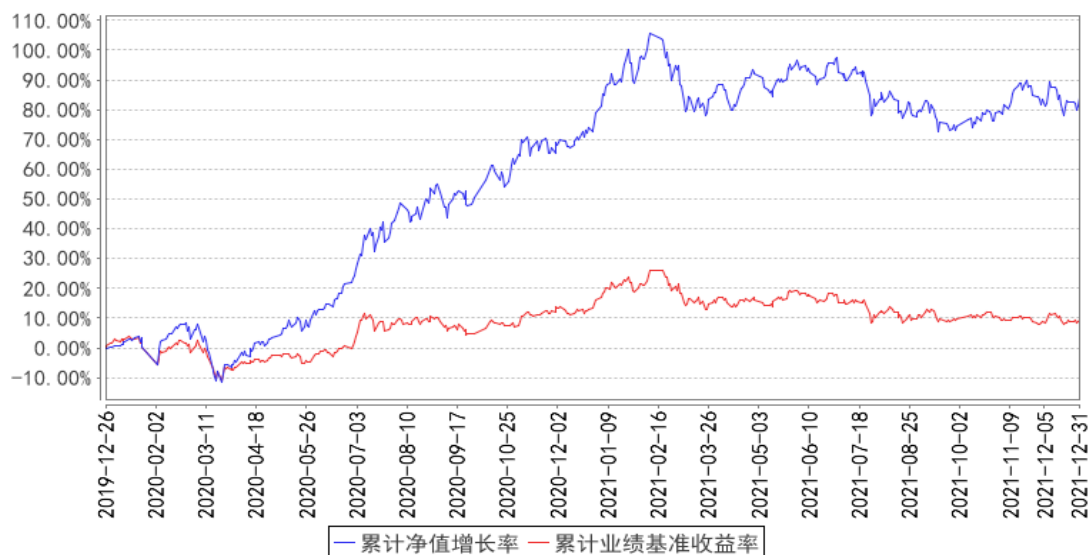
$$\text{Return}_t = 60\% \times (\text{沪深 300 指数收益率}_t / \text{沪深 300 指数收益率}_{t-1} - 1) + 20\% \times (\text{恒生指数收益率}_t / \text{恒生指数收益率}_{t-1} - 1) + 20\% \times (\text{中债综合（全价）指数收益率}_t / \text{中债综合（全价）指数收益率}_{t-1} - 1)$$

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

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

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

兴全社会价值三年持有混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



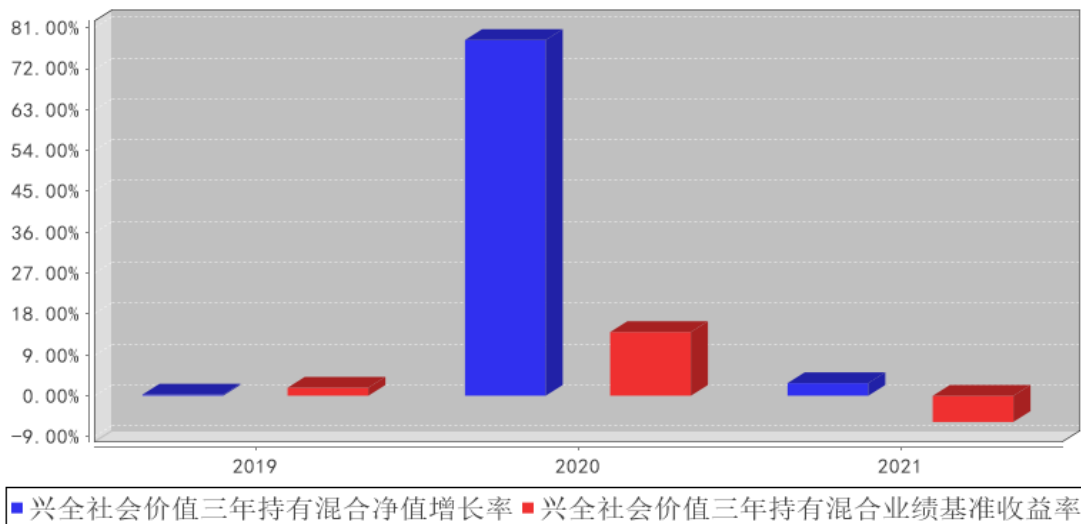
注：1、净值表现所取数据截至到 2021 年 12 月 31 日。

2、按照《兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金合同》的规定，本基金建仓期为 2019 年 12 月 26 日至 2020 年 6 月 25 日，建仓期结束时，本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制和投资组合的比例范围。



### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴全社会价值三年持有混合基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：2019 年数据统计期间为 2019 年 12 月 26 日至 2019 年 12 月 31 日，数据按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 其他指标

注：无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

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 12 月 31 日，公司旗下已管理兴全可转债混合型证券投资基金等共 47 只基金，包括股票型、混合型、债券型、货币型、指数型、FOF 等类型。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
谢治宇	总经理助理、基金管理部投资总监，兴全合润混合型证券投资基金、兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金、兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理	2019 年 12 月 26 日	-	14 年	硕士，2007 年加入兴证全球基金管理有限公司，历任行业研究员、专户投资部投资经理、基金管理部投资副总监、兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理。

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

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

3、证券从业的涵义遵从行业的相关规定，包括资管相关行业从业经历。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全社会价

值三年持有期混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

#### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 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 A 股市场上证指数上涨 4.80%，相比 2019 年、2020 年的 22.30%、13.87% 涨幅收窄；创业板走势与上证走势趋同；恒生指数全年下跌 14.08%。

年初以来，国内疫情依然控制良好，上半年国民经济持续回升；进入下半年，房地产等部门压力较大，但制造业等部门仍有较好增长。

在此背景下，21 年 A 股板块间和板块内部出现分化。以新能源车、光伏与半导体等板块为代表的科技成长股部分公司表现较好；医药、消费的核心资产股价经历 2 年大幅度上涨后出现震荡；下半年以电力为代表的能源供应有阶段性瓶颈，绿电板块强势；煤炭、钢铁、有色板块股价随政策波动有起伏。报告期内，本基金整体维持了较高仓位，在个股选择上广泛布局了从半导体、新

能源、互联网、化工、家电等各行业具备核心竞争力的公司，平衡好公司短期估值与长期价值，不断寻找具有良好投资性价比的优秀公司。

#### 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 1.8370 元；本报告期基金份额净值增长率为 2.77%，业绩比较基准收益率为-5.79%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022 年国外疫情管控政策逐步放开，后续仍需观察奥密克戎变种对国内的影响。经过两年货币政策持续宽松，美国 CPI 在 2021 年 4 季度达到 30 年间较高水平，美国加息和缩表预期逐渐强烈，对全球经济影响需持续观察。

中央政府对全年 GDP 增速目标定在 5.5%，力图保持平稳健康的经济环境。近年中国企业产品力、竞争能力逐渐增强，产业链地位不断提升，优秀公司具有良好的长期投资价值。22 年我们将继续精选个股、挖掘公司长期成长价值，努力平衡好公司的长期发展空间与短期估值，不断寻找具有良好投资性价比的优秀公司。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人通过以下工作的开展，有力地保证了本基金整体运作的合法合规，从而最大程度地保护了基金份额持有人和其他相关当事人的合法权益：

