

兴全安泰积极养老目标五年持有期混合型 发起式基金中基金（FOF） 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：兴证全球基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 08 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	49
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	49

7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	49
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	49
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	49
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12	本报告期投资基金情况	49
7.13	投资组合报告附注	错误!未定义书签。
§ 8	基金份额持有人信息	58
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	59
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况	59
§ 9	开放式基金份额变动	59
§ 10	重大事件揭示	60
10.1	基金份额持有人大会决议	60
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	60
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4	基金投资策略的改变	60
10.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件	60
10.6	为基金进行审计的会计师事务所情况	62
10.7	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	62
10.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况	62
10.9	其他重大事件	64
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	64
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	64
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	65
§ 12	备查文件目录	65
12.1	备查文件目录	65
12.2	存放地点	65
12.3	查阅方式	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴全安泰积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）
基金简称	兴全安泰积极养老五年持有混合发起式 FOF
基金主代码	010267
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 12 月 16 日
基金管理人	兴证全球基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,026,005,868.62 份
基金合同存续期	不定期

注：本基金每份基金份额的最短持有期限为 5 年。

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		兴证全球基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨卫东	李真
	联系电话	021-20398888	021-52629999-212051
	电子邮箱	yangwd@xqfunds.com	tgb_lizhen@cib.com.cn
客户服务电话		4006780099, 021-38824536	95561
传真		021-20398858	021-62159217
注册地址		上海市黄浦区金陵东路 368 号	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦
办公地址		上海市浦东新区芳甸路 1155 号嘉里城办公楼 28-29 楼	上海市银城路 167 号兴业大厦 4 楼
邮政编码		201204	200120
法定代表人		杨华辉	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.xqfunds.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	兴证全球基金管理有限公司	上海市浦东新区芳甸路 1155 号 嘉里城办公楼 28-29 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	4,993,487.85
本期利润	-62,871,299.71
加权平均基金份额本期利润	-0.0615
本期加权平均净值利润率	-6.14%
本期基金份额净值增长率	-5.69%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	30,236,287.92
期末可供分配基金份额利润	0.0295
期末基金资产净值	1,056,242,156.54
期末基金份额净值	1.0295
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	2.95%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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	份额净值增长率标	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	--------	----------	------------	--------------	-----	-----

	率①	准差②		④		
过去一个月	5.35%	0.69%	7.36%	0.83%	-2.01%	-0.14%
过去三个月	4.42%	0.97%	6.48%	1.07%	-2.06%	-0.10%
过去六个月	-5.69%	0.96%	-6.75%	1.06%	1.06%	-0.10%
过去一年	-3.31%	0.78%	-8.81%	0.91%	5.50%	-0.13%
自基金合同生效起至今	2.95%	0.69%	1.33%	0.94%	1.62%	-0.25%

注：本基金业绩比较基准为：中证偏股型基金指数收益率×70%+中债综合（全价）指数收益率×30%。采用该业绩比较基准主要基于以下考虑：中证偏股型基金指数选取内地市场所有股票型基金以及混合型基金中以股票为主要投资对象的基金作为样本，采用净值规模加权，以较好的反映所有偏股型开放式证券投资基金的整体走势。本基金主要投资于公开募集的证券投资基金，且原则上会以70%的基金资产投资于权益类资产，因此本基金业绩比较基准中的70%选择了中证偏股型基金指数收益率。中债综合（全价）指数由中央国债登记结算有限公司编制，旨在综合反映债券市场整体价格和投资回报情况，是具有代表性的债券市场指数。选用以上业绩比较基准可以有效评估本基金投资组合业绩，反映本基金的风格特点。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，按下列公式计算：

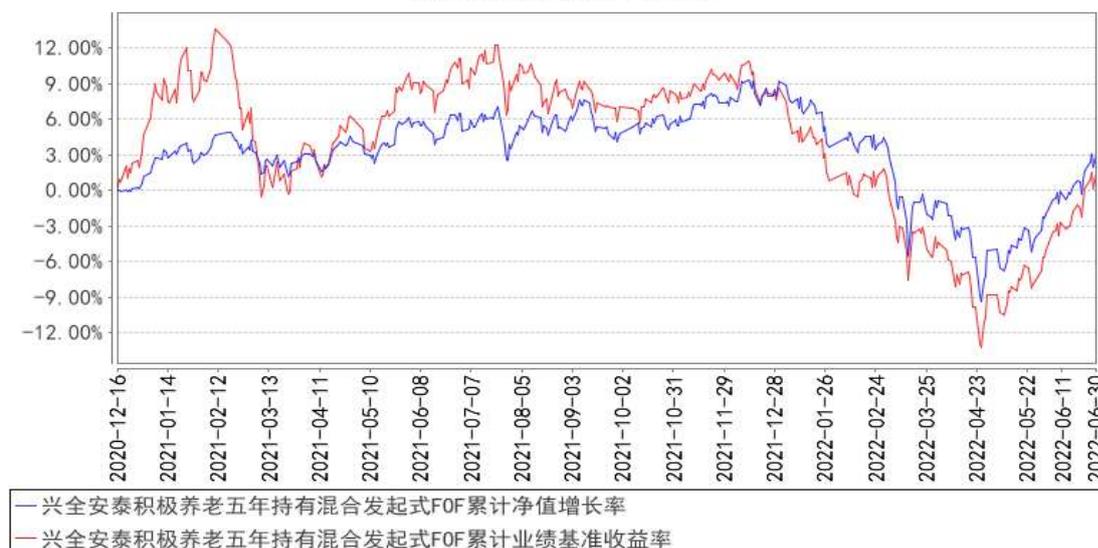
$$\text{Return}_t = 70\% \times (\text{中证偏股型基金指数收益率}_t / \text{中证偏股型基金指数收益率}_{t-1} - 1) + 30\% \times (\text{中债综合（全价）指数收益率}_t / \text{中债综合（全价）指数收益率}_{t-1} - 1)$$

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

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

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

兴全安泰积极养老五年持有混合发起式FOF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、净值表现所取数据截至到 2022 年 06 月 30 日。

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

3.3 其他指标

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

兴证全球基金管理有限公司（成立时名为“兴业基金管理有限公司”，以下简称“公司”）经证监基金字[2003]100 号文批准于 2003 年 9 月 30 日成立。2008 年 1 月，中国证监会批复（证监许可[2008]6 号），同意全球人寿保险国际公司（AEGON International B.V）受让公司股权并成为公司股东。2008 年 4 月 9 日，公司完成股权转让、变更注册资本等相关手续后，公司注册资本由 9800 万元变更为人民币 1.2 亿元，其中兴业证券股份有限公司的出资占注册资本的 51%，全球人寿保险国际公司的出资占注册资本的 49%。2008 年 7 月，经中国证监会批准（证监许可[2008]888 号），公司于 2008 年 8 月 25 日完成变更公司名称、注册资本等相关手续后，公司名称变更为“兴业全球基金管理有限公司”，注册资本增加为 1.5 亿元人民币，其中两股东出资比例

