

# 兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混 合型基金中基金（FOF） 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 09 月 17 日（基金合同生效日）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	11
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	12
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	13
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	14
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	14
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	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>17</b>
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
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>46</b>

8.1 期末基金资产组合情况 .....	46
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	46
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 .....	47
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	49
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	51
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 .....	51
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 .....	51
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 .....	51
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 .....	51
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	51
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	52
8.12 本报告期投资基金情况 .....	52
8.13 投资组合报告附注 .....	61
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>62</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	62
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	62
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 .....	62
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>62</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>63</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	63
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 .....	63
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	63
11.4 基金投资策略的改变 .....	63
11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	63
11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	63
11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	63
11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	63
11.9 其他重大事件 .....	67
<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	兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）
基金简称	兴证全球安悦稳健养老一年持有混合 FOF
基金主代码	012509
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 9 月 17 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	6,348,186,797.73 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的前提下，本基金主要通过成熟稳健的资产配置策略和公募基金精选策略进行投资，力求基金资产的长期稳健增值，满足投资者的养老资金理财需求。
投资策略	作为一只服务于投资者养老需求的基金，本基金定位为稳健型的目标风险策略基金，根据特定的风险偏好设定权益类和固定收益类资产的比例，来获取养老资金的长期稳健增值。具体投资策略包括：资产配置策略、优选基金策略、股票投资策略、存托凭证投资策略、港股投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、证券公司短期公司债券投资策略、风险控制策略等。（详见本基金招募说明书）
业绩比较基准	中证偏股型基金指数收益率×20%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5%+中债综合（全价）指数收益率×75%。
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。本基金除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		兴证全球基金管理有限公司	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

注：2020 年 3 月 18 日，基金管理人名称变更为“兴证全球基金管理有限公司”。

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.xqfunds.com">http://www.xqfunds.com</a>
基金年度报告备置地点	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	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层
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 9 月 17 日（基金合同生效日）-2021 年 12 月 31 日
本期已实现收益	30,467,676.04
本期利润	78,561,304.66
加权平均基金份额本期利润	0.0124
本期加权平均净值利润率	1.23%
本期基金份额净值增长率	1.24%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末
期末可供分配利润	30,484,113.30
期末可供分配基金份额利润	0.0048
期末基金资产净值	6,426,787,110.96
期末基金份额净值	1.0124
3.1.3 累计期末指标	2021 年末
基金份额累计净值增长率	1.24%

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

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

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

4、本基金合同于 2021 年 9 月 17 日生效，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.30%	0.11%	0.52%	0.18%	0.78%	-0.07%
自基金合同生效起至今	1.24%	0.10%	0.65%	0.18%	0.59%	-0.08%

注：1、本基金业绩比较基准为中证偏股型基金指数收益率×20%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5%+中债综合（全价）指数收益率×75%。采用该业绩比较基准主要基于以下考虑：中证偏股型基金指数选取内地市场所有股票型基金以及混合型基金中以股票为主要投资对象的基金作为样本，采用净值规模加权，以较好的反映所有偏股型开放式证券投资基金的整体走势。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。本基金主要投资于公开募集的证券投资基金，且原则上会以 25% 的基金资产投资于权益类资产，因此本基金业绩比较基准中的 20% 选择了中证偏股型基金指数收益率，5% 选择了恒生指数收益率（使用估值汇率折算）。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：

$$\text{Return}_t = 20\% \times (\text{中证偏股型基金指数收益率}_t / \text{中证偏股型基金指数收益率}_{t-1} - 1) + 5\% \times (\text{恒生指数收益率}_t / \text{恒生指数收益率}_{t-1} - 1) + 75\% \times (\text{中债综合（全价）指数收益率}_t / \text{中债综合（全价）指数收益率}_{t-1} - 1)$$

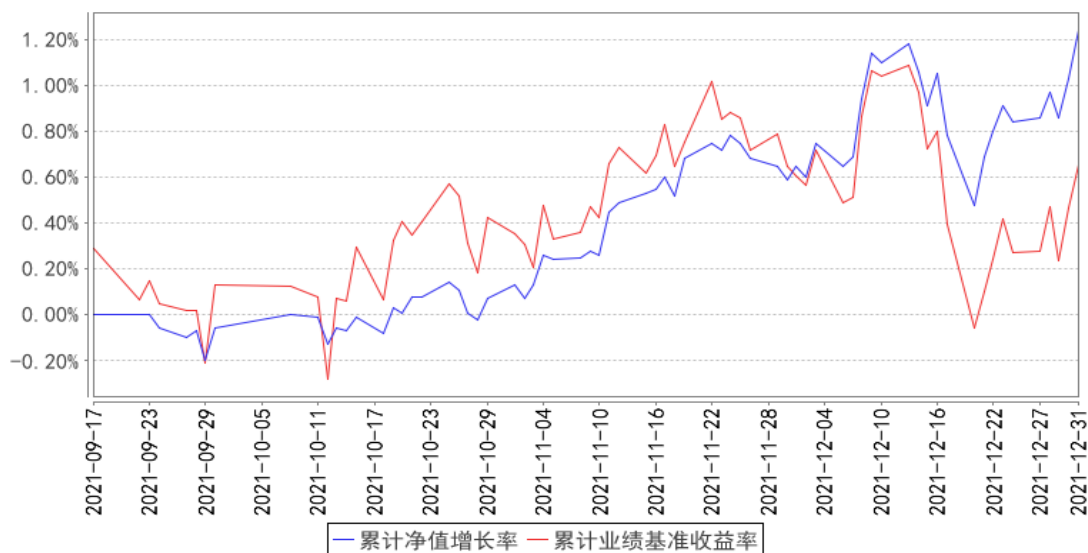
$$\text{Benchmark}_t = (1 + \text{Return}_t) \times (1 + \text{Benchmark}_{t-1}) - 1$$

其中，t=1, 2, 3, …, T, T 表示时间截至日。

2、本基金基金合同生效日为 2021 年 9 月 17 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