1、实时风险监控：通过风控系统对本基金的运作进行实时监控，每日撰写监控日志，在此基础上每周撰写信息周报，对本基金遵守风控指标的情况进行汇总、分析和提示。

2、加强事后人工分析，并定期撰写风险管理报告。除系统控制外，公司风险管理部还对一些无法嵌入系统的风控指标进行了事后人工计算分析和复核，并同样反映在监控日志和信息周报中。此外，在每个季度结束之后，公司风险管理部会对基金的流动性进行压力测试并出具书面报告，对旗下每只基金进行全面的风险评价并形成风险分析报告，并提交公司领导和基金经理审阅。

3、进一步加强对公平交易的监控。根据监管部门的要求以及公司公平交易相关工作的不断深入开展，公司进一步明确了公平交易执行和分析中的具体标准，将公平交易问题分为交易的公平和投资策略的公平，主要包括：（1）明确交易部的分单规则及其识别异常下单行为的职责，保证交易的公平；（2）通过 T 检验、模拟利益输送金额、具体可疑交易分析等方法，对以往的下单及交易记录进行分析，保证投资策略的公平。

4、季度监察稽核和专项稽核：根据中国证监会《关于基金管理公司报送监察稽核报告的通知》以及《证券投资基金管理有限公司监察稽核报告内容与格式指引（试行）》等规定，认真做好公司各季度监察稽核工作。对照中国证监会的季度监察稽核项目表，对本基金的守法合规情况进行逐

条检视。此外，在公司审计部对投研部门展开的专项稽核中，也会对本基金的业务进行全面检查。

#### 4.7 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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，本报告期内，本基金未实施利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

-

#### 4.10 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基金份额持有人数不满两百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

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

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，

并根据监管要求履行报告义务。

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

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

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

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(22)第 P01793 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	兴证全球基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括兴全社会价值三年持有

	<p>期混合型证券投资基金 2021 年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当</p>

	性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金不能持续经营。	
	(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	吴凌志	冯适
会计师事务所的地址	上海市延安东路 222 号 30 楼	
审计报告日期	2022 年 3 月 29 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	326,543,207.96	641,399,934.95
结算备付金		2,042,978.03	6,502,322.88
存出保证金		586,497.34	1,414,779.38
交易性金融资产	7.4.7.2	5,148,284,619.71	4,713,246,399.25
其中：股票投资		5,130,310,488.91	4,692,259,673.15
基金投资		-	-
债券投资		17,974,130.80	20,986,726.10
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		10,659,111.28	-
应收利息	7.4.7.5	46,810.54	69,721.45
应收股利		-	-
应收申购款		-	-



递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		5,488,163,224.86	5,362,633,157.91
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年12月31日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		28,408,369.21	49,517,816.30
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,698,786.13	3,423,258.52
应付托管费		1,155,870.66	1,069,768.27
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,397,135.38	2,157,714.68
应交税费		153.11	79.03
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	175,000.00	175,000.00
负债合计		34,835,314.49	56,343,636.80
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	2,968,597,103.87	2,968,597,103.87
未分配利润	7.4.7.10	2,484,730,806.50	2,337,692,417.24
所有者权益合计		5,453,327,910.37	5,306,289,521.11
负债和所有者权益总计		5,488,163,224.86	5,362,633,157.91

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额总额 2,968,597,103.87 份，基金份额净值(暂估业绩报酬前)1.8370 元，基金资产净值 5,453,327,910.37 元(暂估业绩报酬前)。暂估业绩报酬金额 400,646,745.02 元，基金资产净值(暂估业绩报酬后)5,052,681,165.35 元。其中，暂估业绩报酬为假设本基金于本报告期末按照当日的基金份额净值(计提业绩报酬前)清算，根据基金份额持有人持有的基金份额(包括未到期份额)至该日止持有期间的收益情况估算的业绩报酬，与最终计提的业绩报酬可能存在差异。

## 7.2 利润表

会计主体：兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		223,705,631.11	2,387,389,649.49
1. 利息收入		2,256,850.66	4,135,962.09
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,223,713.63	1,598,252.32
债券利息收入		33,137.03	2,537,709.77
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,148,677,521.63	1,292,639,736.59
其中：股票投资收益	7.4.7.12	1,101,605,865.28	1,255,402,954.76
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	606,404.08	3,781,317.15
资产支持证券投资	7.4.7.13.5	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	46,465,252.27	33,455,464.68
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-927,228,741.18	1,090,613,950.81
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	-
减：二、费用		76,667,241.85	56,979,056.27
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	44,251,556.33	30,714,602.13
2. 托管费	7.4.10.2.2	13,828,611.33	9,598,313.19
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	18,349,878.53	16,444,246.02
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		116.55	35.32
7. 其他费用	7.4.7.20	237,079.11	221,859.61
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		147,038,389.26	2,330,410,593.22
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		147,038,389.26	2,330,410,593.22

## 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,968,597,103.87	2,337,692,417.24	5,306,289,521.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	147,038,389.26	147,038,389.26
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	2,968,597,103.87	2,484,730,806.50	5,453,327,910.37
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,968,597,103.87	7,281,824.02	2,975,878,927.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本	-	2,330,410,593.22	2,330,410,593.22

期利润)			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-
其中: 1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	2,968,597,103.87	2,337,692,417.24	5,306,289,521.11

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人兴证全球基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]2332号文《关于核准兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金募集的批复》核准予以公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为2,968,597,103.87份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(19)第00614号验资报告。基金合同于2019年12月26日正式生效。本基金的管理人为兴证全球基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票及存托凭证(包括中小板、创业板、科创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)、沪港股

票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票、深港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票、债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、可交换债券、央行票据、中期票据、证券公司发行的短期债券、短期融资券、超短期融资券等)、债券回购、货币市场工具、银行存款、同业存单、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

本基金的业绩比较基准为：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%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

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

本基金系在持续经营假设的基础上编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

###### (1) 金融资产的分类

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

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

###### (2) 金融负债的分类

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

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

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

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

##### (1) 股票投资

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

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

##### (2) 债券投资

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

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

卖出债券于交易日确认债券投资收益；卖出债券的成本按移动加权平均法结转。

### (3) 回购协议

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

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

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

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以

相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

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

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

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

(7) 衍生工具收益/(损失)于卖出成交日确认，并按卖出成交金额与其成本的差额入账。

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

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、



交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金固定管理费按前一日基金资产净值的 0.80%的年费率逐日计提；

(2) 基金业绩报酬在结算日按照每笔基金份额分别计算，对符合业绩报酬计提条件的基金份额逐笔计提业绩报酬。其中，结算日指投资者赎回申请日和本基金终止且财产最终清算日。

业绩报酬的计提基准：以本基金每笔份额业绩报酬计算期间的投资年化收益率(采用简单算术平均法计算)高于 8%的部分为基准进行计提，计提比例为 20%。

(3) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率逐日计提；

(4) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)在回购期内逐日计提；

(5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金每年收益分配不超过 1 次；

(2) 本基金收益分配方式分为现金分红；

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

(4) 本基金每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 7.4.4.12 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。