不变。2016 年 12 月 28 日，因公司发展需要，公司名称变更为“兴全基金管理有限公司”。2020 年 3 月 18 日，公司名称变更为“兴证全球基金管理有限公司”。

截止 2022 年 6 月 30 日，公司旗下共 50 只基金，品种涵盖货币型、债券型、混合型、股票型、指数型、FOF 等不同类型，建立了覆盖高中低等级的公募基金产品线，为各类风险偏好的投资者提供便捷、专业的投资理财服务。

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 投资与金融工程部总监、养老金管理部总监，兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）、兴全安泰稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、兴全安泰积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金	2020 年 12 月 16 日	-	15 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。

	(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 (FOF-LO F)、兴证 全球优选 稳健六个 月持有期 债券型基 金中基金 (FOF)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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本报告期末，本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划的投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全安泰积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》和其他相关法律法规的规定，

本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年上半年股票市场在快速下跌后 V 型反弹，1-4 月份相对热门的“新半军”板块出现了较大幅度的调整，5、6 月份前期跌幅相对较大的行业和板块又出现快速上涨，尤其是以新能源、汽车、军工等行业涨幅领先。从整个上半年来看，沪深 300 指数下跌 9.22% 上证 50 指数下跌 6.59%，中证 500 和中证 1000 指数分别下跌 12.30% 和 12.67%，创业板 50 下跌 15.41%；以高股息股票为主要标的的上证红利和中证红利指数表现相对较好，涨跌幅分别为 3.09% 和 -1.99%。从行业表现上来看，煤炭行业一枝独秀，上半年涨幅 31.38%，交通运输、综合、美容护理、房地产、有色、银行等行业跌幅相对较小，而电子、计算机、传媒、军工行业半年跌幅在 20% 以上；从风格指数上来看，低市盈率指数表现优于中、高市盈率指数，大盘指数表现优于中、小盘指数。有一个值得注意的现象是，自 4 月 27 日市场反弹以来，中、高市盈率指数表现大幅优于低市盈率指数，行业上分化也是非常明显，银行、地产涨幅不足 5%，而电力设备、汽车的区间涨幅在 50% 附近。

债券市场方面，上半年债市总体呈现震荡走势，十年国债收益率在 2.70-2.85 的狭窄区间内震荡。同时，疫情背景下央行维持宽松货币政策，收益率曲线呈陡峭化态势，短端收益率下行明显，1 年期国债收益率由 2.24 下降到 1.95。信用债走势整体强于利率债，中低资质信用债收益率下行更多，信用利差已被压缩至历史极低位置。

上半年，中证偏股基金指数下跌 10.02%，中长期纯债基金指数上涨 1.41%，标普 500ETF 下跌 16.43%，黄金 ETF 上涨 4.49%。

资产配置层面，本基金坚持 70%的权益类资产和 30%的固定收益类资产的战略资产配置；在战术资产配置上，在前期的市场快速下跌过程中，不断通过再平衡保持组合维持在一个相对稳定的权益仓位，4 月下旬以后随着市场逐步进入相对低估区间，逢低增加组合的权益配置比例，降低欠配幅度至平配，后续随着市场的快速反弹，7 月中旬将权益配置比例调回至略欠配状态。

品种选择层面，本基金的基金选择思路更侧重于从基金经理的投资风格和盈利模式角度出发，所以更加倾向于对风格稳定的基金经理长期持有。目前组合在风格配置上，以追求安全边际的价值型基金和追求性价比的 GARP 型基金配置为主，场内封闭式基金随着开放赎回进行逐步减持；同时，4 月份以后积极参与股票定增和大宗交易，通过有折价的方式参与部分成长股的投资。

上半年整体组合跑赢业绩比较基准，组合的波动率、最大回撤方面整体控制依然相对良好。

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 1.0295 元；本报告期基金份额净值增长率为-5.69%，业绩比较基准收益率为-6.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前国内、外宏观形势均处于比较复杂的阶段，海外通胀水平维持高位，俄乌战争仍在继续，IMF 不断下调全球的经济预期，美国市场预期未来经济衰退的概率上升。国内的经济数据在货币宽松、财政发力的政策作用下逐步从四、五月份的疫情中逐步复苏，但后续的经济增长情况仍需进一步的观察。

自 2019 年以来的市场大幅上涨，市场分化尤为显著，资金对于成长性的追逐已处于一个相对“白热化”阶段，2019、2020 年对于盈利质量的长期成长逻辑的过分追捧，2021 年以及今年 4 月底反弹以来对于短期景气度的高度关注，说明当前市场在存量资金博弈的过程中，相对看重短期的景气数据，而对于安全边际、长期配置方面的考量相对较少，从而可能会导致股票市场出现较大幅度的波动和快速轮动。

基于中长期的角度来看，我们依然看好 A 股市场的长期震荡上行的方向，但从中短期而言，目前新增资金相对缺乏，在存量资金博弈的背景下，我们更加倾向于重视“安全边际”和“性价比”，对于高估值的领域和板块保持适度谨慎，同时做好板块之间的再平衡，始终把组合的安全边际作为重要考量，积极把握市场上确定性较高的相对收益或绝对收益的投资机会。此外，我们将继续按照“多资产、多策略”的方式来构建组合，随着海外市场的大幅下跌，也将逢低增加海外 QDII 基金的配置比例，从而增加组合的收益来源，进一步平滑未来的组合的业绩波动率。

目前债券市场收益率处于一个相对偏低的水平，考虑到未来的收益率预期和费率情况，目前组合会将小部分的固定收益类资产配置于货币市场基金。

本基金是一只积极型的养老目标基金，权益类资产的配置中枢为 70%，我们将秉承勤勉尽责的态度进行组合管理，遵守契约要求、保持策略的稳定性，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和养老储备。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金为发起式基金，截至报告期末成立不满三年，本项不适用。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

利益的行为。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：兴全安泰积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	11,660,197.73	19,918,895.46
结算备付金		34,564.79	254,167.71
存出保证金		23,487.76	54,477.82
交易性金融资产	6.4.7.2	1,024,338,776.89	1,074,240,936.04
其中：股票投资		45,375,031.13	75,597,453.16
基金投资		970,536,823.79	988,271,316.35
债券投资		8,426,921.97	10,372,166.53
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	9,000,000.00	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-