兴证全球安悦稳健养老一年持有混合FOF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

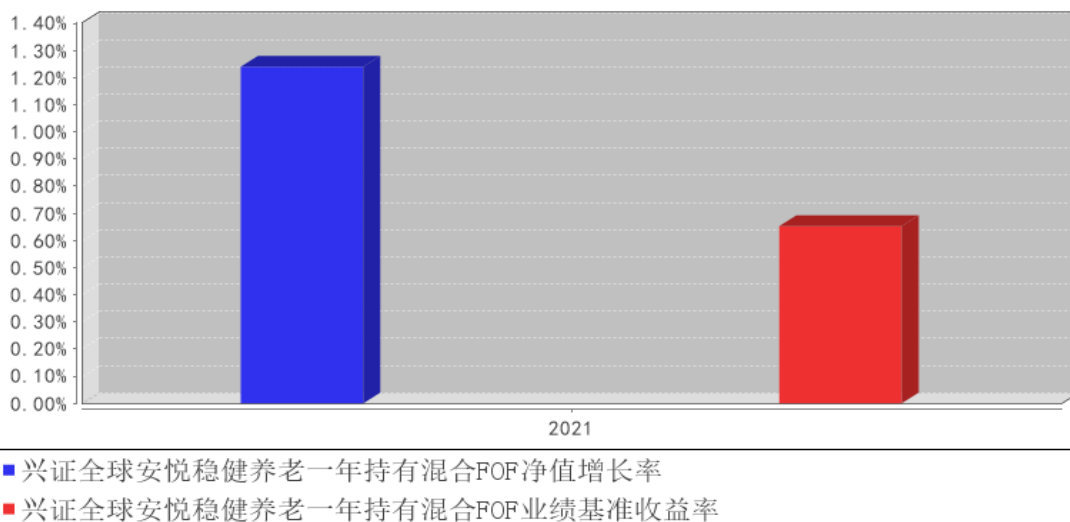


注：1、净值表现所取数据截至到 2021 年 12 月 31 日。

2、按照《兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》的规定，本基金建仓期为 2021 年 09 月 17 日起共计六个月。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。截至报告期末，本基金尚在建仓期内。

### 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

兴证全球安悦稳健养老一年持有混合FOF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：2021 年数据统计期间为 2021 年 9 月 17 日至 2021 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：本基金自合同生效日（2021年9月17日）至2021年12月31日止期间未进行利润分配。

## § 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		
林国怀	FOF 投资与金融工程部、养老金管理部总监，兴全安泰平衡养老目标三年	2021 年 9 月 17 日	-	14 年	硕士。历任天相投资顾问有限公司基金分析师，瑞泰人寿保险基金组合投资经理，合众人寿资产管理中心基金组合投资经理，泰康资产管理有限公司执行总监，天安人寿资产管理中心权益投资部经理。

	<p>持有期混合型基金中基金（FOF）、兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）、兴全安泰稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、兴全安泰积极养老目标五年持有期混合型基金中基金（FOF）、兴证全球优选平衡三个月持有期混合型基金中基金（FOF）、兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、兴证全球积极配置三年封闭运作混合型基金中基金</p>				
--	---	--	--	--	--

	（ FOF- 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、《兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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 年市场大幅震荡，风格指数、行业指数分化明显。从风格指数上看，小盘指数表现好于大盘指数和中盘指数，全年中证 1000 指数(全收益)表现最为出色，涨幅 21.61%，中证 500(全收益)上涨 17.24%，而沪深 300(全收益)全年下跌 3.52%，上证 50(全收益)下跌 8.18%；创业板指数(全收益)上涨 12.41%，而市场关注度比较高的“茅指数”全年下跌 4.44%。从行业表现来看，新能源、强周期板块表现相对较强，电气设备行业全年上涨 47.86%，有色金属、采掘、化工、钢铁行业分别上涨 40.47%、38.07%、37.19%和 34.06%，同时，家用电器、非银金融、房地产、休闲服务行业的年度跌幅都在 10%以上。基金指数及其他资产方面，中证偏股基金指数全年上涨 4.05%，中长期纯债基金指数上涨 4.13%，黄金 ETF 下跌 5.38%，恒生指数下跌 14.08%，标普 500 指数上涨 26.89%。

本基金于 2021 年三季度新发成立。操作上，考虑到建仓初期股票市场出现了较大程度的分化、部分行业或风格的估值水平处于历史极高位置，本基金在权益类资产上在年初的上涨采取了相对较慢、“越跌越加”的建仓节奏，而在偏绝对收益资产上采取了相对较快的建仓节奏。本基金定位“稳健型”，更加注重性价比和安全边际。自成立以来，整体组合采取了一定的仓位和风格偏离，权益仓位维持在中性偏低水平，组合风格整体偏向于价值风格。此外，基金组合还采取了相对多元化的资产配置，通过跨资产（权益、固定收益类、黄金等），以及资产内（权益包括了 A 股、港股和美股资产等）的搭配来降低组合的波动率。

### 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 1.0124 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.24%，业绩比较基准收益率为 0.65%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前面临的经济环境、外部环境都处于相对不确定的阶段，我们也很难预判中短期的发展方向，不过相对确定的是目前整体的货币环境偏宽松，市场整体的估值水平已回归到历史中枢水平，增量资金疯狂入市的情绪已经趋于平静，市场将可能进入到一个新的状态。

基于对 A 股市场的长期走势的乐观预期，我们会积极在中短期震荡市场中寻找投资机会，同时我们将继续保持以下特点：

1、保持基金组合的资产多元化和策略多样性。我们 FOF 团队一方面追求长期相对于业绩比较基准的超额收益，另一方面我们认为收益或超额收益的稳定性也是同等重要的，而多元资产配置和多策略配置能够有效的提升组合的风险调整后收益，改善持有人的投资体验；

2、相对均衡的配置和适度的左侧交易模式。过去两年中，基金指数的行业配置和风格配置更加极致化，我们希望通过选择“性价比”更优的资产实现相对均衡的配置，过程中也相应提升了相对于基准的偏离容忍度。随着今年以来市场的大幅调整，后续我们会适度降低偏离度，继续努力将本基金呈现为“相对稳定的‘贝塔’和相对确定的‘阿尔法’特征”。

本基金是一只稳健型的养老目标基金，权益类资产的配置中枢为 25%，我们在实际的运作过程中，将秉承一贯的投资风格，充分发挥 FOF 产品“力争不降低预期收益率，同时降低波动率”的优势，力争兼顾长期收益率和改善持有人体验，从而陪伴投资者实现财富增值。我们也将秉承勤勉尽责的态度进行组合管理，遵守契约要求、保持策略的稳定性。

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

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）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	毕马威华振审字第 2200136 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	兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）全体基金份额持有人：
审计意见	<p>我们审计了后附的兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）（以下简称“兴全安悦稳健养老混合基金（FOF）”）财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表、自 2021 年 9 月 17 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“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编制，公允反映了兴全安悦稳健养老混合基金（FOF）2021 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2021 年 9 月 17 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果及基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“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，我们独立于兴全安悦稳健养老混合基金（FOF），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。</p>
强调事项	无
其他事项	不适用
其他信息	<p>兴全安悦稳健养老混合基金（FOF）管理人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。其他信息包括兴全安悦稳健养老混合基金（FOF）2021 年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。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中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 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安悦稳健养老混合基金 (FOF) 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，除非兴全安悦稳健养老混合基金 (FOF) 计划进行清算、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安悦稳健养老混合基金 (FOF) 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性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对兴全安悦稳健养老混合基金 (FOF) 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</p>



	<p>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安悦稳健养老混合基金（FOF）不能持续经营。</p> <p>(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。</p> <p>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。</p>	
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	张楠	欧梦澈
会计师事务所的地址	北京市东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 楼	
审计报告日期	2022 年 03 月 29 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）