#### 7.4.4.13 分部报告

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

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股

票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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

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

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

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无重大会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无重大会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无重大会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的

通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。对基金通过港股通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(4) 对于基金从事A股买卖，出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。对于基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
活期存款	326,543,207.96	641,399,934.95
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	326,543,207.96	641,399,934.95

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	4,959,101,130.22	5,130,310,488.91	171,209,358.69
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	17,491,032.05	17,974,130.80
	银行间市场	-	-
	合计	17,491,032.05	17,974,130.80
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	4,976,592,162.27	5,148,284,619.71	171,692,457.44
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,594,163,168.58	4,692,259,673.15	1,098,096,504.57
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	20,162,032.05	20,986,726.10
	银行间市场	-	-
	合计	20,162,032.05	20,986,726.10
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	3,614,325,200.63	4,713,246,399.25	1,098,921,198.62

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均无买入返售金融资产。

## 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未通过买断式逆回购交易取得债券。

## 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	31,830.33	58,039.43
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	4,663.70	5,213.59
应收债券利息	9,552.52	4,913.00
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	763.99	1,555.43
合计	46,810.54	69,721.45

## 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

## 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	1,397,135.38	2,157,714.68
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	1,397,135.38	2,157,714.68

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提审计费用	55,000.00	55,000.00
预提信息披露费	120,000.00	120,000.00
合计	175,000.00	175,000.00

## 7.4.7.9 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 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	2,968,597,103.87	2,968,597,103.87
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	2,968,597,103.87	2,968,597,103.87

注：根据《兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金招募说明书》及《关于兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金暂不接受申购申请的公告》的相关规定，本基金每份基金份额设定最短持有期 3 年，对于每份基金份额，在其最短持有期到期日(不含该日)前，基金份额持有人不能提出赎回申请；在最短持有期到期日(含该日)后，基金份额持有人可提出赎回申请；本基金进入开放期后暂不接受投资人的申购(含定期定额投资、转换转入)申请。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,238,771,218.62	1,098,921,198.62	2,337,692,417.24
本期利润	1,074,267,130.44	-927,228,741.18	147,038,389.26
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,313,038,349.06	171,692,457.44	2,484,730,806.50

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	1,954,965.80	1,316,453.31
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	239,054.59	260,876.20
其他	29,693.24	20,922.81
合计	2,223,713.63	1,598,252.32

## 7.4.7.12 股票投资收益

## 7.4.7.12.1 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12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12 月31日
股票投资收益——买卖 股票差价收入	1,101,605,865.28	1,255,402,954.76
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	1,101,605,865.28	1,255,402,954.76

## 7.4.7.12.2 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12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12 月31日
卖出股票成交总额	5,983,711,072.14	5,117,269,708.30
减：卖出股票成本 总额	4,882,105,206.86	3,861,866,753.54
买卖股票差价收入	1,101,605,865.28	1,255,402,954.76

## 7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

## 7.4.7.13 债券投资收益

## 7.4.7.13.1 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12月31 日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31 日
债券投资收益——买卖	606,404.08	3,781,317.15

债券(、债转股及债券到期兑付) 差价收入		
债券投资收益——赎回差价收入		-
债券投资收益——申购差价收入		-
合计	606,404.08	3,781,317.15

#### 7.4.7.13.2 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付) 成交总额	4,151,221.20	172,345,546.87
减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付) 成本总额	3,543,000.00	163,281,957.90
减：应收利息总额	1,817.12	5,282,271.82
买卖债券差价收入	606,404.08	3,781,317.15

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内均无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内均无贵金属投资收益。



## 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

## 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

## 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

## 7.4.7.15 衍生工具收益

## 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内均无衍生工具收益。

## 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

## 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	46,465,252.27	33,455,464.68
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	46,465,252.27	33,455,464.68

## 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	-927,228,741.18	1,090,613,950.81
股票投资	-926,887,145.88	1,089,789,256.76
债券投资	-341,595.30	824,694.05
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	-927,228,741.18	1,090,613,950.81

#### 7.4.7.18 其他收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内均无其他收入。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	18,349,878.53	16,444,246.02
银行间市场交易费用	-	-
合计	18,349,878.53	16,444,246.02

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	55,000.00	55,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
其他费用	-	400.00
银行费用	44,079.11	35,959.61
账户维护费用	18,000.00	10,500.00
合计	237,079.11	221,859.61

#### 7.4.7.21 分部报告

无。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
兴证全球基金管理有限公司(以下简称“兴证全球基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)	基金托管人、基金销售机构
兴业证券股份有限公司(以下简称“兴业证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
全球人寿保险国际公司(AEGON International B.V)	基金管理人的股东
兴证全球资本管理(上海)有限公司	基金管理人控制的公司

注：下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例(%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例(%)
兴业证券	1,967,377,020.00	16.41	1,655,843,083.18	14.57

##### 7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内均未通过关联方交易单元进行债券交易。

##### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

##### 7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内均未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日

	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
兴业证券	1,866,733.37	21.98	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
兴业证券	1,571,105.60	19.04	540,151.79	25.03

注：基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供研究成果和市场信息等证券综合服务，并不收取额外对价。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年 12月31日	2020年1月1日至2020 年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	44,251,556.33	30,714,602.13
其中：支付销售机构的客户维护 费	19,490,453.78	16,671,375.96

注：1、基金固定管理费按前一日的基金资产净值的0.80%的年费率计提。计算方法如下：每日应支付的基金管理费=前一日的基金资产净值×0.80%/当年天数。

2、本基金在业绩报酬结算日按照每笔基金份额分别计算业绩报酬，并对符合业绩报酬计提条件的基金份额逐笔计提业绩报酬。其中，业绩报酬结算日指投资者赎回申请日和本基金终止且财产最终清算日。本基金本期及上年度可比期间未发生达到支付条件的业绩报酬，未达到支付条件的暂估业绩报酬不计入当期损益。

投资者赎回申请日的业绩报酬结算日称为“赎回的业绩报酬结算日”，本基金终止且财产最终清算日的业绩报酬结算日称为“终止的业绩报酬结算日”。业绩报酬的计提基准：以本基金每笔份额业绩报酬计算期间的投资年化收益率（采用简单算术平均法计算）高于8%的部分为基准进行计提，计提比例为20%。结算日是计算业绩报酬采用的净值日，提取日是结算日的下一工作日。

本基金逐笔计提业绩报酬，业绩报酬的计算方式如下：

1) 赎回的业绩报酬结算日的业绩报酬计算方式：

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

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

$S_i$  为赎回的业绩报酬结算日投资者申请赎回的每笔份额数量

NAV0 为赎回的业绩报酬结算日投资者申请赎回的每笔份额基金合同生效日或基金份额申购申请日的基金份额净值

ANAV0 为赎回的业绩报酬结算日投资者申请赎回的每笔份额基金合同生效日或基金份额申购申请日的基金份额累计净值

ANAV1 为赎回的业绩报酬结算日的基金份额累计净值

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

2) 终止的业绩报酬结算日的业绩报酬计算方式:

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

每笔业绩报酬 =  $\text{MAX}(S_i \times \text{NAV0} \times [(\text{ANAV1} - \text{ANAV0}) / \text{NAV0} - 8\% \times T / 365] \times 20\%, 0)$

$S_i$  为终止的业绩报酬结算日投资者持有的每笔份额数量

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

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

ANAV1 为终止的业绩报酬结算日的基金份额累计净值

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

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	13,828,611.33	9,598,313.19

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。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
基金合同生效日（2019年12月26日）持有的基金份额	17,495,867.97	17,495,867.97
报告期初持有的基金份额	17,495,867.97	17,495,867.97
报告期间申购/买入总份额	0.00	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	17,495,867.97	17,495,867.97
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.5894%	0.5894%

注：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。

##### 7.4.10.5.2 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期末及上年度末均未持有本基金。

#### 7.4.10.6 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12月 31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	326,543,207.96	1,954,965.80	641,399,934.95	1,316,453.31

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间内均无其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内无利润分配的情况。

#### 7.4.12 期末(2021年12月31日)本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
001234	泰慕士	2021年12月31日	2022年1月11日	新股流通受限	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
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	10.20	3,683,241	19,999,998.63	37,569,058.20	注2
002851	麦格米特	2021年12月21日	2022年6月21日	大宗交易购入流通受限	30.27	30.15	140,000	4,237,800.00	4,221,000.00	-
002938	鹏鼎控股	2021年12月23日	2022年6月23日	大宗交易购入流通受限	40.00	39.65	350,000	14,000,000.00	13,877,500.00	-
300413	芒果超媒	2021年8月	2022年2月	非公开发行	49.81	54.34	426,807	21,259,256.67	23,192,692.38	-

		月 19 日	月 24 日	行流 通受 限						
300454	深信服	2021 年 12 月 6 日	2022 年 6 月 6 日	大宗 交易 购入 流通 受限	186.10	179.77	60,000	11,166,000.00	10,786,200.00	-
300768	迪普科技	2021 年 9 月 27 日	2022 年 3 月 29 日	非公 开发 行流 通受 限	34.71	39.84	302,833	10,511,333.43	12,064,866.72	-
300774	倍杰特	2021 年 7 月 26 日	2022 年 02 月 16 日	新股 流通 受限	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
300814	中富电路	2021 年 8 月 4 日	2022 年 2 月 14 日	新股 流通 受限	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
300850	新强联	2021 年 8 月 19 日	2022 年 2 月 24 日	非公 开发 行流 通受 限	106.21	171.21	282,459	29,999,970.39	48,359,805.39	-
300870	欧陆通	2021 年 9 月 15 日	2022 年 3 月 15 日	大宗 交易 购入 流通 受限	58.64	79.49	350,000	20,524,000.00	27,821,500.00	-
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	23.80	555	4,917.30	13,209.00	-
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	30.44	421	4,479.44	12,815.24	-
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	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301025	读客	2021	2022	新股	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-



	文化	年 7 月 6 日	年 01 月 24 日	流通受限						
301026	浩通科技	2021 年 7 月 8 日	2022 年 1 月 17 日	新股流通受限	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-
301027	华蓝集团	2021 年 7 月 8 日	2022 年 01 月 19 日	新股流通受限	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301028	东亚机械	2021 年 7 月 12 日	2022 年 1 月 20 日	新股流通受限	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
301029	怡合达	2021 年 7 月 14 日	2022 年 1 月 24 日	新股流通受限	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-
301030	仕净科技	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 24 日	新股流通受限	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301032	新柴股份	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 24 日	新股流通受限	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301033	迈普医学	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 26 日	新股流通受限	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301036	双乐股份	2021 年 7 月 21 日	2022 年 02 月 16 日	新股流通受限	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301037	保立佳	2021 年 7 月 21 日	2022 年 2 月 7 日	新股流通受限	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301038	深水规院	2021 年 7 月 22 日	2022 年 2 月 7 日	新股流通受限	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301039	中集	2021	2022	新股	6.96	12.51	2,064	14,365.44	25,820.64	-

	车辆	年 7 月 1 日	年 1 月 10 日	流通 受限						
301040	中环 海陆	2021 年 7 月 26 日	2022 年 2 月 7 日	新股 流通 受限	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301041	金百 泽	2021 年 8 月 2 日	2022 年 2 月 11 日	新股 流通 受限	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301046	能辉 科技	2021 年 8 月 10 日	2022 年 2 月 17 日	新股 流通 受限	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301048	金鹰 重工	2021 年 8 月 11 日	2022 年 02 月 28 日	新股 流通 受限	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301049	超越 科技	2021 年 8 月 17 日	2022 年 2 月 24 日	新股 流通 受限	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301050	雷电 微力	2021 年 8 月 17 日	2022 年 2 月 24 日	新股 流通 受限	60.64	234.74	233	14,129.12	54,694.42	-
301052	果麦 文化	2021 年 8 月 23 日	2022 年 02 月 28 日	新股 流通 受限	8.11	33.64	252	2,043.72	8,477.28	-
301053	远信 工业	2021 年 8 月 25 日	2022 年 3 月 1 日	新股 流通 受限	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301057	汇隆 新材	2021 年 8 月 31 日	2022 年 3 月 9 日	新股 流通 受限	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301059	金三 江	2021 年 9 月 3 日	2022 年 3 月 14 日	新股 流通 受限	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301062	上海	2021	2022	新股	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-

	艾录	年 9 月 7 日	年 3 月 14 日	流通 受限						
301063	海锅 股份	2021 年 9 月 9 日	2022 年 3 月 24 日	新股 流通 受限	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
301072	中捷 精工	2021 年 9 月 22 日	2022 年 3 月 29 日	新股 流通 受限	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301078	孩子 王	2021 年 9 月 30 日	2022 年 4 月 14 日	新股 流通 受限	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301079	邵阳 液压	2021 年 10 月 11 日	2022 年 4 月 19 日	新股 流通 受限	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-
301081	严牌 股份	2021 年 10 月 13 日	2022 年 4 月 20 日	新股 流通 受限	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-
301083	百胜 智能	2021 年 10 月 13 日	2022 年 4 月 21 日	新股 流通 受限	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-
301092	争光 股份	2021 年 10 月 21 日	2022 年 5 月 5 日	新股 流通 受限	36.31	35.52	323	11,728.13	11,472.96	-
301093	华兰 股份	2021 年 10 月 21 日	2022 年 5 月 5 日	新股 流通 受限	58.08	49.85	409	23,754.72	20,388.65	-
301098	金埔 园林	2021 年 11 月 4 日	2022 年 5 月 12 日	新股 流通 受限	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	-
301138	华研 精机	2021 年 12 月 8 日	2022 年 6 月 15 日	新股 流通 受限	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10	-
301149	隆华	2021	2022	新股	10.07	16.76	1,214	12,224.98	20,346.64	-