应收清算款		12,002,203.20	10,872,827.16
应收股利		-	-
应收申购款		86,081.18	2,458,846.99
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	24,165.20
资产总计		1,057,145,311.55	1,107,824,316.38
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		573,146.36	628,855.72
应付托管费		117,459.28	129,466.09
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		62.03	95.21
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	212,487.34	259,341.05
负债合计		903,155.01	1,017,758.07
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	1,026,005,868.62	1,013,961,238.14
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	30,236,287.92	92,845,320.17
净资产合计		1,056,242,156.54	1,106,806,558.31
负债和净资产总计		1,057,145,311.55	1,107,824,316.38

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0295 元，基金份额总额 1,026,005,868.62 份。以上比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号（年度报告和中期报告）》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年度末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年度末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

6.2 利润表

会计主体：兴全安泰积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-58,588,632.57	56,892,870.00
1. 利息收入		69,117.97	533,168.11
其中：存款利息收入	6.4.7.13	35,629.04	113,113.82
债券利息收入		-	391,780.29
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		33,488.93	28,274.00
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		9,207,037.02	17,675,508.07
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-1,390,315.16	11,732,053.22
基金投资收益	6.4.7.15	879,096.30	1,059,843.39
债券投资收益	6.4.7.16	252,977.18	-267,550.00
资产支持证券投资	6.4.7.17	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-	-
股利收益	6.4.7.20	9,465,278.70	5,151,161.46
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-67,864,787.56	38,683,363.06
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	-	830.76
减：二、营业总支出		4,282,667.14	4,657,695.44
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,476,777.03	3,440,526.33
2. 托管费	6.4.10.2.2	710,694.40	692,345.06
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费	6.4.10.2.1.1	-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.23	-	-
7. 税金及附加		403.15	4.62
8. 其他费用	6.4.7.24	94,792.56	524,819.43

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-62,871,299.71	52,235,174.56
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-62,871,299.71	52,235,174.56
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-62,871,299.71	52,235,174.56

注：以上比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号（年度报告和中期报告）》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：兴全安泰积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	1,013,961,238.14	-	92,845,320.17	1,106,806,558.31
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本年期初净资产(基金净值)	1,013,961,238.14	-	92,845,320.17	1,106,806,558.31
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	12,044,630.48	-	-62,609,032.25	-50,564,401.77
(一)、综合收	-	-	-62,871,299.71	-62,871,299.71

益总额				
(二)、 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)	12,044,630.48	-	262,267.46	12,306,897.94
其中:1. 基金申购款	12,044,630.48	-	262,267.46	12,306,897.94
2 .基金赎回款	-	-	-	-
(三)、 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)	-	-	-	-
(四)、 其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	1,026,005,868.62	-	30,236,287.92	1,056,242,156.54
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基	968,588,783.01	-	11,067,798.65	979,656,581.66

金净值)				
加:会计 政策变 更	-	-	-	-
前 期差 错 更 正	-	-	-	-
其 他	-	-	-	-
二、本 期 初 净 资 产 (基 金 净 值)	968,588,783.01	-	11,067,798.65	979,656,581.66
三、本 期 增 减 变 动 额 (减 少 以 “-” 号 填 列)	20,136,178.59	-	52,915,740.76	73,051,919.35
(一)、 综 合 收 益 总 额	-	-	52,235,174.56	52,235,174.56
(二)、 本 期 基 金 份 额 交 易 产 生 的 基 金 净 值 变 动 数 (净 值 减 少 以 “-” 号 填 列)	20,136,178.59	-	680,566.20	20,816,744.79
其中:1. 基 金 申 购 款	20,136,178.59	-	680,566.20	20,816,744.79
2 .基 金 赎 回 款	-	-	-	-
(三)、 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)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	988,724,961.60	-	63,983,539.41	1,052,708,501.01

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

杨华辉

庄园芳

詹鸿飞

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金（包括 QDII 基金和香港互认基金）、国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板以及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、证券公司短期公司债券、可转换债券（含可分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、

中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告不一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《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》（统称“新金融工具准则”）相关规定，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》公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。本基金在编制本中期财务报表时已采用该准则，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初基金净值，2021 年的比较数据将不作重述。

金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益

工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

（2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、其他金融负债。

金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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。

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和金融负债，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；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变

化情况；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，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；

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。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债(含交易性金融负债和衍生金融负债)，按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于其他金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

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) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 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；

(6) 公允价值变动收益系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资产、以公允价值计量且其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) 其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。于首次执行日，本基金因执行新金融工具准则调减期初基金净值人民币 0 元。

本基金执行新金融工具准则的影响如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应付交易费用和其他负债，金额分别为人民币 19,918,895.46 元、人民币 254,167.71 元、人民币 54,477.82 元和人民币 24,088.30 元、人民币 91,341.05 元和人民币 168,000.00 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金、和其他负债。本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在银行存款、结算备付金和存出保证金等项目中，不单独列示应收利息项目或应付利息项目。新金融工具准则下，银行存款、结算备付金和存出保证金的金额分别为人民币 19,921,201.17 元、人民币 254,293.55 元、人民币 54,504.88 元和人民币 259,341.05 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产，金额为人民币 1,074,240,936.04 元，归属于交易性金融资产的应收利息金额为人民币 21,629.69 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产，金额为人民币 1,074,262,565.73 元。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，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试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金(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、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，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，暂不征收企业所得税。

6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金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，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	11,660,197.73
等于：本金	11,657,880.40
加：应计利息	2,317.33

减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	11,660,197.73

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	47,674,815.71	-	45,375,031.13	-2,299,784.58	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	8,318,285.74	32,567.00	8,426,921.97	76,069.23
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	8,318,285.74	32,567.00	8,426,921.97	76,069.23
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	978,971,451.88	-	970,536,823.79	-8,434,628.09	
其他	-	-	-	-	
合计	1,034,964,553.33	32,567.00	1,024,338,776.89	-10,658,343.44	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	9,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	9,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未通过买断式逆回购交易取得债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本报告期内本基金无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本报告期内本基金未发生债权投资减值准备。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

注：无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	8,184.78
其中：交易所市场	8,184.78
银行间市场	-
应付利息	-
预提信息披露费	179,507.37
预提审计费用	24,795.19
合计	212,487.34

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,013,961,238.14	1,013,961,238.14
本期申购	12,044,630.48	12,044,630.48
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	1,026,005,868.62	1,026,005,868.62

6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

6.4.7.12 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
本期期初	34,249,356.93	58,595,963.24	92,845,320.17
本期利润	4,993,487.85	-67,864,787.56	-62,871,299.71
本期基金份额交易产生的变动数	464,285.34	-202,017.88	262,267.46

