

兴证全球优选稳健六个月持有期债券型基
金中基金（FOF）
2022 年第 3 季度报告

2022 年 9 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：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 10 月 26 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 10 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF
基金主代码	015377
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 4 月 22 日
报告期末基金份额总额	2,559,505,001.84 份
投资目标	在控制风险的前提下，通过优选基金积极把握基金市场的投资机会，力求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金的投资策略可以细分为大类资产配置策略、优选基金策略、股票投资策略、存托凭证的投资策略、港股投资策略、债券投资策略、可转换债券及可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、证券公司短期公司债券投资策略等。
业绩比较基准	中证普通债券型基金指数收益率×85%+中证偏股型基金指数收益率×10%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为债券型基金中基金，其预期收益和预期风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。基金管理人对本基金的风险评级为 R2。 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。
基金管理人	兴证全球基金管理有限公司

基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF A	兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF C
下属分级基金的交易代码	015377	015378
报告期末下属分级基金的份额总额	1,422,460,354.14 份	1,137,044,647.70 份

注：本基金每份基金份额最短持有期为 6 个月。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2022年7月1日-2022年9月30日）	
	兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF A	兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF C
1. 本期已实现收益	5,840,966.05	3,835,669.73
2. 本期利润	-1,991,143.03	-2,407,188.07
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0014	-0.0022
4. 期末基金资产净值	1,441,149,282.56	1,150,715,075.26
5. 期末基金份额净值	1.0131	1.0120

注：1、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。

2、所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：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

兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF A

阶段	净值增长率①	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	-0.14%	0.07%	-0.66%	0.10%	0.52%	-0.03%
自基金合同生效起至今	1.31%	0.07%	1.67%	0.13%	-0.36%	-0.06%

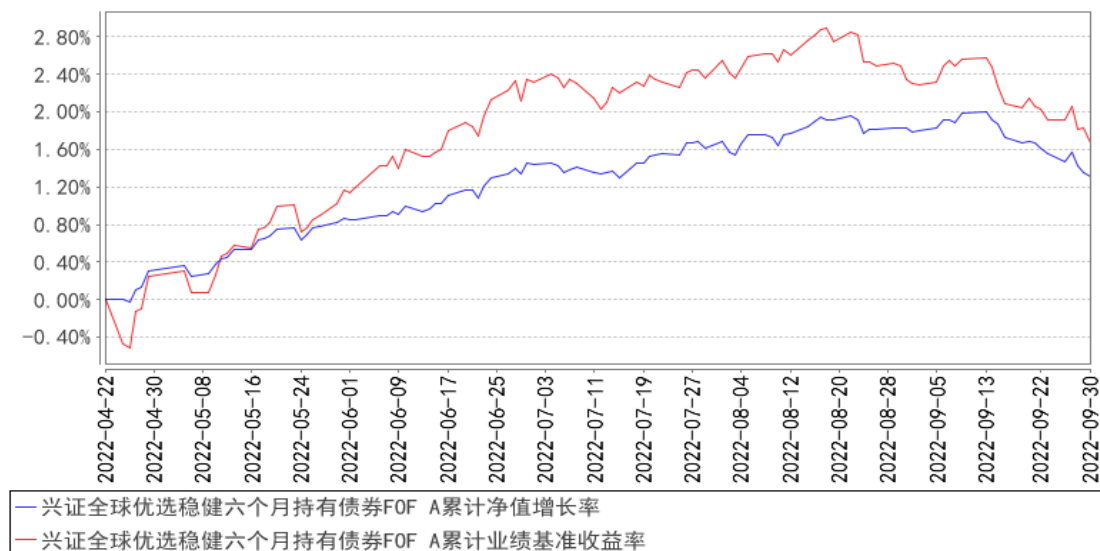
兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF C

阶段	净值增长率①	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	-0.20%	0.07%	-0.66%	0.10%	0.46%	-0.03%
自基金合同 生效起至今	1.20%	0.07%	1.67%	0.13%	-0.47%	-0.06%