	新材	年 11 月 3 日	年 5 月 10 日	流通受限							
301155	海力风电	2021 年 11 月 17 日	2022 年 5 月 24 日	新股流通受限	60.66	96.75	1,054	63,935.64	101,974.50	-	
301179	泽宇智能	2021 年 12 月 1 日	2022 年 6 月 8 日	新股流通受限	43.99	50.77	295	12,977.05	14,977.15	-	
301182	凯旺科技	2021 年 12 月 16 日	2022 年 6 月 23 日	新股流通受限	27.12	30.58	294	7,973.28	8,990.52	-	
301190	善水科技	2021 年 12 月 17 日	2022 年 6 月 24 日	新股流通受限	27.85	27.46	575	16,013.75	15,789.50	-	
301221	光庭信息	2021 年 12 月 15 日	2022 年 6 月 22 日	新股流通受限	69.89	88.72	280	19,569.20	24,841.60	-	
600745	闻泰科技	2021 年 8 月 20 日	2022 年 02 月 21 日	大宗交易购入流通受限	92.81	125.52	133,313	12,372,779.53	16,733,447.76	-	
600745	闻泰科技	2021 年 9 月 7 日	2022 年 3 月 7 日	大宗交易购入流通受限	104.62	124.87	50,000	5,231,000.00	6,243,500.00	-	
601728	中国电信	2021 年 8 月 11 日	2022 年 2 月 21 日	新股流通受限	4.53	4.27	394,011	1,784,869.83	1,682,426.97	-	
601966	玲珑轮胎	2021 年 7 月 2 日	2022 年 01 月 04 日	大宗交易购入流通受限	39.47	36.41	1,249,800	49,329,606.00	45,505,218.00	-	
603113	金能科技	2021 年 7 月	2022 年 01 月	大宗交易	16.40	15.98	654,200	10,728,880.00	10,454,116.00	-	

		月 16 日	月 17 日	购入 流通 受限						
603713	密尔克卫	2021 年 11 月 10 日	2022 年 5 月 10 日	大宗 交易 购入 流通 受限	99.65	127.11	27,900	2,780,235.00	3,546,369.00	-
603713	密尔克卫	2021 年 12 月 9 日	2022 年 6 月 9 日	大宗 交易 购入 流通 受限	116.01	125.99	33,500	3,886,335.00	4,220,665.00	-
603816	顾家家居	2021 年 12 月 21 日	2022 年 6 月 21 日	大宗 交易 购入 流通 受限	66.71	72.05	220,000	14,676,200.00	15,851,000.00	-
605376	博迁新材	2021 年 12 月 8 日	2022 年 6 月 8 日	大宗 交易 购入 流通 受限	71.18	77.87	70,000	4,982,600.00	5,450,900.00	-
605376	博迁新材	2021 年 12 月 9 日	2022 年 6 月 9 日	大宗 交易 购入 流通 受限	73.60	77.85	90,000	6,624,000.00	7,006,500.00	-
605376	博迁新材	2021 年 12 月 24 日	2022 年 06 月 24 日	大宗 交易 购入 流通 受限	82.60	77.67	250,000	20,650,000.00	19,417,500.00	-
605376	博迁新材	2021 年 12 月 28 日	2022 年 6 月 28 日	大宗 交易 购入 流通 受限	81.11	77.65	200,000	16,222,000.00	15,530,000.00	-
688071	华依科技	2021 年 7 月 21 日	2022 年 2 月 7 日	新股 流通 受限	13.73	62.31	1,101	15,116.73	68,603.31	-
688087	英科再生	2021 年 6	2022 年 1	新股 流通	21.96	93.40	2,469	54,219.24	230,604.60	-

		月 30 日	月 10 日	受限						
688110	东芯股份	2021年12月3日	2022年6月10日	新股流通受限	30.18	40.37	14,044	423,847.92	566,956.28	-
688187	时代电气	2021年8月30日	2022年3月7日	新股流通受限	31.38	76.65	33,865	1,062,683.70	2,595,752.25	-
688501	青达环保	2021年7月9日	2022年1月17日	新股流通受限	10.57	21.11	1,759	18,592.63	37,132.49	-
688701	卓锦股份	2021年9月8日	2022年3月16日	新股流通受限	7.48	13.50	2,340	17,503.20	31,590.00	-
688722	同益中	2021年10月8日	2022年4月19日	新股流通受限	4.51	10.19	3,687	16,628.37	37,570.53	-
688772	珠海冠宇	2021年9月30日	2022年4月15日	新股流通受限	14.43	39.09	12,960	187,012.80	506,606.40	-
688776	国光电气	2021年8月24日	2022年02月28日	新股流通受限	51.44	184.99	1,447	74,433.68	267,680.53	-

注：1、流通受限证券可流通日系本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。

2、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”。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有临时停牌等流通受限证券。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.4 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因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

##### 7.4.13.2 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。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 7.4.13.2.4 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 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	1,031,750.40	-
AAA 以下	16,942,380.40	20,986,726.10
未评级	-	-
合计	17,974,130.80	20,986,726.10

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

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 7.4.13.3 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在最短持有期到期后可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注 7.4.12 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。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金每份基金份额的最短持有期为 3 年。对于每份基金份额，最短持有期指基金合同生效日(对认购份额而言，下同)或基金份额申购确认日(对申购份额而言，下同)起(即最短持有期起始日)，至基金合同生效日或基金份额申购申请日起满 3 年(3 年指 365 天乘以 3 的自然天数，下同)后的下一工作日(即最短持有期到期日)。本基金每份基金份额在其最短持有期到期日(含该日)后，基金份额持有人方可就该基金份额提出赎回申请。因此，对于基金份额持有人而言，存在投资本基金后 3 年内无法赎回的风险。本基金管理人针对基金特定的运作方式，建立了相应的流动性风



险监控与预警机制。本基金管理人每日预测基金的流动性需求，通过独立的风险管理部门设置流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，并按照基金类型建立并定期开展专项的流动性压力测试工作，对流动性风险进行预警。

本基金所持的证券在证券交易所上市或可于银行间同业市场交易。截止本报告期末，单一投资者持有基金份额比例未超过基金总份额 50%。本报告期末，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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年12月 31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	326,543,207.96	-	-	-	-	-	326,543,207.96
结算备付金	2,042,978.03	-	-	-	-	-	2,042,978.03
存出保证金	586,497.34	-	-	-	-	-	586,497.34
交易性金融资产	-	-	-	16,942,380.40	1,031,750.40	5,130,310,488.91	5,148,284,619.71
应收利息	-	-	-	-	-	46,810.54	46,810.54
应收证券清算款	-	-	-	-	-	10,659,111.28	10,659,111.28
资产总计	329,172,683.33	-	-	16,942,380.40	1,031,750.40	5,141,016,410.73	5,488,163,224.86
负债							
应付管理人	-	-	-	-	-	3,698,786	3,698,786