其中：基金申购款	464,285.34	-202,017.88	262,267.46
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	39,707,130.12	-9,470,842.20	30,236,287.92

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2022年1月1日至2022年6月30日	
活期存款利息收入		33,062.65
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		1,753.78
其他		812.61
合计		35,629.04

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2022年1月1日至2022年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		-1,390,315.16
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		-1,390,315.16

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2022年1月1日至2022年6月30日	
卖出股票成交总额		22,159,333.62
减：卖出股票成本总额		23,509,563.67
减：交易费用		40,085.11
买卖股票差价收入		-1,390,315.16

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2022年1月1日至2022年6月30日	

卖出/赎回基金成交总额	72,726,319.71
减：卖出/赎回基金成本总额	71,697,342.70
减：买卖基金差价收入应缴纳增值 税额	1,153.26
减：交易费用	148,727.45
基金投资收益	879,096.30

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	34,830.44
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券 到期兑付）差价收入	218,146.74
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	252,977.18

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总 额	3,021,127.79
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成 本总额	2,799,184.66
减：应计利息总额	3,775.57
减：交易费用	20.82
买卖债券差价收入	218,146.74

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.18 贵金属投资收益**6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成**

注：贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.19 衍生工具收益**6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：

本基金本报告期内未进行衍生工具买卖交易。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	289,840.72
其中：证券出借权益补偿收	-

入	
基金投资产生的股利收益	9,175,437.98
合计	9,465,278.70

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	-67,864,787.56
股票投资	-11,330,074.84
债券投资	-181,399.02
资产支持证券投资	-
基金投资	-56,353,313.70
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	-67,864,787.56

6.4.7.22 其他收入

注：无。

6.4.7.23 持有基金产生的费用

项目	本期费用 2022年1月1日至2022年6月30日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	154,315.56
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	4,678,833.16
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	855,424.01

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

6.4.7.24 信用减值损失

注：无。

6.4.7.25 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	1,490.00
账户维护费	9,000.00
合计	94,792.56

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
兴证全球基金管理有限公司（“兴证全球基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	基金托管人、基金销售机构
兴业证券股份有限公司（“兴业证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
兴业证券	24,258,408.62	100.00	48,715,541.87	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
-------	---------------------------------------	--

	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 成交总额的比例 (%)
兴业证券	3,122,061.76	100.00	-	-

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
兴业证券	206,900,000.00	100.00	50,000,000.00	100.00

6.4.10.1.4 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期基金 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金 成交总额的比例 (%)
兴业证券	44,007,159.42	100.00	324,965,560.03	100.00

6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
兴业证券	15,880.50	100.00	8,184.78	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
兴业证券	33,939.87	100.00	13,551.99	100.00

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用兴业证券股份有限公司证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还从兴业证券股份有限公司获得证券研究综合服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,476,777.03	3,440,526.33
其中：支付销售机构的客户维护费	1,503,132.74	1,490,526.59

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	710,694.40	692,345.06

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

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2020 年 12 月 16 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	30,005,600.53	30,005,600.53
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份 额	-	-
报告期末持有的基金份额	30,005,600.53	30,005,600.53
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	2.9245%	3.0348%

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

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未持有本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	11,660,197.73	33,062.65	21,530,106.05	105,771.08

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本报告期末本基金持有基金管理人兴证全球基金管理有限公司所管理的基金合计
157,546,741.94 元，占本基金资产净值的比例为 14.92%。

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

项目	本期费用 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期交易基金产生的申购费（元）	-	-

当期交易基金产生的赎回费（元）	-	22,992.49
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	-	830.76
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	813,161.39	638,136.91
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	147,489.67	126,058.95

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

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末(2022年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
300383	光环新网	2021年12月29日	6个月	非公开发行流通受限	11.79	10.42	169,635	1,999,996.65	1,767,596.70	-
300769	德方纳米	2022年5月17日	6个月	大宗交易购入流通受限	246.95	372.35	8,500	2,099,075.00	3,164,975.00	-
600938	中国海油	2022年4月14日	6个月	新股流通受限	10.80	15.86	84,004	907,243.20	1,332,303.44	-
688083	中望软件	2022年6月17日	6个月	询价转让流通受限	168.01	190.42	6,188	1,039,645.88	1,178,318.96	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有临时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参加因转融通证券业务而出借的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券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%，投资于单只基金市值不高于本基金资产净值的 20%。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

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

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	7,908,348.34	9,750,907.40
AAA 以下	518,573.63	621,259.13

未评级	-	-
合计	8,426,921.97	10,372,166.53

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

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

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

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

本基金所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易。因此，除在附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

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

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金为发起式定期开放式基金，符合条件的其他投资者可在合同规定的定期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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年6月 30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	11,660,197.73	-	-	-	-	-	11,660,197.73
结算备付金	34,564.79	-	-	-	-	-	34,564.79
存出保证金	23,487.76	-	-	-	-	-	23,487.76
交易性金融资产	-	-	870,880.85	7,556,041.12	-	1,015,911,854.92	1,024,338,776.89
买入返售金融资产	9,000,000.00	-	-	-	-	-	9,000,000.00
应收申购款	20,258.36	-	-	-	-	65,822.82	86,081.18
应收清算款	-	-	-	-	-	12,002,203.20	12,002,203.20
资产总计	20,738,508.64	-	870,880.85	7,556,041.12	-	1,027,979,880.94	1,057,145,311.55
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	573,146.36	573,146.36
应付托管费	-	-	-	-	-	117,459.28	117,459.28
应交税费	-	-	-	-	-	62.03	62.03
其他负债	-	-	-	-	-	212,487.34	212,487.34
负债总计	-	-	-	-	-	903,155.01	903,155.01
利率敏感度缺口	20,738,508.64	-	870,880.85	7,556,041.12	-	1,027,076,725.93	1,056,242,156.54
上年度末 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	19,918,895.46	-	-	-	-	-	19,918,895.46
结算备付金	254,167.71	-	-	-	-	-	254,167.71
存出保证金	54,477.82	-	-	-	-	-	54,477.82
交易性金融资产	-	-	-	10,052,702.53	319,464.00	1,063,868,769.51	1,074,240,936.04
应收申购款	271,509.34	-	-	-	-	2,187,337.65	2,458,846.99
应收证券清算款	-	-	-	-	-	10,872,827.16	10,872,827.16
其他资产	-	-	-	-	-	24,165.20	24,165.20
资产总计	20,499,050.33	-	-	10,052,702.53	319,464.00	1,076,953,099.52	1,107,824,316.38
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	628,855.72	628,855.72
应付托管费	-	-	-	-	-	129,466.09	129,466.09
应交税费	-	-	-	-	-	95.21	95.21
其他负债	-	-	-	-	-	259,341.05	259,341.05
负债总计	-	-	-	-	-	1,017,758.07	1,017,758.07
利率敏感度缺口	20,499,050.33	-	-	10,052,702.53	319,464.00	1,075,935,341.45	1,106,806,558.31