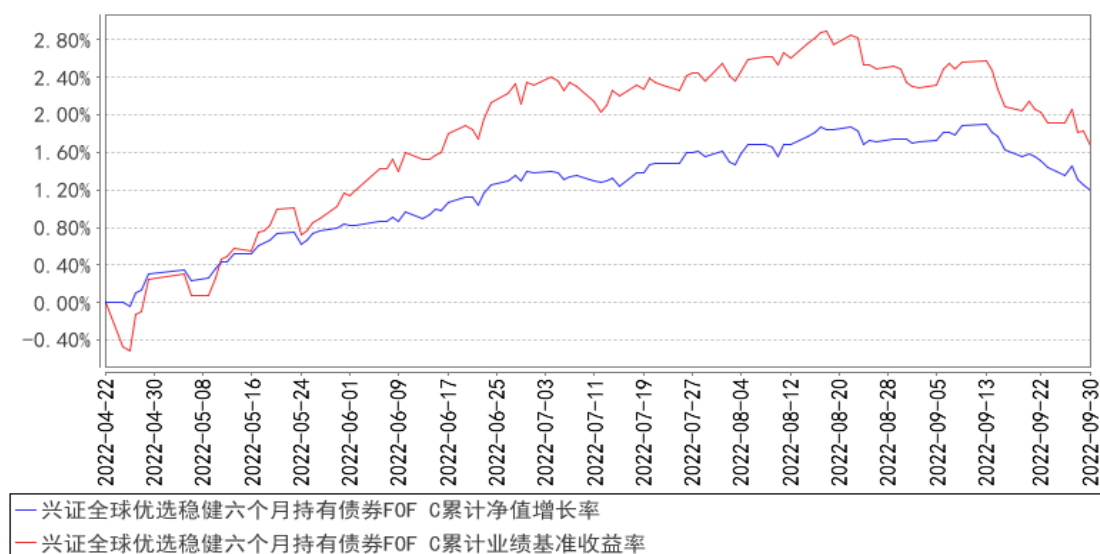
注：本基金成立于 2022 年 4 月 22 日，截至 2022 年 9 月 30 日，本基金成立不满一年。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

兴证全球优选稳健六个月持有债券FOF A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



兴证全球优选稳健六个月持有债券FOF C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 09 月 30 日。

2、按照《兴证全球优选稳健六个月持有期债券型基金中基金（FOF）基金合同》的规定，本基金建仓期为 2022 年 04 月 22 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。

3、本基金成立于 2022 年 4 月 22 日，截至 2022 年 9 月 30 日，本基金成立不满一年。

3.3 其他指标

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	2022 年 4 月 22 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。

<p>(FOF)、 兴全优选 进取三个月 持有期混合 型基金中基 金</p> <p>(FOF)、 兴全安泰 稳健养老 目标一年 持有期混合 型基金中基 金</p> <p>(FOF)、 兴全安泰 积极养老 目标五年 持有期混合 型基金发起 式基金中基 金</p> <p>(FOF)、 兴证全球 优选平衡 三个月持 有期混合 型基金中基 金</p> <p>(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</p> <p>(FOF)、 兴证全球 积极配置 三年封闭 运作混合 型基金中基 金</p> <p>(FOF- LOF)、兴</p>					
--	--	--	--	--	--

	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				
刘潇	兴全安泰稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理、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	2022年6月16日	-	10年	硕士。历任泰康资产管理有限责任公司基金研究员、基金投资总监，腾讯科技（北京）有限公司产品研究副总监，兴证全球基金管理有限公司投资经理。