报酬						.13	13
应付托管费						1,155,870.66	1,155,870.66
应付证券清算款						28,408,369.21	28,408,369.21
应付交易费用						1,397,135.38	1,397,135.38
应交税费						153.11	153.11
其他负债						175,000.00	175,000.00
负债总计						34,835,314.49	34,835,314.49
利率敏感度缺口	329,172,683.33			16,942,380.40	1,031,750.40	5,106,181,096.24	5,453,327,910.37
上年度末 2020年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	641,399,934.95						641,399,934.95
结算备付金	6,502,322.88						6,502,322.88
存出保证金	1,414,779.38						1,414,779.38
交易性金融资产					20,986,726.10	4,692,259,673.15	4,713,246,399.25
应收利息						69,721.45	69,721.45
资产总计	649,317,037.21				20,986,726.10	4,692,329,394.60	5,362,633,157.91
负债							
应付管理人报酬						3,423,258.52	3,423,258.52
应付托管费						1,069,768.27	1,069,768.27
应付证券清算款						49,517,816.30	49,517,816.30
应付交易费用						2,157,714.68	2,157,714.68
应交税费						79.03	79.03
其他负债						175,000.00	175,000.00
负债总计						56,343,636.80	56,343,636.80
利率敏感度	649,317,037				20,986,726	4,635,985	5,306,289,

缺口	.21			6.10	,757.80	521.11
----	-----	--	--	------	---------	--------

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产 0.33% (2020 年 12 月 31 日：0.40%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2020 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.4.2 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。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资产	-	1,250,826,063. 40	-	1,250,826,063.40
资产合计	-	1,250,826,063. 40	-	1,250,826,063.40
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	1,250,826,063. 40	-	1,250,826,063.40
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计

以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	1,358,813,839.76	-	1,358,813,839.76
资产合计	-	1,358,813,839.76	-	1,358,813,839.76
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	1,358,813,839.76	-	1,358,813,839.76

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除市场汇率以外的其他市场变量保持不变。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	所有外币相对人民币升值 5%	62,541,303.17	67,940,691.99
	所有外币相对人民币贬值 5%	-62,541,303.17	-67,940,691.99

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金投资组合中股票投资比例范围为基金资产的 60%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%）；每个交易日日终在扣除股指期货期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金面临的整体市场

价格风险列示如下：

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	5,130,310,488.91	94.08	4,692,259,673.15	88.43
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	17,974,130.80	0.33	20,986,726.10	0.40
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	5,148,284,619.71	94.41	4,713,246,399.25	88.82

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假设单个证券的公允价值和市场组合的公允价值依照资本-资产定价模型 (CAPM) 描述的规律进行变动		
	使用本基金业绩比较基准所对应的市场组合进行分析		
	本基金业绩比较基准变化 10%，其他变量不变		
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12月31日）	上年度末（2020年12月31日）	
分析	1. 业绩比较基准上升 10%	650,763,037.88	626,931,576.16
	2. 业绩比较基准下降 10%	-650,763,037.88	-626,931,576.16

注：本基金管理人运用 CAPM 模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将

对基金净值产生的影响。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、买入返售金融资产和其他金融负债等，其账面价值与公允价值相若。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 4,812,767,362.04 元，第二层次的余额为人民币 335,517,257.67 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为人民币 4,125,124,218.69 元，第二层次的余额为人民币 588,122,180.56 元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

本基金交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、资产支持证券和私募债除外)本期采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值，相关固定收益品种的公允价值层次归入第二层次。

(iii) 第三层次公允价值计量的金融工具

无。

(2) 根据《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》(财会[2017]7 号)、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》(财会[2017]8 号)、《企业会计准则第 24 号—套期会计》(财会[2017]9 号)、《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(财会[2017]14 号)(以下简称“新金融工具准则”)和《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》(财会[2020]22 号)等新金融工具相关会计准则及规定，本基金自 2022 年 1 月 1 日起开始执行新金融工具准则。

经评估，新金融工具准则预期不会对本基金财务报表产生重大影响。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	5,130,310,488.91	93.48
	其中：股票	5,130,310,488.91	93.48
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	17,974,130.80	0.33
	其中：债券	17,974,130.80	0.33
	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	328,586,185.99	5.99
8	其他各项资产	11,292,419.16	0.21
9	合计	5,488,163,224.86	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 1,250,826,063.40 元，占净值比例 22.94%。

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	2,888,029,383.81	52.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	11,519.99	0.00
F	批发和零售业	36,385.44	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	124,120,534.14	2.28
H	住宿和餐饮业	214,457,951.20	3.93
I	信息传输、软件和信息技术服务业	538,309,053.34	9.87
J	金融业	70,073.36	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-

M	科学研究和技术服务业	5,319,173.18	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	47,401.84	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	109,082,949.21	2.00
S	综合	-	-
	合计	3,879,484,425.51	71.14

### 8.2.2 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	196,391,069.37	3.60
日常消费品	120,793,574.48	2.22
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	231,913,573.18	4.25
工业	-	-
信息技术	391,378,553.85	7.18
通信服务	231,191,533.45	4.24
公用事业	-	-
房地产	79,157,759.07	1.45
合计	1,250,826,063.40	22.94

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

### 8.3 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	01024	快手-W	3,924,000	231,155,305.92	4.24
2	600703	三安光电	5,949,848	223,476,290.88	4.10
3	688099	晶晨股份	1,715,930	223,414,086.00	4.10
4	02382	舜宇光学科技	1,081,300	218,011,879.01	4.00
5	600690	海尔智家	6,705,009	200,412,719.01	3.68
5	06690	海尔智家	551,656	14,861,568.51	0.27
6	600754	锦江酒店	3,659,692	214,457,951.20	3.93
7	600309	万华化学	2,001,416	202,143,016.00	3.71
8	600745	闻泰科技	1,341,194	172,690,961.06	3.17
9	603707	健友股份	3,294,522	138,369,924.00	2.54
10	002415	海康威视	2,518,173	131,750,811.36	2.42
11	01347	华虹半导体	3,543,293	124,570,843.34	2.28
12	002938	鹏鼎控股	2,907,108	122,375,592.44	2.24
13	00291	华润啤酒	2,210,055	115,373,180.81	2.12