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：无。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金投资于经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金的资产比例不低于基金资产

的 80%，其中，股票、股票型基金、混合型基金等权益类资产投资合计占基金资产的比例为 60%–95%，投资于货币市场基金的资产占基金资产的比例不高于 15%。本基金应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	45,375,031.13	4.30	75,597,453.16	6.83
交易性金融资产—基金投资	970,536,823.79	91.89	988,271,316.35	89.29
交易性金融资产—债券投资	8,426,921.97	0.80	10,372,166.53	0.94
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	1,024,338,776.89	96.98	1,074,240,936.04	97.06

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假设单个证券的公允价值和市场组合的公允价值依照资本-资产定价模型 (CAPM) 描述的规律进行变动		
	使用本基金业绩比较基准所对应的市场组合进行分析		
	在业绩基准变化 10% 时，对单个证券相应的公允价值变化进行加总得到基金净值的变化		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准上升 10%	96,512,828.94	78,533,750.90
	业绩比较基准下降	-96,512,828.94	-78,533,750.90

	10%		
--	-----	--	--

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

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，被划分为三个层次：

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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	1,016,557,202.13	1,045,099,193.43
第二层次	338,380.66	5,504.49
第三层次	7,443,194.10	29,136,238.12
合计	1,024,338,776.89	1,074,240,936.04

注：根据中国证监会 2022 年 5 月 26 日发布的证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号《年度报告和中期报告》模板，本基金对上年度末公允价值层次进行追溯调整。

6.4.14.2.2 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，本基金不会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将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并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还是第

三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2021 年 12 月 31 日：无）。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括货币资金、应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	45,375,031.13	4.29
	其中：股票	45,375,031.13	4.29
2	基金投资	970,536,823.79	91.81
3	固定收益投资	8,426,921.97	0.80
	其中：债券	8,426,921.97	0.80
	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	9,000,000.00	0.85
	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	11,694,762.52	1.11
8	其他各项资产	12,111,772.14	1.15
9	合计	1,057,145,311.55	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,332,303.44	0.13
C	制造业	29,888,316.43	2.83
D	电力、热力、燃气及水生产和	-	-

	供应业		
E	建筑业		-
F	批发和零售业		-
G	交通运输、仓储和邮政业		-
H	住宿和餐饮业		-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,348,365.66	0.70
J	金融业	942,242.00	0.09
K	房地产业	3,830,724.00	0.36
L	租赁和商务服务业		-
M	科学研究和技术服务业	1,085,655.60	0.10
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		-
Q	卫生和社会工作		-
R	文化、体育和娱乐业	947,424.00	0.09
S	综合		-
	合计	45,375,031.13	4.30

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600048	保利发展	219,400	3,830,724.00	0.36
2	002920	德赛西威	25,600	3,788,800.00	0.36
3	300769	德方纳米	8,500	3,164,975.00	0.30
4	600690	海尔智家	110,600	3,037,076.00	0.29
5	002415	海康威视	72,225	2,614,545.00	0.25
6	600309	万华化学	25,300	2,453,847.00	0.23
7	002475	立讯精密	58,900	1,990,231.00	0.19
8	300760	迈瑞医疗	6,000	1,879,200.00	0.18
9	300383	光环新网	169,635	1,767,596.70	0.17
10	688099	晶晨股份	16,407	1,657,107.00	0.16
11	600938	中国海油	84,004	1,332,303.44	0.13
12	600519	贵州茅台	600	1,227,000.00	0.12
13	688083	中望软件	6,188	1,178,318.96	0.11
14	603799	华友钴业	11,960	1,143,615.20	0.11
15	002555	三七互娱	52,300	1,110,329.00	0.11
16	000568	泸州老窖	4,500	1,109,430.00	0.11

17	603259	药明康德	10,440	1,085,655.60	0.10
18	002493	荣盛石化	64,600	994,194.00	0.09
19	300413	芒果超媒	28,400	947,424.00	0.09
20	000001	平安银行	62,900	942,242.00	0.09
21	300454	深信服	9,000	934,020.00	0.09
22	600885	宏发股份	22,260	931,581.00	0.09
23	603517	绝味食品	15,900	919,338.00	0.09
24	300316	晶盛机电	13,500	912,465.00	0.09
25	600760	中航沈飞	13,800	834,210.00	0.08
26	600862	中航高科	29,000	814,900.00	0.08
27	300327	中颖电子	15,730	783,511.30	0.07
28	600745	闻泰科技	8,400	714,924.00	0.07
29	600570	恒生电子	16,100	700,994.00	0.07
30	000739	普洛药业	25,500	526,320.00	0.05
31	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
32	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300769	德方纳米	2,099,075.00	0.19
2	600938	中国海油	1,296,054.00	0.12
3	688083	中望软件	1,039,645.88	0.09
4	001227	兰州银行	28,088.76	0.00
5	601089	福元医药	25,570.38	0.00
6	001308	康冠科技	25,054.92	0.00
7	001323	慕思股份	22,306.89	0.00
8	603132	金徽股份	14,493.60	0.00
9	603209	兴通股份	12,804.40	0.00
10	001266	宏英智能	9,536.67	0.00
11	603150	万朗磁塑	8,581.69	0.00
12	001268	联合精密	7,873.25	0.00
13	603070	万控智造	7,300.50	0.00
14	603215	比依股份	7,187.50	0.00
15	603051	鹿山新材	7,014.88	0.00
16	001313	粤海饲料	6,628.16	0.00

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
----	------	------	----------	----------------

1	002520	日发精机	2,943,918.62	0.27
2	300850	新强联	2,899,590.30	0.26
3	688186	广大特材	2,491,981.90	0.23
4	300793	佳禾智能	1,953,329.90	0.18
5	002851	麦格米特	1,770,744.00	0.16
6	300451	创业慧康	1,639,772.00	0.15
7	601728	中国电信	1,639,085.76	0.15
8	002938	鹏鼎控股	1,383,424.00	0.12
9	002607	中公教育	1,200,945.00	0.11
10	002415	海康威视	998,640.00	0.09
11	300413	芒果超媒	723,492.60	0.07
12	300768	迪普科技	652,565.84	0.06
13	600938	中国海油	580,160.11	0.05
14	688162	巨一科技	231,573.60	0.02
15	688697	纽威数控	83,469.10	0.01
16	688768	容知日新	75,734.50	0.01
17	600927	永安期货	60,621.99	0.01
18	301155	海力风电	54,369.90	0.00
19	001227	兰州银行	45,944.36	0.00
20	301050	雷电微力	42,741.52	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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	4,617,216.48
卖出股票收入（成交）总额	22,159,333.62