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
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	84,430,202.34
结算备付金		1,502,612.56
存出保证金		81,823.38
交易性金融资产	7.4.7.2	6,340,041,818.87
其中：股票投资		178,863,882.69
基金投资		5,809,985,667.88
债券投资		351,192,268.30
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		1,252,033.48
应收利息	7.4.7.5	2,852,565.82
应收股利		-
应收申购款		309,970.16
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	221.91
资产总计		6,430,471,248.52
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>

		2021 年 12 月 31 日
<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		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		2,810,844.50
应付托管费		744,178.31
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	29,037.68
应交税费		77.07
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	100,000.00
负债合计		3,684,137.56
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	6,348,186,797.73
未分配利润	7.4.7.10	78,600,313.23
所有者权益合计		6,426,787,110.96
负债和所有者权益总计		6,430,471,248.52

注：本基金合同于 2021 年 09 月 17 日生效，本期财务报表的实际编制期间为 2021 年 09 月 17 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间。报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0124 元，基金份额总额 6,348,186,797.73 份。

## 7.2 利润表

会计主体：兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2021 年 9 月 17 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 9 月 17 日（基金合 同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
一、收入		90,955,882.56
1. 利息收入		2,498,143.46
其中：存款利息收入	7.4.7.11	649,137.41
债券利息收入		1,632,950.99
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		216,055.06
证券出借利息收入		-

其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		40,356,667.93
其中：股票投资收益	7.4.7.12	3,036,021.87
基金投资收益	7.4.7.13	1,035,576.52
债券投资收益	7.4.7.14	44,040.00
资产支持证券投资收益	7.4.7.14.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-
股利收益	7.4.7.17	36,241,029.54
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	48,093,628.62
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	7,442.55
减：二、费用		12,394,577.90
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	9,326,441.74
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,546,160.92
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.20	404,074.31
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		9.86
7. 其他费用	7.4.7.21	117,891.07
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		78,561,304.66
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		78,561,304.66

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2021年9月17日（基金合同生效日）至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2021年9月17日（基金合同生效日）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）	6,344,209,810.91	-	6,344,209,810.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	78,561,304.66	78,561,304.66

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)	3,976,986.82	39,008.57	4,015,995.39
其中：1. 基金申购款	3,976,986.82	39,008.57	4,015,995.39
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）	6,348,186,797.73	78,600,313.23	6,426,787,110.96

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）（以下简称“本基金”），经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）于 2021 年 5 月 13 日印发的证监许可[2021]1694 号文的核准公开募集，由兴证全球基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法规和《兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》发售，基金合同于 2021 年 9 月 17 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为 6,344,209,810.91 份基金份额。本基金的基金管理人为兴证全球基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》和《兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金（包括 QDII 基金和香港互认基金）、国内依法

发行上市的股票及存托凭证（包括中小板、创业板、科创板以及其他中国证监会核准或注册发行的股票及存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、证券公司短期公司债券、可转换债券（含可分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本基金不投资具有复杂、衍生品性质的基金份额，包括分级基金和中国证监会认定的其他基金份额。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，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金投资于经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金的资产比例不低于基金资产的 80%。本基金投资于权益类资产（股票、股票型基金、混合型基金）的战略配置目标比例中枢为 25%，投资比例范围为基金资产的 15%-30%。其中，计入上述权益类资产的混合型基金需符合下列两个条件之一：1、基金合同约定股票资产投资比例不低于基金资产 60% 的混合型基金；2、根据基金披露的定期报告，最近四个季度中任一季度股票资产占基金资产比例均不低于 60% 的混合型基金。同时，股票、股票型基金、混合型基金和商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）等品种的投资比例合计不得超过基金资产的 30%。本基金投资于港股通标的股票占基金股票资产的 0-50%；本基金应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金业绩比较基准： $\text{中证偏股型基金指数收益率} \times 20\% + \text{恒生指数收益率（使用估值汇率折算）} \times 5\% + \text{中债综合（全价）指数收益率} \times 75\%$ 。

#### 7.4.2 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。

#### 7.4.3 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 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况、自 2021 年 9 月 17 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间的经

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

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2021 年 9 月 17 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

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

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

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

##### 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

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

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

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

- 应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

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

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

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

- 所转移金融资产的账面价值
- 因转移而收到的对价

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

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

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

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

股利收益包括股票投资产生的股利收益及基金投资产生的股利收益。股票投资产生的股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。基金投资产生的股利收益按基金公司宣告的分红比例计算的金额确认。

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

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

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

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。



#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金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；每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。在不影响基金份额持有人利益的情况下，基金管理人经与基金托管人协商一致后，可在法律法规允许的前提下并按照监管部门要求履行适当程序后酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

#### 7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投

资流通受限股票估值指引（试行）的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

对于基金投资，根据中基协发[2017]3号《关于发布〈基金中基金估值业务指引（试行）〉的通知》之附件《基金中基金估值业务指引（试行）》，按如下方法估值：

(a) 对于交易型开放式指数基金、境内上市定期开放式基金及封闭式基金，按所投资基金估值日的收盘价估值；

(b) 对于境内上市开放式基金（LOF）及其他境内非货币市场基金，按所投资基金估值日的份额净值估值；

(c) 对于境内上市交易型货币市场基金，如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金估值日的份额净值估值；如所投资基金披露万份（百份）收益，则按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份（百份）收益计提估值日基金收益；

(d) 对于境内非上市货币市场基金按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份收益计提估值日基金收益。

如遇所投资基金不公布基金份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情况，本基金根据以下原则进行估值：

(1) 以所投资基金的基金份额净值估值的，若所投资基金与基金中基金估值频率一致但未公布估值日基金份额净值，按其最近公布的基金份额净值为基础估值。

(2) 以所投资基金的收盘价估值的，若估值日无交易，且最近交易日后市场环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后市场环境发生了重大变化的，可使用最新的基金份额净值为基础或参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素调整最近交易市价，确定公允价值。

(3) 如果所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分，基金管理人应根据基金份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

## 7.4.6 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。

## 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
活期存款	84,430,202.34
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	84,430,202.34

#### 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	166,086,997.60	178,863,882.69	12,776,885.09
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	11,566,268.30	167,627.49
	银行间市场	339,626,000.00	515,120.00
	合计	351,192,268.30	682,747.49
资产支持证券	-	-	-
基金	5,775,351,671.84	5,809,985,667.88	34,633,996.04
其他	-	-	-
合计	6,291,948,190.25	6,340,041,818.87	48,093,628.62

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金于本报告期末未持有任何衍生金融资产/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：本基金于本报告期末未持有任何买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 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
应收活期存款利息	9,313.68
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	743.82
应收债券利息	2,842,467.84
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	40.48
合计	2,852,565.82