14	603816	顾家家居	1,455,542	111,185,420.72	2.04
15	002120	韵达股份	5,405,018	110,586,668.28	2.03
16	000739	普洛药业	3,117,508	109,393,355.72	2.01
17	300413	芒果超媒	1,927,049	109,036,539.62	2.00
18	002555	三七互娱	3,972,723	107,342,975.46	1.97
19	00175	吉利汽车	6,139,000	106,909,948.32	1.96
20	600521	华海药业	4,544,406	98,431,833.96	1.80
21	600315	上海家化	2,381,500	96,236,415.00	1.76
22	600873	梅花生物	12,258,900	94,025,763.00	1.72
23	603195	公牛集团	518,737	86,784,700.10	1.59
24	06049	保利物业	1,579,400	79,157,759.07	1.45
25	600438	通威股份	1,760,016	79,130,319.36	1.45
26	01801	信达生物	1,952,500	77,024,563.00	1.41
27	000733	振华科技	617,283	76,715,931.24	1.41
28	00780	同程旅行	6,320,400	74,619,552.54	1.37
29	603517	绝味食品	1,064,910	72,765,300.30	1.33
30	300454	深信服	370,300	70,053,500.00	1.28
31	688508	芯朋微	589,030	68,245,015.80	1.25
32	06078	海吉亚医疗	1,688,612	67,373,727.55	1.24
33	300327	中颖电子	962,618	65,361,762.20	1.20
34	002390	信邦制药	8,126,550	60,299,001.00	1.11
35	002250	联化科技	3,334,041	59,912,716.77	1.10
36	002028	思源电气	1,171,105	57,630,077.05	1.06
37	002318	久立特材	2,731,934	48,846,979.92	0.90
38	00763	中兴通讯	2,795,400	48,795,831.50	0.89
39	300850	新强联	282,459	48,359,805.39	0.89
40	605376	博迁新材	610,000	47,404,900.00	0.87
41	601966	玲珑轮胎	1,249,800	45,505,218.00	0.83
42	688303	大全能源	711,990	44,114,900.40	0.81
43	688002	睿创微纳	536,345	42,140,626.65	0.77
44	002851	麦格米特	1,301,903	41,425,134.06	0.76
45	600089	特变电工	1,932,400	40,908,908.00	0.75
46	002064	华峰化学	3,683,241	37,569,058.20	0.69
47	06855	亚盛医药-B	1,565,900	36,103,891.49	0.66
48	002614	奥佳华	2,797,632	36,033,500.16	0.66
49	688798	艾为电子	151,981	32,827,896.00	0.60
50	06699	时代天使	144,400	29,444,523.14	0.54
51	601126	四方股份	1,368,000	28,591,200.00	0.52
52	300870	欧陆通	350,000	27,821,500.00	0.51
53	002920	德赛西威	185,657	26,272,322.07	0.48
54	600406	国电南瑞	624,600	25,002,738.00	0.46
55	002212	天融信	1,281,629	24,568,827.93	0.45

56	02171	科济药业-B	977,000	21,966,868.00	0.40
57	002493	荣盛石化	871,459	15,825,695.44	0.29
58	600426	华鲁恒升	487,200	15,249,360.00	0.28
59	603713	密尔克卫	104,187	13,533,865.86	0.25
60	688690	纳微科技	156,791	12,515,057.62	0.23
61	300768	迪普科技	302,833	12,064,866.72	0.22
62	002812	恩捷股份	44,600	11,167,840.00	0.20
63	603113	金能科技	654,200	10,454,116.00	0.19
64	003035	南网能源	638,700	5,294,823.00	0.10
65	603444	吉比特	11,600	4,893,460.00	0.09
66	06601	朝云集团	1,596,000	4,058,206.66	0.07
67	688169	石头科技	3,800	3,089,400.00	0.06
68	600580	卧龙电驱	143,900	2,631,931.00	0.05
69	688187	时代电气	33,865	2,595,752.25	0.05
70	688167	炬光科技	9,628	2,108,532.00	0.04
71	601728	中国电信	394,011	1,682,426.97	0.03
72	688728	格科微	48,902	1,475,373.34	0.03
73	00322	康师傅控股	104,000	1,362,187.01	0.02
74	688766	普冉股份	2,505	888,298.05	0.02
75	688686	奥普特	2,330	657,456.10	0.01
76	688083	中望软件	1,837	642,637.71	0.01
77	688110	东芯股份	14,044	566,956.28	0.01
78	688772	珠海冠宇	12,960	506,606.40	0.01
79	300785	值得买	5,000	358,700.00	0.01
80	688776	国光电气	1,447	267,680.53	0.00
81	688087	英科再生	2,469	230,604.60	0.00
82	605499	东鹏饮料	632	114,922.88	0.00
83	301155	海力风电	1,054	101,974.50	0.00
84	600989	宝丰能源	4,900	85,064.00	0.00
85	600927	永安期货	1,859	69,749.68	0.00
86	688071	华依科技	1,101	68,603.31	0.00
87	301050	雷电微力	233	54,694.42	0.00
88	301029	怡合达	462	41,519.94	0.00
89	688722	同益中	3,687	37,570.53	0.00
90	688501	青达环保	1,759	37,132.49	0.00
91	00700	腾讯控股	97	36,227.53	0.00
92	300894	火星人	679	33,386.43	0.00
93	688701	卓锦股份	2,340	31,590.00	0.00
94	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.00
95	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.00
96	301221	光庭信息	280	24,841.60	0.00
97	301093	华兰股份	409	20,388.65	0.00

98	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.00
99	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
100	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
101	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
102	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
103	301015	百洋医药	462	13,998.60	0.00
104	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.00
105	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
106	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
107	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
108	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
109	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
110	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
111	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
112	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
113	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
114	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
115	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
116	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
117	301052	果麦文化	252	8,477.28	0.00
118	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
119	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
120	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
121	301016	雷尔伟	275	7,128.00	0.00
122	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
123	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
124	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
125	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
126	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
127	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
128	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
129	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
130	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
131	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
132	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
133	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
134	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
135	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
136	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
137	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
138	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
139	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00

140	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00
141	601166	兴业银行	17	323.68	0.00

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

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	01024	快手-W	317,857,358.53	5.99
2	00700	腾讯控股	277,287,251.94	5.23
3	600309	万华化学	261,438,869.60	4.93
4	000001	平安银行	249,375,926.28	4.70
5	600703	三安光电	236,044,665.29	4.45
6	02382	舜宇光学科技	190,582,093.27	3.59
7	600754	锦江酒店	175,138,041.59	3.30
8	002415	海康威视	173,305,836.21	3.27
9	600745	闻泰科技	161,020,119.98	3.03
10	601166	兴业银行	156,456,655.05	2.95
11	00175	吉利汽车	152,731,635.54	2.88
12	002938	鹏鼎控股	150,529,115.58	2.84
13	600690	海尔智家	128,957,365.13	2.43
14	01347	华虹半导体	124,680,285.24	2.35
15	01211	比亚迪股份	119,651,738.26	2.25
16	600315	上海家化	118,796,684.80	2.24
17	300413	芒果超媒	113,720,790.96	2.14
18	01810	小米集团-W	109,687,174.77	2.07
19	603195	公牛集团	100,989,801.55	1.90
20	002250	联化科技	86,049,383.24	1.62

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。

### 8.4.2 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	00700	腾讯控股	487,732,348.58	9.19
2	01211	比亚迪股份	338,574,282.13	6.38
3	600309	万华化学	289,926,378.71	5.46
4	600690	海尔智家	164,859,675.85	3.11
4	06690	海尔智家	101,528,995.86	1.91
5	600031	三一重工	266,291,048.30	5.02
6	603486	科沃斯	248,385,664.31	4.68

7	000001	平安银行	208,708,650.95	3.93
8	601012	隆基股份	173,173,730.90	3.26
9	603259	药明康德	161,847,833.38	3.05
10	600426	华鲁恒升	161,546,576.56	3.04
11	601318	中国平安	146,000,121.72	2.75
12	600460	士兰微	139,359,971.51	2.63
13	002415	海康威视	136,459,970.39	2.57
14	300124	汇川技术	133,088,053.16	2.51
15	601166	兴业银行	127,297,283.07	2.40
16	02269	药明生物	106,338,595.47	2.00
17	03690	美团-W	97,081,244.44	1.83
18	01810	小米集团-W	95,959,289.79	1.81
19	601799	星宇股份	93,826,823.34	1.77
20	600754	锦江酒店	91,215,245.87	1.72