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。

4.1.1 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、《兴证全球优选稳健六个月持有期债券型基金中基金（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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2022 年三季度股票市场大幅调整，全季上证指数下跌 11.01%，从其他主流指数来看，沪深 300 指数下跌 15.16%，创业板指数下跌 18.56%，上证 50 指数下跌 14.66%，中证 500 指数下跌 11.47%，中证 1000 指数下跌 12.45%，科创 50 指数下跌 15.04%；红利类指数表现相对抗跌，中证红利指数下跌 4.63%，上证红利下跌 3.63%。从申万一级行业表现来看，煤炭行业是唯一上涨的行业，涨幅 0.97%，公用事业、石油石化、通信、交通运输、农林牧渔等行业表现也相对较好，跌幅都在 7%以内，建筑材料、电力设备、电子、汽车、传媒、有色金属等行业跌幅均在 16%以上；从风格指数上来看，低价股表现优于中、高价股，低市盈率指数表现优于中、高市盈率指数，中、小盘指数优于大盘指数。债券市场方面，曲线整体变陡。其中，三季度中债总财富指数上涨 1.54%，中债银行间国债财富指数上涨 1.56%，中债信用债总财富指数上涨 1.03%。在收益率曲线上，三季度国债/国开债/信用债收益率曲线整体走平，期限利差整体依旧处于较高水平。信用债方面，1-5 年各期限各资质信用债收益率均下行超 20BP，各期限各资质信用利差略均有压缩。货币市场方面，三季度流动性依旧极其宽松，其中，三季度银行间 1 天回购加权平均利率均值在 1.29%左右，较二季度均值下行 21bp，银行间 7 天回购利率均值在 1.64%左右，较二季度均值下行 21bp。从基金指数上来看，偏股基金指数下跌 13.23%，中长期纯债基金指数上涨 1.01%，黄金 ETF 净值下跌 0.92%，以人民币计价的标普 500ETF 净值下跌 0.03%，纳斯达克 ETF 净值上涨 0.98%；另外中证转债指数下跌 3.82%。

本基金为债券型普通 FOF 产品，我们在管理中将遵守两个大的原则，一是遵照基准设置的长期资产配置中枢构建组合，二是出于对本基金稳健属性的考量，重视组合风险控制。

基于上述原则考虑，我们对于本基金有几点操作考量：首先本基金在管理时将考量重点配置的各大类资产在收益风险上的不同特性，注重利用大类资产间的低相关性降低组合波动。其次我们将关注各资产背后的波动来源，在长期采用组合风险因素对冲进行管理，在短期采用适度控制风险暴露的方式平滑波动。另外我们更侧重追求高确定性的收益来源，比如以参与定增、大宗等方式获取确定性折价收益。

我们在大类资产配置上长期将按照产品基准中枢运作。报告期内本基金仍处于建仓阶段，目前在权益资产上的配置比例仍略低于基准，主要是考虑账户安全垫的需要以及当下权益资产较大的潜在波动可能性。在建仓过程中我们根据市场性价比状态动态控制了加仓节奏，逐步提升了权益仓位。

固定收益基金部分，鉴于对建仓期产品净值安全垫的考量，本基金保留了部分货币头寸。由于债券收益率接近历史极低位置，尤其信用利差压缩至极限，我们控制了组合的久期。此外，今年上半年城投债利差压缩幅度较大，在部分地方土地出让金及税收收入降幅较大的背景下，我们认为城投债在目前的收益率水平上性价比较低，因此降低了组合中城投债的暴露敞口。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF A 份额净值为 1.0131 元，本报告期的基金份额净值收益率为-0.14%，同期业绩比较基准收益率为-0.66%，截至本报告期末兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF C 份额净值为 1.0120 元，本报告期的基金份额净值收益率为-0.20%，同期业绩比较基准收益率为-0.66%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	16,863,972.91	0.65
	其中：股票	16,863,972.91	0.65
2	基金投资	2,399,331,381.42	92.54
3	固定收益投资	131,110,876.71	5.06
	其中：债券	131,110,876.71	5.06
	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	-24,250.69	-0.00
	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	6,566,424.96	0.25
8	其他资产	38,977,376.56	1.50
9	合计	2,592,825,781.87	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	7,476,255.77	0.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,907,961.94	0.15
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	5,479,755.20	0.21
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	16,863,972.91	0.65