#### 7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
其他应收款	221.91
待摊费用	-
合计	221.91

#### 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
交易所市场应付交易费用	26,987.68
银行间市场应付交易费用	2,050.00
合计	29,037.68

#### 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
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	60,000.00
预提信息披露费	40,000.00
合计	100,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年9月17日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	6,344,209,810.91	6,344,209,810.91
本期申购	3,976,986.82	3,976,986.82
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	6,348,186,797.73	6,348,186,797.73

注：此处申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

## 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	30,467,676.04	48,093,628.62	78,561,304.66
本期基金份额交易产生的变动数	16,437.26	22,571.31	39,008.57
其中：基金申购款	16,437.26	22,571.31	39,008.57
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	30,484,113.30	48,116,199.93	78,600,313.23

## 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年9月17日（基金合同生效日）至2021年12月31日
活期存款利息收入	637,829.22
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	11,034.31
其他	273.88
合计	649,137.41

## 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9月17日（基金合同生效日）至2021年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	3,036,021.87
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	3,036,021.87

## 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9月17日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出股票成交总额	16,076,013.36

减：卖出股票成本总额	13,039,991.49
买卖股票差价收入	3,036,021.87

#### 7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金在本报告期内无股票投资证券出借差价收入。

#### 7.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年9月17日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出/赎回基金成交总额	827,352,495.01
减：卖出/赎回基金成本总额	826,316,918.49
基金投资收益	1,035,576.52

#### 7.4.7.14 债券投资收益

##### 7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2021年9月17日（基金合同生效日）至2021年12月31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	44,040.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	44,040.00

##### 7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年9月17日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	60,344,710.68
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	59,845,920.00
减：应收利息总额	454,750.68
买卖债券差价收入	44,040.00

##### 7.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金在本报告期内无债券投资收益赎回差价收入。

##### 7.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金在本报告期内无债券投资收益申购差价收入。



**7.4.7.14.5 资产支持证券投资收益**

注：本基金在本报告期内无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.15 贵金属投资收益****7.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金在本报告期内无贵金属投资收益。

**7.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：无。

**7.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：无。

**7.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：无。

**7.4.7.16 衍生工具收益****7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金在本报告期内无衍生工具收益。

**7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：无。

**7.4.7.17 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2021年9月17日（基金合同生效日）至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	59,768.00
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	36,181,261.54
合计	36,241,029.54

**7.4.7.18 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年9月17日（基金合同生效日）至2021年12月31日
1. 交易性金融资产	48,093,628.62

股票投资	12,776,885.09
债券投资	682,747.49
资产支持证券投资	-
基金投资	34,633,996.04
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	48,093,628.62

#### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年9月17日（基金合同生效日）至2021 年12月31日
基金赎回费收入	-
其他	7,442.55
合计	7,442.55

#### 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年9月17日（基金合同生效日）至2021 年12月31日
交易所市场交易费用	206,057.13
银行间市场交易费用	2,050.00
交易基金产生的费用	195,967.18
其中：申购费	49,500.00
赎回费	12,389.75
交易费	16,974.42
转换费	117,103.01
合计	404,074.31

#### 7.4.7.20.1 持有基金产生的费用

项目	本期费用 2021年9月17日（基金合同生效日）至2021 年12月31日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	89,237.53
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	7,189,170.31
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	1,805,982.76

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金

的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 9 月 17 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00
信息披露费	40,000.00
证券出借违约金	-
开户费	400.00
银行费用	17,491.07
合计	117,891.07

#### 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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

##### 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，本基金没有需要在财务报表附注中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（“兴证全球基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“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（“兴业证券”）	基金管理人的股东
全球人寿保险国际公司	基金管理人的股东
兴证全球资本管理（上海）有限公司（“兴证全球资本”）	基金管理人的子公司

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 9 月 17 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
兴业证券	164,379,859.79	96.07

#### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年9月17日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
兴业证券	2,698,961.65	23.65

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年9月17日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
兴业证券	400,000,000.00	50.00

#### 7.4.10.1.4 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年9月17日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期基金 成交总额的比例（%）
兴业证券	195,905,810.37	46.16

#### 7.4.10.1.5 权证交易

注：本基金在本报告期内没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

#### 7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年9月17日（基金合同生效日）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	138,578.57	97.03	22,743.31	84.27

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用兴业证券证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还从兴业证券获得证券研究综合服务。

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

	2021 年 9 月 17 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	9,326,441.74
其中：支付销售机构的客户维护费	5,291,248.61

注：支付基金管理人兴证全球基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值（扣除投资于本基金管理人所管理的基金的部分）的 0.6%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值(扣除投资于本基金管理人所管理的基金的部分)×0.6%/当年天数

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

	本期 2021 年 9 月 17 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,546,160.92

注：支付基金托管人招商银行的基金托管费按前一日基金资产净值（扣除投资于本基金管理人所托管的基金的部分）的 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值（扣除投资于本基金管理人所托管的基金的部分）×0.15%/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：本基金在本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 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：本基金在本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 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：本基金在本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 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固有资金投资本基金的情况

注：本基金的管理人在本报告期内未持有过本基金。

**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：除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末未持有本基金。

**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9月17日（基金合同生效日）至2021年12月 31日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	84,430,202.34	637,829.22

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计算。

**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：本基金在本报告期内未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

**7.4.10.8 其他关联交易事项的说明****7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明**

于本报告期末，本基金持有基金管理人兴证全球基金管理有限公司所管理的基金合计人民币861,273,645.45元，占本基金资产净值的比例为13.40%。

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

项目	本期费用 2021年9月17日（基金合同生效日）至2021年12月 31日
当期交易基金产生的申购费（元）	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	7,442.77
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	1,012,593.17
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	273,003.39

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

根据本基金合同的约定，本基金管理人运用本基金基金财产申购自身管理的基金的（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不得收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并记入基金财产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用。

## 7.4.11 利润分配情况

注：本基金在本报告期内未进行过利润分配。

## 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	-
002607	中公教育	2021年11月29日	2022年5月30日	大宗交易购入流通受限	9.00	7.16	890,000	8,010,000.00	6,372,400.00	-
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	130,000	3,935,100.00	3,919,500.00	-
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	200,000	8,000,000.00	7,930,000.00	-
300383	光环新网	2021年12月29日	2022年7月1日	非公开发行流通受限	11.79	14.06	678,541	7,999,998.39	9,540,286.46	-
300451	创业慧康	2021年12月23日	2022年6月23日	大宗交易购入流通受限	8.75	10.52	700,000	6,125,000.00	7,364,000.00	-
300793	佳禾智能	2021年12月8日	2022年6月10日	非公开发行流通受限	14.16	19.38	564,971	7,999,989.36	10,949,137.98	-
301096	百诚医药	2021年12月13日	2022年6月20日	新股流通受限	79.60	78.53	272	21,651.20	21,360.16	-
301138	华研	2021年	2022	新股流	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10	-