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。

#### 8.4.3 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	6,247,043,168.50
卖出股票收入（成交）总额	5,983,711,072.14

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。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	17,974,130.80	0.33
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	17,974,130.80	0.33

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	------	--------------

1	127024	盈峰转债	138,260	16,942,380.40	0.31
2	113050	南银转债	8,720	1,031,750.40	0.02

### 8.7 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。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 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。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 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。

#### 8.10.2 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。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 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。

#### 8.11.2 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。

#### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货，故此项不适用。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1 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的情形，未出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

#### 8.12.2 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。

## 8.12.3 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	586,497.34
2	应收证券清算款	10,659,111.28
3	应收股利	-
4	应收利息	46,810.54
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,292,419.16

## 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	127024	盈峰转债	16,942,380.40	0.31
2	113050	南银转债	1,031,750.40	0.02

## 8.12.5 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	600745	闻泰科技	22,976,947.76	0.42	大宗交易购入 流通受限

## 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

## 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
68,629	43,255.72	163,690,234.37	5.51	2,804,906,869.50	94.49

**9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	10,701,130.37	0.3605

**9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况**

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

**§ 10 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日(2019年12月26日) 基金份额总额	2,968,597,103.87
本报告期期初基金份额总额	2,968,597,103.87
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额 (份额减 少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	2,968,597,103.87

注：总申购份额含红利再投资、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

**§ 11 重大事件揭示****11.1 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。

**11.2 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) 报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。

(2) 自 2021 年 10 月 27 日起，刘波先生不再担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

**11.3 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。

**11.4 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。



### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自 2020 年起连续 2 年聘请德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。本年度应支付给所聘任的会计师事务所 5.5 万元人民币。

### 11.6 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没有受到监管部门的稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	3	1,967,377,020.00	16.41%	1,866,733.37	21.98%	新增 1 个
国盛证券	2	1,651,269,389.69	13.77%	1,092,911.26	12.87%	-
广发证券	4	1,547,079,373.67	12.90%	1,084,045.66	12.77%	-
中信证券	7	1,360,501,948.66	11.35%	905,023.77	10.66%	新增 2 个
东方财富	2	839,956,455.04	7.00%	385,482.61	4.54%	-
东吴证券	2	752,865,116.18	6.28%	483,270.92	5.69%	-
中信建投 证券	5	671,348,891.04	5.60%	445,105.39	5.24%	-
国金证券	2	661,560,207.62	5.52%	441,983.71	5.21%	-
东方证券	1	522,509,161.45	4.36%	382,111.40	4.50%	-
中金公司	2	473,296,262.47	3.95%	315,400.78	3.71%	-
中泰证券	4	433,349,074.92	3.61%	282,953.88	3.33%	-
国信证券	2	248,583,989.25	2.07%	187,326.41	2.21%	-
华创证券	1	224,340,302.14	1.87%	164,062.67	1.93%	-
国泰君安	2	197,057,388.91	1.64%	152,181.46	1.79%	-
长江证券	2	150,630,249.33	1.26%	96,598.44	1.14%	-

安信证券	2	109,358,644.60	0.91%	81,535.34	0.96%	-
银河证券	1	69,887,724.46	0.58%	51,107.44	0.60%	-
摩根大通 证券	2	69,617,225.73	0.58%	46,978.21	0.55%	新增 2个
招商证券	2	29,567,908.73	0.25%	21,621.36	0.25%	-
申万宏源 证券	2	11,000,062.11	0.09%	4,744.34	0.06%	新增 2个
渤海证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证 券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
中国中金 财富证券	4	-	-	-	-	-

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。

### 11.7.2 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	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	4,151,221.20	100.00%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
中信建投 证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
摩根大通 证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中国中金 财富证券	-	-	-	-	-	-

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于旗下部分基金投资范围增加存托凭证并修改基金合同和托管协议的公告	上海证券报、指定互联网网站	2021-02-09
2	关于增加中原证券为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报、指定互联网网站	2021-03-05
3	关于旗下部分基金投资锦江酒店(600754)非公开发行股票的公告	上海证券报、指定互联网网站	2021-03-25
4	关于增加中金财富证券为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报、指定互联网网站	2021-04-07
5	关于增加珠海盈米基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报、指定互联网网站	2021-05-17
6	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报、指定互联网网站	2021-05-19
7	关于增加信达证券为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报、指定互联网网站	2021-07-15
8	关于旗下部分基金投资芒果超媒(300413)非公开发行股票的公告	上海证券报、指定互联网网站	2021-08-21
9	关于旗下部分基金投资新强联(300850)非公开发行股票的公告	上海证券报、指定互联网网站	2021-08-21
10	关于旗下部分基金投资迪普科技(300768)非公开发行股票的公告	上海证券报、指定互联网网站	2021-09-29
11	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报、指定互联网网站	2021-10-22
12	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报、指定互联网网站	2021-10-29
13	关于增加旗下部分基金销售机构并调整旗下基金在东方证券费率优惠活动的公告	上海证券报、指定互联网网站	2021-11-24

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

## 12.1 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。						

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

2、本基金每份基金份额的最短持有期为 3 年。对于每份基金份额，最短持有期指基金合同生效日（对认购份额而言，下同）或基金份额申购确认日（对申购份额而言，下同）起（即最短持有期起始日），至基金合同生效日或基金份额申购申请日起满 3 年（3 年指 365 天乘以 3 的自然天数，下同）后的下一工作日（即最短持有期到期日）。本基金每份基金份额在其最短持有期到期日（含该日）后，基金份额持有人方可就该基金份额提出赎回申请。因此，对于基金份额持有人而言，存在投资本基金后 3 年内无法赎回的风险。

3、本基金投资范围包括北交所上市的股票。基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于北交所上市股票或选择不将基金资产投资于北交所上市股票，基金资产并非必然投资北交所上市股票。基金管理人提醒投资者注意基金因投资北交所上市股票所带来的风险：北交所上市企业为创新型中小企业，普遍具有初创性、技术新、研发投入大、前景不确定、业绩波动大、风险高等特征，相对于沪深交易所上市企业，北交所上市企业的经营风险、盈利风险、技术风险、流动性风险、退市风险、股价大幅波动风险等整体上更为突出，且在北交所投资还存在市场制度、交易规则等差异可能带来的风险。基金投资北交所上市股票的特有风险包括但不限于流动性风险、转板风险、投资集中风险、退市风险、股价大幅波动风险、投资战略配售股票风险、政策风险等。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金注册的批复
- 2、《兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金托管协议》
- 4、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社会价值三年持有期混合型证券投资基金的法律意见书
- 7、中国证监会要求的其他文件

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

### 13.3 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中心电话：400-678-0099，021-38824536。

兴证全球基金管理有限公司

2022年3月31日