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	8,426,921.97	0.80
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	8,426,921.97	0.80
----	----	--------------	------

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113044	大秦转债	31,050	3,386,253.45	0.32
2	110059	浦发转债	24,270	2,572,590.08	0.24
3	113011	光大转债	8,190	870,880.85	0.08
4	128129	青农转债	6,030	633,160.74	0.06
5	127017	万青转债	4,263	518,573.63	0.05

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.11.2 本期国债期货投资评价

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

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

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

金资产的 60%-75%。因此，相比平衡型和稳健型的目标风险策略基金，本基金的预期收益和预期风险水平可能更高，运作过程中基金净值的波动也可能更剧烈。

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	003949	兴全稳泰债券 A	契约型开放式	47,367,198.21	52,947,054.16	5.01	是
2	000186	华泰柏瑞季季红债券	契约型开放式	30,155,220.91	32,251,008.76	3.05	否
3	110037	易方达纯债债券 A	契约型开放式	28,662,785.94	31,944,674.93	3.02	否
4	040040	华安纯债债券 A	契约型开放式	29,389,405.97	31,740,558.45	3.01	否
5	450009	国富中小盘股票	契约型开放式	11,093,076.66	28,930,743.93	2.74	否
6	003293	易方达科瑞灵活配置混合	契约型开放式	13,614,892.69	28,338,037.64	2.68	否
7	000628	大成高新技术产业股票 A	契约型开放式	7,871,811.59	28,047,264.70	2.66	否
8	006551	中庚价值领航混合	契约型开放式	11,151,036.46	27,431,549.69	2.60	否
9	005141	华夏睿磐泰荣混合 C	契约型开	20,866,711.05	26,168,942.33	2.48	否

			放式				
10	004933	招商丰拓灵活混合 C	契约型开放式	14,531,070.35	24,572,039.96	2.33	否
11	006624	中泰玉衡价值优选混合	契约型开放式	10,264,305.88	22,579,420.07	2.14	否
12	163415	兴全商业模式优选混合 (LOF)	上市契约型开放式 (LOF)	6,520,378.00	21,960,633.10	2.08	是
13	002088	国富新机遇混合 C	契约型开放式	14,430,796.23	21,934,810.27	2.08	否
14	000305	中银中高等级债券 A	契约型开放式	20,097,289.42	21,240,825.19	2.01	否
15	163417	兴全合宜混合 (LOF)A	上市契约型开放式 (LOF)	12,378,040.00	21,114,460.63	2.00	是
16	166019	中欧价值智选混合 A	契约型开放式	4,285,598.32	20,805,294.16	1.97	否
17	000251	工银金融地产混合 A	契约型开放式	7,870,523.42	20,770,311.31	1.97	否
18	006179	富国品质生活混合 A	契约型开放式	9,846,674.10	20,154,172.55	1.91	否
19	166001	中欧新趋势混合 (LOF)A	上市契约型开放式	13,657,750.95	19,796,910.00	1.87	否

			(LOF)				
20	000082	嘉实研究阿尔法股票	契约型开放式	10,229,667.51	19,497,746.27	1.85	否
21	005313	万家中证1000指数A	契约型开放式	14,752,708.00	19,023,616.97	1.80	否
22	006682	景顺长城中证500指数增强	契约型开放式	12,094,362.80	18,664,020.67	1.77	否
23	000020	景顺长城品质投资混合	契约型开放式	5,069,961.19	18,312,699.82	1.73	否
24	001112	东方红中国优势混合	契约型开放式	8,315,820.06	17,829,118.21	1.69	否
25	510900	易方达恒生国企(QDII-ETF)	交易型开放式(ETF)	20,230,700.00	17,519,786.20	1.66	否
26	519773	交银数据产业灵活配置混合	契约型开放式	8,198,365.83	16,887,813.77	1.60	否
27	515780	浦银安盛MSCI中国A股ETF	交易型开放式(ETF)	10,436,300.00	15,758,813.00	1.49	否
28	163409	兴全绿色投资混合(LOF)	上市契约型开放式(LOF)	7,563,451.52	15,595,837.03	1.48	是
29	512800	华宝中证银行ETF	交易型开放式(ETF)	13,567,900.00	15,480,973.90	1.47	否

30	007449	兴全多维价值混合 A	契约型开放式	7,228,433.83	13,685,593.77	1.30	是
31	004958	圆信永丰优享生活混合	契约型开放式	6,199,214.71	13,642,611.81	1.29	否
32	515080	招商中证红利 ETF	交易型开放式 (ETF)	9,365,100.00	13,467,013.80	1.27	否
33	340006	兴全全球视野股票	契约型开放式	4,632,784.59	13,258,566.22	1.26	是
34	163412	兴全轻资产混合 (LOF)	上市契约型开放式 (LOF)	3,845,532.44	12,690,257.05	1.20	是
35	003344	鹏华弘惠混合 C	契约型开放式	10,612,346.04	12,186,156.96	1.15	否
36	159920	恒生 ETF	交易型开放式 (ETF)	10,164,400.00	12,044,814.00	1.14	否
37	100032	富国中证红利指数增强 A	契约型开放式	11,309,691.27	12,033,511.51	1.14	否
38	007593	鹏扬中证 500 质量成长指数 A	契约型开放式	5,957,642.73	10,827,419.90	1.03	否
39	000191	富国信用债债券 A	契约型开放式	8,974,957.36	10,766,358.85	1.02	否
40	100058	富国产业债债券 A	契约型开	9,106,134.12	10,732,489.67	1.02	否

			放式				
41	004042	华夏鼎茂债券 A	契约型开放式	8,839,285.71	10,728,241.07	1.02	否
42	487021	工银优质精选混合	契约型开放式	2,969,091.45	10,712,481.95	1.01	否
43	002169	永赢稳益债券	契约型开放式	9,819,185.31	10,672,472.51	1.01	否
44	513500	博时标普 500ETF(QDII)	交易型开放式 (ETF)	8,609,600.00	10,288,472.00	0.97	否
45	166009	中欧新动力混合 (LOF) A	上市契约型开放式 (LOF)	2,938,203.40	10,186,163.55	0.96	否
46	007549	中泰开阳价值优选混合 A	契约型开放式	4,477,478.28	10,028,655.85	0.95	否
47	006002	工银医药健康股票 A	契约型开放式	3,847,192.22	9,869,971.64	0.93	否
48	001409	工银互联网加股票	契约型开放式	14,662,609.97	9,208,119.06	0.87	否
49	110023	易方达医疗保健行业混合	契约型开放式	2,682,854.84	8,188,072.97	0.78	否
50	118001	易方达亚洲精选股票(QDII)	契约型开放式	7,086,463.50	7,660,467.04	0.73	否
51	512990	华夏 MSCI 中国 A 股国际通	交易型开	4,096,400.00	7,037,615.20	0.67	否