	精机	12月8日	年6月15日	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	-
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	-

注：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。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 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：本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 7.4.12.3.2 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。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。



## 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

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。本基金管理人制定了政策和程序以识别及分析相关风险，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。

### 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（不含证券投资基金）市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券（不含证券投资基金），不得超过该证券的 10%。

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

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金于本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金于本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 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
AAA	11,537,754.10
AAA 以下	28,514.20
未评级	-
合计	11,566,268.30

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：本基金于本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 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 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

本基金为具有一定持有期的开放式基金，符合条件的其他投资者可在合同规定的开放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。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	84,430,202.34	-	-	-	-	-	84,430,202.34
结算备付金	1,502,612.56	-	-	-	-	-	1,502,612.56
存出保证金	81,823.38	-	-	-	-	-	81,823.38
交易性金融资产	-	-	339,626,000.00	11,537,754.10	28,514.20	5,988,849,550.57	6,340,041,818.87
应收利息	-	-	-	-	-	2,852,565.82	2,852,565.82
应收申购款	22,880.42	-	-	-	-	-287,089.74	309,970.16
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,252,033.48	1,252,033.48
其他资产	-	-	-	-	-	221.91	221.91
资产总计	86,037,518.70	-	339,626,000.00	11,537,754.10	28,514.20	5,993,241,461.52	6,430,471,248.52
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,810,844.50	2,810,844.50
应付托管费	-	-	-	-	-	-744,178.31	744,178.31
应付交易费用	-	-	-	-	-	29,037.68	29,037.68
应交税费	-	-	-	-	-	77.07	77.07
其他负债	-	-	-	-	-	-100,000.00	100,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	3,684,137.56	3,684,137.56
利率敏感度缺口	86,037,518.70	-	339,626,000.00	11,537,754.10	28,514.20	5,989,557,323.96	6,426,787,110.96

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

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12月31日)
分析	市场利率-1%	2,051,899.35
	市场利率+1%	-2,027,234.47

## 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

## 7.4.13.4.3 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。

## 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	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	178,863,882.69	2.78
交易性金融资产—基金投资	5,809,985,667.88	90.40
交易性金融资产—债券投资	351,192,268.30	5.46
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	6,340,041,818.87	98.65

#### 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	
	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 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准+10%	397,541,300.46
	业绩比较基准-10%	-397,541,300.46

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

##### 7.4.14.1 以公允价值计量的资产和负债

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：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：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 5,953,567,315.13 元，第二层次的余额为人民币 386,474,503.74 元，无属于层级的余额。

##### (a) 第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，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时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑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，确定相关证券公允价值的层次。

##### (b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.2 其他金融工具的公允价值（期末非以公允价值计量的项目）

其他金融工具主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

7.4.14.3 其他事项

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”）相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。本基金将按照新金融工具准则的衔接规定，对新金融工具准则施行日（即 2022 年 1 月 1 日）未终止确认的金融工具的分类和计量（含减值）进行追溯调整。本基金将不调整比较财务报表数据，将金融工具的原账面价值和在新金融工具准则施行日的新账面价值之间的差额计入 2022 年年初留存收益或其他综合收益。该准则的采用未对本基金净值产生重大影响。

## § 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	178,863,882.69	2.78
	其中：股票	178,863,882.69	2.78
2	基金投资	5,809,985,667.88	90.35
3	固定收益投资	351,192,268.30	5.46
	其中：债券	351,192,268.30	5.46
	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	85,932,814.90	1.34
8	其他各项资产	4,496,614.75	0.07
9	合计	6,430,471,248.52	100.00

### 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	3,022,368.00	0.05
C	制造业	116,869,951.17	1.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,713.80	0.00
F	批发和零售业	281,466.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	1,908,918.00	0.03
H	住宿和餐饮业	2,971,020.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,897,088.21	0.47
J	金融业	6,658,574.68	0.10
K	房地产业	3,201,863.00	0.05
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	3,424,606.16	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	6,372,400.00	0.10
Q	卫生和社会工作	1,791,000.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	2,459,913.67	0.04
S	综合	-	-
	合计	178,863,882.69	2.78

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

### 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	300793	佳禾智能	564,971	10,949,137.98	0.17
2	300383	光环新网	678,541	9,540,286.46	0.15
3	002938	鹏鼎控股	200,000	7,930,000.00	0.12
4	300451	创业慧康	700,000	7,364,000.00	0.11
5	002607	中公教育	890,000	6,372,400.00	0.10
6	000858	五粮液	23,700	5,277,042.00	0.08
7	000568	泸州老窖	19,500	4,950,465.00	0.08
8	002851	麦格米特	130,000	3,919,500.00	0.06
9	002415	海康威视	71,400	3,735,648.00	0.06
10	300760	迈瑞医疗	9,800	3,731,840.00	0.06

11	002920	德赛西威	25,900	3,665,109.00	0.06
12	603259	药明康德	28,700	3,403,246.00	0.05
13	300207	欣旺达	72,900	3,073,464.00	0.05
14	002036	联创电子	124,100	3,010,666.00	0.05
15	002555	三七互娱	110,800	2,993,816.00	0.05
16	600754	锦江酒店	50,700	2,971,020.00	0.05
17	603799	华友钴业	26,400	2,912,184.00	0.05
18	600690	海尔智家	96,100	2,872,429.00	0.04
19	688099	晶晨股份	21,600	2,812,320.00	0.04
20	600570	恒生电子	43,200	2,684,880.00	0.04
21	600521	华海药业	122,700	2,657,682.00	0.04
22	300638	广和通	47,800	2,605,100.00	0.04
23	600885	宏发股份	34,900	2,604,936.00	0.04
24	600309	万华化学	25,300	2,555,300.00	0.04
25	000001	平安银行	154,900	2,552,752.00	0.04
26	300316	晶盛机电	36,200	2,515,900.00	0.04
27	603517	绝味食品	36,700	2,507,711.00	0.04
28	603816	顾家家居	32,300	2,492,268.00	0.04
29	600519	贵州茅台	1,200	2,460,000.00	0.04
30	601899	紫金矿业	247,400	2,399,780.00	0.04
31	601318	中国平安	47,300	2,384,393.00	0.04
32	600460	士兰微	43,200	2,341,440.00	0.04
33	600882	妙可蓝多	40,600	2,273,600.00	0.04
34	000786	北新建材	62,900	2,253,707.00	0.04
35	002138	顺络电子	57,800	2,206,804.00	0.03
36	300327	中颖电子	32,000	2,172,800.00	0.03
37	600048	保利发展	135,700	2,120,991.00	0.03
38	000739	普洛药业	60,200	2,112,418.00	0.03
39	600299	安迪苏	161,800	1,993,376.00	0.03
40	300188	美亚柏科	114,500	1,968,255.00	0.03
41	600315	上海家化	47,900	1,935,639.00	0.03
42	300724	捷佳伟创	16,900	1,931,670.00	0.03
43	002120	韵达股份	93,300	1,908,918.00	0.03
44	300482	万孚生物	48,000	1,890,240.00	0.03
45	300496	中科创达	13,600	1,882,512.00	0.03
46	600161	天坛生物	63,300	1,833,168.00	0.03
47	603486	科沃斯	12,000	1,811,400.00	0.03
48	600763	通策医疗	9,000	1,791,000.00	0.03
49	600862	中航高科	49,500	1,770,120.00	0.03
50	600760	中航沈飞	25,400	1,728,216.00	0.03
51	002390	信邦制药	232,200	1,722,924.00	0.03
52	601688	华泰证券	93,000	1,651,680.00	0.03



53	002250	联化科技	89,800	1,613,706.00	0.03
54	688005	容百科技	13,200	1,525,656.00	0.02
55	600398	海澜之家	224,400	1,438,404.00	0.02
56	600809	山西汾酒	4,300	1,357,854.00	0.02
57	300144	宋城演艺	93,800	1,343,216.00	0.02
58	600703	三安光电	32,200	1,209,432.00	0.02
59	300413	芒果超媒	19,000	1,087,180.00	0.02
60	000002	万科 A	54,700	1,080,872.00	0.02
61	002508	老板电器	28,800	1,037,376.00	0.02
62	601857	中国石油	126,800	622,588.00	0.01
63	300454	深信服	3,200	611,200.00	0.01
64	688110	东芯股份	14,044	566,956.28	0.01
65	603833	欧派家居	3,300	486,750.00	0.01
66	002182	云海金属	17,700	406,038.00	0.01
67	600660	福耀玻璃	7,300	344,122.00	0.01
68	002064	华峰化学	30,300	316,332.00	0.00
69	603883	老百姓	5,700	281,466.00	0.00
70	301155	海力风电	1,054	101,974.50	0.00
71	600927	永安期货	1,859	69,749.68	0.00
72	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.00
73	301221	光庭信息	280	24,841.60	0.00
74	301096	百诚医药	272	21,360.16	0.00
75	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
76	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
77	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
78	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
79	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
80	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
81	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00

## 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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	002938	鹏鼎控股	8,989,963.00	0.14
2	002607	中公教育	8,010,000.00	0.12
3	300383	光环新网	7,999,998.39	0.12
4	300793	佳禾智能	7,999,989.36	0.12
5	300451	创业慧康	6,125,000.00	0.10
6	002851	麦格米特	5,868,772.00	0.09
7	000858	五粮液	4,665,964.00	0.07
8	603259	药明康德	4,413,042.00	0.07

9	002415	海康威视	3,848,412.42	0.06
10	300760	迈瑞医疗	3,736,681.00	0.06
11	688235	百济神州	3,701,194.20	0.06
12	000568	泸州老窖	3,448,406.00	0.05
13	603799	华友钴业	3,073,540.00	0.05
14	000001	平安银行	2,774,259.00	0.04
15	600309	万华化学	2,746,599.00	0.04
16	300750	宁德时代	2,652,650.00	0.04
17	601899	紫金矿业	2,632,403.00	0.04
18	600763	通策医疗	2,575,802.00	0.04
19	300316	晶盛机电	2,478,352.00	0.04
20	600690	海尔智家	2,474,241.00	0.04

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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	3,354,190.00	0.05
2	688235	百济神州	3,101,666.38	0.05
3	002851	麦格米特	2,019,719.00	0.03
4	301155	海力风电	1,474,311.22	0.02
5	002938	鹏鼎控股	1,398,087.00	0.02
6	688032	禾迈股份	1,291,306.98	0.02
7	688112	鼎阳科技	553,826.68	0.01
8	688230	芯导科技	519,119.12	0.01
9	688167	炬光科技	387,896.40	0.01
10	688192	迪哲医药	380,076.08	0.01
11	688190	云路股份	353,705.44	0.01
12	301096	百诚医药	260,805.60	0.00
13	301221	光庭信息	253,611.00	0.00
14	301190	善水科技	197,805.48	0.00
15	301179	泽宇智能	161,094.40	0.00
16	301182	凯旺科技	122,693.00	0.00
17	301138	华研精机	110,502.00	0.00
18	603071	物产环能	56,537.98	0.00
19	600935	华塑股份	36,523.08	0.00
20	603216	梦天家居	30,872.28	0.00

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	179,126,989.09
--------------	----------------

卖出股票收入（成交）总额	16,076,013.36
--------------	---------------

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	339,626,000.00	5.28
	其中：政策性金融债	339,626,000.00	5.28
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）	11,566,268.30	0.18
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	351,192,268.30	5.46

### 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	210211	21 国开 11	1,400,000	139,874,000.00	2.18
2	210407	21 农发 07	1,200,000	119,808,000.00	1.86
3	210306	21 进出 06	800,000	79,944,000.00	1.24
4	110053	苏银转债	41,020	4,855,127.20	0.08
5	113044	大秦转债	36,150	3,956,256.00	0.06

### 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

股指期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

### 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

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

#### 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

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

### 8.12 本报告期投资基金情况

#### 8.12.1 投资政策及风险说明

本基金作为一只稳健型的养老目标 FOF 基金，在风控策略上将相对收益风险、子基金风格飘移风险及整体流动性风险进行重点控制。

相对收益风险方面，本基金将从持仓角度出发，根据所投资基金最新的定期报告数据，衡量本基金与业绩比较基准在底层资产配置、行业配置等维度上的偏离方向和幅度；同时从净值角度出发，定期跟踪本基金净值相对于业绩比较基准的贝塔值、跟踪误差等指标，监控净值偏离风险。

子基金风格飘移风险方面，本基金不会持有风格不够清晰稳定的基金品种。若持仓基金因为基金经理变更或者其他原因导致基金投资风格的变化，则本基金将重新评估该基金品种或基金经理，从而决定是否继续持有该基金。

整体流动性风险方面，本基金将通过严格控制封闭运作的基金、定期开放基金等流动受限基金的投资比例，有效控制流动性风险。

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

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	003949	兴全稳泰债券 A	契约型开放式	623,010,898.64	684,439,773.25	10.65	是
2	000305	中银中高等级	契约型开	223,683,833.86	242,696,959.74	3.78	否