		ETF	放式 (ETF)				
52	510050	华夏上证 50ETF	交易 型开 放式 (ETF)	1,725,700.00	5,296,173.30	0.50	否
53	512170	华宝中证医疗 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	8,106,031.00	4,701,497.98	0.45	否
54	160627	鹏华策略优选 混合	契约 型开 放式	1,685,434.93	4,621,462.58	0.44	否
55	501079	大成科创主题 3年封闭混合	契约 型开 放式	1,930,038.00	4,226,783.22	0.40	否
56	501025	鹏华香港银行 指数(LOF)A	上市 契约 型开 放式 (LOF)	4,112,200.00	4,202,668.40	0.40	否
57	169106	东证创优	上市 契约 型开 放式 (LOF)	3,729,938.00	3,621,769.80	0.34	否
58	510880	华泰柏瑞上证 红利ETF	交易 型开 放式 (ETF)	1,153,900.00	3,420,159.60	0.32	否
59	163417	兴全合宜	上市 契约 型开 放式 (LOF)	1,985,900.00	3,342,269.70	0.32	是
60	510100	易方达上证 50ETF	交易 型开	2,137,400.00	2,678,162.20	0.25	否

			放式 (ETF)				
61	501085	财通科创主题 3 年封闭运作 灵活配置混合	契约 型开 放式	1,051,395.00	1,856,763.57	0.18	否
62	163407	兴全沪深 300 指数 (LOF) A	上市 契约 型开 放式 (LOF)	762,243.00	1,821,150.98	0.17	是
63	501083	银华科创主题 3 年封闭混合	上市 契约 型开 放式 (LOF)	1,087,295.00	1,819,044.54	0.17	否
64	501081	中欧科创主题 3 年封闭运作 灵活配置混合	契约 型开 放式	948,943.00	1,715,973.63	0.16	否
65	501080	中金科创主题 混合	上市 契约 型开 放式 (LOF)	928,300.00	1,599,460.90	0.15	否
66	160726	嘉实瑞享	上市 契约 型开 放式 (LOF)	1,499,847.00	1,571,839.66	0.15	否
67	512720	国泰中证计算 机主题 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	1,300,300.00	1,416,026.70	0.13	否
68	501054	东方红睿泽三 年定开混合 A	上市 契约 型开 放式 (LOF)	1,066,800.00	1,356,969.60	0.13	否

69	163415	兴全模式	上市 契约 型开 放式 (LOF)	338,700.00	1,130,919.30	0.11	是
70	515450	南方标普中国 A 股大盘红利 低波 50ETF	交易 型开 放式 (ETF)	805,200.00	972,681.60	0.09	否
71	513090	易方达中证香 港证券投资主 题 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	735,000.00	845,985.00	0.08	否
72	510170	国联安商品 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	168,000.00	630,672.00	0.06	否
73	501095	中银证券科技 创新 3 年封闭 混合	契约 型开 放式	273,781.00	278,435.28	0.03	否
74	501049	东方红睿玺三 年定开混合 A	上市 契约 型开 放式 (LOF)	152,600.00	140,544.60	0.01	否
75	501088	嘉实瑞虹三年 定期混合	上市 契约 型开 放式 (LOF)	44,800.00	54,745.60	0.01	否

7.13 投资组合报告附注

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

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

7.13.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	23,487.76
2	应收清算款	12,002,203.20
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	86,081.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,111,772.14

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113044	大秦转债	3,386,253.45	0.32
2	110059	浦发转债	2,572,590.08	0.24
3	113011	光大转债	870,880.85	0.08
4	128129	青农转债	633,160.74	0.06
5	127017	万青转债	518,573.63	0.05
6	110053	苏银转债	107,082.56	0.01

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	300769	德方纳米	3,164,975.00	0.30	大宗交易购入流通受限
2	300383	光环新网	1,767,596.70	0.17	非公开发行流通受限

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
63,111	16,257.16	32,371,297.04	3.16	993,634,571.58	96.84

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	5,975,273.03	0.5824

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

注：本基金的基金经理也是本公司基金投资和研究部门负责人之一，故上述两点统计数据有重合部分。

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额 占基金总 份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占 基金总份 额比例(%)	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有资金	30,005,600.53	2.92	30,005,600.53	2.92	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	30,005,600.53	2.92	30,005,600.53	2.92	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020年12月16日） 基金份额总额	968,588,783.01
本报告期期初基金份额总额	1,013,961,238.14
本报告期基金总申购份额	12,044,630.48
减：本报告期基金总赎回份额	-

本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,026,005,868.62

注：总申购份额含红利再投资、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 报告期内基金管理人重大人事变动。

2022 年 1 月 21 日起，董承非先生离任公司副总经理；2022 年 1 月 28 日起，谢治宇先生任职公司副总经理；2022 年 6 月 30 日起，秦杰先生任职公司副总经理，郑文惠女士离任公司副总经理。

(2) 报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

1、报告期内，本基金持有的华安智联混合型证券投资基金（LOF）由华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金封闭运作期届满转型而成。根据该基金基金合同约定，该基金的封闭运作期于 2022 年 6 月 13 日届满，自 2022 年 6 月 14 日起自动转为上市开放式基金（LOF），并接受场外、场内申购赎回，基金名称变更为“华安智联混合型证券投资基金（LOF）”。该基金更名后，场内简称变更为“华安智联”，场内扩位简称变更为“华安智联 LOF”，场外简称变更为“华安智联混合（LOF）”，基金代码仍为 501073。

2、报告期内，本基金持有的万家科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）由万家科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金封闭运作期届满后更名而来。该基金更名后，场内简称仍为“科创主题”，扩位证券简称变更为“科创主题 LOF”，场外简称变更为“万家科创主题灵活配置混合（LOF）”，A 类基金代码仍为 501075，C 类基金代码仍为 007501。

3、报告期内，本基金持有的鹏华创新动力灵活配置混合型证券投资基金（LOF），根据《鹏华科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的约定，鹏华科创主题 3 年封闭