		债券 A	放式				
3	004705	南方祥元债券 A	契约型开放式	207,937,320.48	228,835,021.19	3.56	否
4	000032	易方达信用债券 A	契约型开放式	204,225,033.84	228,017,250.28	3.55	否
5	040040	华安纯债债券 A	契约型开放式	210,631,766.79	227,376,992.25	3.54	否
6	002650	东方红稳添利纯债债券 A	契约型开放式	209,914,415.84	227,127,397.94	3.53	否
7	006884	添富 AAA 级信用纯债 A	契约型开放式	175,140,333.21	195,579,210.10	3.04	否
8	164808	工银四季收益债券 (LOF)	上市契约型开放式 (LOF)	166,605,036.25	183,515,447.43	2.86	否
9	007584	鹏华丰鑫债券	契约型开放式	148,498,361.13	155,106,538.20	2.41	否
10	002169	永赢稳益债券	契约型开放式	142,206,679.65	153,810,744.71	2.39	否
11	002245	泰康稳健增利债券 A	契约型开放式	105,715,740.02	137,589,035.64	2.14	否
12	007321	鹏华金利债券	契约型开放式	128,356,587.33	136,853,793.41	2.13	否

13	003327	万家鑫璟纯债债券 A	契约型开放式	115,196,689.14	136,715,430.67	2.13	否
14	006874	创金合信恒兴中短债债券 A	契约型开放式	119,309,765.80	136,597,750.86	2.13	否
15	004200	博时富瑞纯债债券 A	契约型开放式	129,790,843.17	136,488,050.68	2.12	否
16	006591	广发景明中短债 A	契约型开放式	132,053,177.87	136,371,316.79	2.12	否
17	519782	交银裕隆纯债债券 A	契约型开放式	96,716,292.73	121,543,365.07	1.89	否
18	000355	南方丰元信用增强债券 A	契约型开放式	81,609,700.52	106,108,932.62	1.65	否
19	000191	富国信用债债券 A	契约型开放式	86,146,623.02	101,549,639.22	1.58	否
20	100058	富国产业债债券 A	契约型开放式	85,983,662.94	101,202,771.28	1.57	否
21	513500	标普 500ETF	交易型开放式 (ETF)	34,280,500.00	98,693,559.50	1.54	否
22	159920	恒生 ETF	交易型开放式 (ETF)	76,516,200.00	92,737,634.40	1.44	否
23	004042	华夏鼎茂债券	契约型开	76,516,748.85	91,238,571.33	1.42	否

		A	放式				
24	007616	富国投资级信用债债券 A	契约型开放式	86,930,358.35	91,181,252.87	1.42	否
25	006151	南方交元债券	契约型开放式	85,966,624.27	91,176,201.70	1.42	否
26	510900	H 股 ETF	交易型开放式 (ETF)	84,851,200.00	75,687,270.40	1.18	否
27	100032	富国中证红利指数增强 A	契约型开放式	63,366,952.43	75,660,141.20	1.18	否
28	004388	鹏华丰享债券	契约型开放式	64,019,245.97	73,218,811.62	1.14	否
29	000628	大成高新技术产业股票 A	契约型开放式	17,006,519.27	68,978,442.16	1.07	否
30	001235	中银国有企业债 A	契约型开放式	63,663,263.07	68,819,987.38	1.07	否
31	450009	国富中小盘股票	契约型开放式	22,952,945.68	63,809,188.99	0.99	否
32	166009	中欧新动力混合 (LOF) A	上市契约型开放式 (LOF)	16,143,083.92	61,088,658.17	0.95	否
33	001040	新华策略精选	契约型开	26,019,775.36	59,673,752.81	0.93	否

		股票	放式				
34	002076	浙商中证 500 指数增强 A	契约型开放式	30,514,680.80	55,707,601.27	0.87	否
35	004127	鹏华丰康债券	契约型开放式	47,929,849.89	54,131,972.47	0.84	否
36	005577	交银丰晟收益债券 A	契约型开放式	47,941,203.08	53,636,618.01	0.83	否
37	004761	国寿安保稳瑞混合 C	契约型开放式	39,083,873.99	51,821,308.52	0.81	否
38	004280	国寿安保稳荣混合 C	契约型开放式	42,964,265.70	51,368,076.07	0.80	否
39	007663	平安安享灵活配置混合 C	契约型开放式	37,083,735.07	51,268,263.73	0.80	否
40	002462	中银珍利混合 C	契约型开放式	42,408,821.03	51,102,629.34	0.80	否
41	163417	兴全合宜混合 (LOF) A	上市契约型开放式 (LOF)	26,112,862.00	51,089,814.50	0.79	是
42	002186	国联安鑫享灵活配置混合 C	契约型开放式	42,724,087.84	50,803,212.85	0.79	否
43	003127	长信易进混合 C	契约型开放式	40,280,351.24	50,644,485.61	0.79	否



44	007686	东方价值挖掘 灵活配置混合 C	契约 型开 放式	41,663,194.73	49,625,031.24	0.77	否
45	000186	华泰柏 瑞季季 红债券	契约 型开 放式	42,951,236.38	46,078,086.39	0.72	否
46	005313	万家中 证 1000 指数 A	契约 型开 放式	29,595,350.23	39,790,948.38	0.62	否
47	005354	富国沪 港深行 业精选 灵活配 置混合 型发起 式 A	契约 型开 放式	26,368,630.53	38,521,932.34	0.60	否
48	512800	银行 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	28,728,600.00	32,520,775.20	0.51	否
49	090007	大成策 略回报 混合	契约 型开 放式	22,839,618.84	31,335,957.05	0.49	否
50	006039	国富估 值优势 混合	契约 型开 放式	11,301,313.90	29,586,839.79	0.46	否
51	163412	兴全轻 资产混 合 (LOF)	上市 契约 型开 放式 (LOF)	5,588,580.12	23,231,727.56	0.36	是
52	515780	浦银 MSCI 中国	交易 型开 放式	12,715,200.00	20,713,060.80	0.32	否

		ETF	(ETF)				
53	260112	景顺长城能源基建混合	契约型开放式	11,172,625.69	20,591,149.15	0.32	否
54	340006	兴全全球视野股票	契约型开放式	6,206,387.03	20,540,037.88	0.32	是
55	006567	中泰星云灵活配置混合 A	契约型开放式	8,859,307.17	20,490,691.55	0.32	否
56	007449	兴全多维价值混合 A	契约型开放式	9,678,668.22	20,318,428.19	0.32	是
57	340008	兴全有机增长混合	契约型开放式	4,347,920.60	20,230,874.55	0.31	是
58	007143	国投瑞银沪深 300 指数量化增强 A	契约型开放式	12,720,423.39	20,124,981.85	0.31	否
59	340007	兴全社会责任混合	契约型开放式	3,298,153.03	18,852,242.72	0.29	是
60	163415	兴全商业模式优选混合 (LOF)	上市契约型开放式 (LOF)	2,853,600.00	11,363,035.20	0.18	是
61	163409	兴全绿色投资混合 (LOF)	上市契约型开放式 (LOF)	4,471,395.00	11,129,302.16	0.17	是