运作灵活配置混合型证券投资基金的封闭运作期为基金合同生效日（包括基金合同生效日）起至三年后的年度对日前一日止，封闭运作期于 2022 年 6 月 9 日届满，自 2022 年 6 月 10 日起自动转为上市开放式基金（LOF）并开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务，二级市场交易仍照常办理，基金名称变更为“鹏华创新动力灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”，场外简称变更为“鹏华创新动力混合（LOF）”，场内简称变更为“创新动力”，扩位证券简称变更为“鹏华创新动力 LOF”，基金代码仍为 501076。

4、报告期内，本基金持有的富国创新企业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）由富国科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金封闭运作期届满后更名而来。根据该基金基金合同约定，该基金的封闭运作期于 2022 年 6 月 12 日届满，自 2022 年 6 月 13 日起自动转为上市开放式基金（LOF），并开始接受场外、场内申购赎回，基金名称变更为“富国创新企业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”。该基金更名后，场内简称仍为“科创富国”，场外简称变更为“富国创新企业灵活配置混合（LOF）”，A 类基金份额（即新增 C 类基金份额后由原本基金的基金份额全部自动延续而来）代码仍为 501077。自 2022 年 6 月 13 日起增加 C 类基金份额，C 类基金份额的基金代码为 015849。

5、报告期内，本基金持有的广发科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）由广发科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金封闭运作期届满后更名而来。根据《广发科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的约定，基金合同生效后前三年为封闭运作期，封闭运作期于 2022 年 6 月 12 日届满，自 2022 年 6 月 13 日起进入开放期，开放日常申购、赎回、转换和定投业务。基金名称变更为“广发科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”，基金简称变更为“广发科创主题灵活配置混合（LOF）”，场内简称仍为“科创配置”，扩位证券简称仍为“科创配置 LOF”，基金代码仍为 501078。

6、报告期内，本基金持有的中欧科创主题混合型证券投资基金（LOF）由中欧科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金封闭运作期届满开放后更名而来。根据《中欧科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的约定，基金合同生效后的前三年为封闭运作期，封闭运作期于 2022 年 6 月 27 日届满，自 2022 年 6 月 28 日起进入开放期，开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务，二级市场交易仍照常办理，基金名称变更为“中欧科创主题混合型证券投资基金（LOF）”，基金场外简称变更为“中欧科创主题混合（LOF）”，场内简称仍为“科创中欧”，扩位证券简称变更为“科创中欧 LOF”，基金代码仍为 501081。

7、报告期内，本基金持有的博时科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金，按照该基金基金合同及招募说明书的约定，其封闭期自 2019 年 06 月 27 日至 2022 年 06 月 26 日止。

自 2022 年 06 月 27 日起转换为上市开放式基金（LOF），转换后更名为“博时科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”，场外简称变更为“博时科创主题灵活配置混合 A”，场内简称、场内扩位简称与基金代码不变，场内简称为“科创投资”，场内扩位简称为“科创投资 LOF”，基金代码为 501082。

8、报告期内，本基金持有的博时优势企业 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金（LOF），根据基金合同及招募说明书的约定，其封闭期自 2019 年 6 月 3 日至 2022 年 6 月 2 日止，自 2022 年 6 月 3 日起转换为上市开放式基金（LOF），转换后将更名为“博时优势企业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”，A 类基金份额继续在深圳证券交易所上市交易，本基金进入开放期后开始销售 C 类基金份额，C 类基金份额不上市交易，投资人可在基金的开放日办理申购和赎回业务。本基金转换为上市开放式基金（LOF）后，场外简称变更为“博时优势企业灵活配置混合”，场内简称与基金代码不变，场内简称为“博时优势企业”，基金代码为“160526”。

9、报告期内，本基金持有的泓德三年封闭运作丰泽混合型证券投资基金，根据《基金合同》及《招募说明书》的相关约定，其封闭期自 2019 年 3 月 28 日至 2022 年 3 月 28 日止，自 2022 年 3 月 29 日起，转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“泓德丰泽混合型证券投资基金（LOF）”，场外基金简称变更为“泓德丰泽混合（LOF）”，场内基金简称及代码不变。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
兴业证券	5	24,258,408.62	100.00	15,880.50	100.00	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
汇丰前海	2	-	-	-	-	-

证券						
信达证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中国中金 财富证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

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

10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例 (%)	成交金额	占当期债 券回购成 交总额的 比例(%)	成交金额	占当期 权证成 交总额 的比例 (%)	成交金额	占当期 基金成 交总额 的比例 (%)
兴业 证券	3,122,061.76	100.00	206,900,000.00	100.00	-	-	44,007,159.42	100.00
长江 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
汇丰 前海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国 中金 财富 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则工作的公告	中国证券报、指定互联网网站	2022-01-05
2	关于调整旗下部分基金单笔最低交易限额的公告	中国证券报、指定互联网网站	2022-01-06
3	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、指定互联网网站	2022-01-19
4	关于副总经理离任的公告	中国证券报、指定互联网网站	2022-01-21
5	关于我司旗下基金参与腾安基金销售赎回费率优惠活动的公告	中国证券报、指定互联网网站	2022-01-26
6	关于公司副总经理任职的公告	中国证券报、指定互联网网站	2022-01-28
7	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、指定互联网网站	2022-02-16
8	关于增加华夏银行为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、指定互联网网站	2022-02-23
9	关于增加德邦证券为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、指定互联网网站	2022-03-15
10	关于增加财达证券为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、指定互联网网站	2022-04-11
11	关于增加兴业银行为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、指定互联网网站	2022-05-06
12	关于调整网上直销基金转换、赎回申购、汇款交易优惠费率的公告	中国证券报、指定互联网网站	2022-06-17
13	关于公司副总经理变更的公告	中国证券报、指定互联网网站	2022-06-30

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，故不涉及本项特有风险。

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

2、“赎回份额”包含份额赎回、转换转出等导致投资者持有份额减少的情形。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金每份基金份额的最短持有期为 5 年。本基金每份基金份额在其最短持有期到期日（含该日）后，基金份额持有人方可就该基金份额提出赎回申请。因此，对于基金份额持有人而言，存在投资本基金后 5 年内无法赎回的风险。

本基金为养老目标基金，“养老”名称不代表收益保障或任何形式的收益承诺。

2、根据《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）等有关规定，兴证全球基金管理有限公司（以下简称“本公司”）旗下管理的公开募集证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具相关会计准则。执行新会计准则后，本公司旗下公开募集证券投资基金将按照新金融工具相关会计准则的规定进行会计计量。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

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

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

4、法律意见书

5、基金管理人业务资格批件和营业执照

6、基金托管人业务资格批件和营业执照

7、中国证监会规定的其它文件

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

12.3 查阅方式

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

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

兴证全球基金管理有限公司

2022 年 8 月 31 日