62	512090	MSCIA 股 ETF 易方达	交易 型开 放式 (ETF)	2,250,700.00	4,062,513.50	0.06	否
63	512170	医疗 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	4,834,000.00	3,272,618.00	0.05	否
64	501078	科创配 置 LOF	上市 契约 型开 放式 (LOF)	1,251,100.00	3,156,525.30	0.05	否
65	501079	科创大 成	契约 型开 放式	1,186,400.00	2,831,936.80	0.04	否
66	501077	科创富 国	契约 型开 放式	1,162,300.00	2,811,603.70	0.04	否
67	501075	科创主 题	上市 契约 型开 放式 (LOF)	928,000.00	1,993,344.00	0.03	否
68	501082	科创投 资 LOF	上市 契约 型开 放式 (LOF)	593,900.00	1,240,657.10	0.02	否
69	501073	科创混 合	上市 契约 型开 放式 (LOF)	954,265.00	1,082,136.51	0.02	否
70	501085	财通科 创 3 年 封闭	契约 型开 放式	620,600.00	999,786.60	0.02	否

71	161912	社会责任定开	上市契约型开放式(LOF)	349,300.00	905,385.60	0.01	否
72	501076	科创基金	上市契约型开放式(LOF)	424,456.00	679,978.51	0.01	否
73	501083	科创银华	上市契约型开放式(LOF)	164,114.00	302,297.99	0.00	否
74	501081	科创中欧	上市契约型开放式(LOF)	124,000.00	248,124.00	0.00	否
75	501080	科创主题投资基金	上市契约型开放式(LOF)	99,700.00	173,876.80	0.00	否
76	163407	兴全沪深300指数(LOF)A	上市契约型开放式(LOF)	30,600.00	78,409.44	0.00	是
77	160726	嘉实瑞享定开	上市契约型开放式(LOF)	30,000.00	37,800.00	0.00	否
78	169106	东方红创优定	上市契约	700.00	695.80	0.00	否

		开	型开 放式 (LOF)				
--	--	---	-------------------	--	--	--	--

### 8.13 投资组合报告附注

#### 8.13.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查的情形，未出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

#### 8.13.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

#### 8.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	81,823.38
2	应收证券清算款	1,252,033.48
3	应收股利	-
4	应收利息	2,852,565.82
5	应收申购款	309,970.16
6	其他应收款	221.91
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,496,614.75

#### 8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110053	苏银转债	4,855,127.20	0.08
2	113044	大秦转债	3,956,256.00	0.06
3	128129	青农转债	2,726,370.90	0.04

#### 8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300793	佳禾智能	10,949,137.98	0.17	非公开发行流通受限
2	300383	光环新网	9,540,286.46	0.15	非公开发行流通受限

3	002938	鹏鼎控股	7,930,000.00	0.12	大宗交易购入 流通受限
4	300451	创业慧康	7,364,000.00	0.11	大宗交易购入 流通受限
5	002607	中公教育	6,372,400.00	0.10	大宗交易购入 流通受限
6	002851	麦格米特	3,919,500.00	0.06	大宗交易购入 流通受限

### 8.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 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（%）
53,708	118,198.16	69,298,800.43	1.09	6,278,887,997.30	98.91

### 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	298,596.08	0.0047

### 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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	0~10
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（2021年9月17日）基金份额总额	6,344,209,810.91
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	3,976,986.82
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-

本报告期末基金份额总额	6,348,186,797.73
-------------	------------------

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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

### 11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日（2021 年 9 月 17 日）起聘请毕马威华振会计师事务所（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 6 万元人民币。

### 11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门的稽查或处罚。

### 11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
兴业证券	4	164,379,859.79	96.07%	138,578.57	97.03%	-
中信证券	5	6,723,194.66	3.93%	4,244.37	2.97%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	4	-	-	-	-	-
国都证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
摩根大通 证券	2	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证 券	2	-	-	-	-	-



天风证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
东方财富 证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中国中金 财富证券	4	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	4	-	-	-	-	-
中信建投 证券	5	-	-	-	-	-

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。

### 11.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期 债券 成交总 额的比例	成交金额	占当期 债券 回购 成交总 额的比例	成交金额	占当 期 权 证 成 交 总 额 的 比 例	成交金额	占当期 基金 成交总 额的比例
兴业 证券	2,698,961.65	23.65%	400,000,000.00	50.00%	-	-	195,905,810.37	46.16%
中信 证券	8,715,231.50	76.35%	400,000,000.00	50.00%	-	-	228,459,160.13	53.84%
安信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
渤海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦	-	-	-	-	-	-	-	-

证券								
东方 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国都 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰 君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华福 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
摩根 大通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
南京 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万 宏源 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平 洋证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
万联 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方 财富	-	-	-	-	-	-	-	-

证券								
信达 证券								
银河 证券								
招商 证券								
中国 中金 财富 证券								
中金 公司								
中泰 证券								
中信 建投 证券								

### 11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同	证券日报、规定互联网网站	2021-08-19
2	兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议	证券日报、规定互联网网站	2021-08-19
3	兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）招募说明书	证券日报、规定互联网网站	2021-08-19
4	兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）发售公告	证券日报、规定互联网网站	2021-08-19
5	兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金产品资料概要	证券日报、规定互联网网站	2021-08-19
6	关于开展兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）网上直销认购费率优惠活动的公告	证券日报、规定互联网网站	2021-08-27
7	关于增加兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）销售机构的公告	证券日报、规定互联网网站	2021-09-06
8	关于增加兴证全球安悦稳健养老目	证券日报、规定互联网	2021-09-13

	标一年持有期混合型基金中基金（FOF）销售机构的公告	网站	
9	关于兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）提前结束募集的公告	证券日报、规定互联网网站	2021-09-15
10	兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同生效公告	证券日报、规定互联网网站	2021-09-18
11	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	证券日报、规定互联网网站	2021-11-24
12	兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）开放日常申购（含定投）、转换转入业务的公告	证券日报、规定互联网网站	2021-12-08
13	关于兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）参加部分销售机构申购、定投费率优惠活动的公告	证券日报、规定互联网网站	2021-12-09
14	关于旗下部分基金投资佳禾智能（300793）非公开发行股票的公告	证券日报、规定互联网网站	2021-12-10
15	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	证券日报、规定互联网网站	2021-12-10
16	关于旗下公开募集证券投资基金投资北交所股票的风险提示性公告	证券日报、规定互联网网站	2021-12-24
17	关于旗下部分基金投资光环新网（300383）非公开发行股票的公告	证券日报、规定互联网网站	2021-12-31

## § 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。

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。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金为养老目标基金，致力于满足投资者的养老资金理财需求，但养老目标基金并不代表收益保障或其他任何形式的收益承诺，存在投资者承担亏损的可能性。

2、本基金每份基金份额的最短持有期限为 1 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 1 年（1 年指 365 天，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 1 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、中国证监会准予兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）募集注册的文件；

2、《兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》；

3、《兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议》；

4、关于申请募集注册兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）的法

律意见书；

- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

### 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