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	002617	露笑科技	248,756	2,223,878.64	0.09
2	001896	豫能控股	409,836	1,971,311.16	0.08
3	000591	太阳能	301,659	1,936,650.78	0.07
4	002108	沧州明珠	411,522	1,827,157.68	0.07
5	688099	晶晨股份	30,000	1,823,100.00	0.07
6	688303	大全能源	38,618	1,789,944.30	0.07
7	002624	完美世界	150,000	1,762,500.00	0.07
8	002053	云南能投	171,233	1,635,275.15	0.06
9	688083	中望软件	6,188	955,489.08	0.04
10	300496	中科创达	9,709	938,666.12	0.04

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	131,110,876.71	5.06
	其中：政策性金融债	131,110,876.71	5.06
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	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	131,110,876.71	5.06

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	220304	22 进出 04	1,300,000	131,110,876.71	5.06

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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：无。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	28,027.80
2	应收证券清算款	37,188,331.69
3	应收股利	177,863.51
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,572,753.40
6	其他应收款	10,400.16
7	其他	-
8	合计	38,977,376.56

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	002617	露笑科技	2,223,878.64	0.09	非公开发行 流通受限
2	001896	豫能控股	1,971,311.16	0.08	非公开发行

					流通受限
3	000591	太阳能	1,936,650.78	0.07	非公开发行 流通受限
4	002108	沧州明珠	1,827,157.68	0.07	非公开发行 流通受限
5	688099	晶晨股份	1,823,100.00	0.07	大宗交易购 入流通受限
6	688303	大全能源	1,789,944.30	0.07	非公开发行 流通受限
7	002624	完美世界	1,762,500.00	0.07	大宗交易购 入流通受限
8	002053	云南能投	1,635,275.15	0.06	非公开发行 流通受限
9	688083	中望软件	955,489.08	0.04	询价转让流 通受限
10	300496	中科创达	938,666.12	0.04	非公开发行 流通受限

5.10.6 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。

§6 基金中基金

6.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

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	189,134,022.52	214,553,635.15	8.28	是
2	004417	兴全货币 B	契约型开放式	176,339,940.22	176,339,940.22	6.80	是
3	001821	兴全天添益货币 B	契约型开放式	175,482,508.84	175,482,508.84	6.77	是
4	006985	兴全恒裕债券 A	契约型开放式	122,992,892.86	134,234,443.27	5.18	是
5	040026	华安信用四季红债券 A	契约型开放式	100,014,258.94	105,675,066.00	4.08	否
6	012324	兴证全球恒惠 30 天	契约型开放式	81,296,007.02	85,027,493.74	3.28	是

		持有超短债 A					
7	006662	易方达安悦超短债债券 A	契约型开放式	77,817,868.07	79,078,517.53	3.05	否
8	000032	易方达信用债债券 A	契约型开放式	61,217,108.46	68,593,770.03	2.65	否
9	012325	兴证全球恒惠 30 天持有超短债 C	契约型开放式	58,370,974.53	60,927,623.21	2.35	是
10	003327	万家鑫璟纯债债券 A	契约型开放式	49,254,949.26	58,899,068.33	2.27	否

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用 2022 年 7 月 1 日至 2022 年 9 月 30 日	其中：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
当期交易基金产生的申购费（元）	9,000.00	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	119,642.83	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	34,526.92	30,941.68
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	2,164,778.83	601,836.82
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	573,658.46	162,030.27

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

1、大成科创主题混合型证券投资基金（LOF）由大成科创主题 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。大成科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2019 年 6 月 6 日证监许可【2019】1012 号文予以注册。基金合同于 2019 年 7 月 18 日正式生效。《大成科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效后的前 3 年本基金处于封闭运作期。大成科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的封闭期为基金合同生效日（包括基金合同生效日）至 3 年后的年度对日前一日止，封闭运作期届满后，本基金 2022 年 7 月 18 日转为上市开放式基金（LOF），基金名称调整为“大成科创主题混合型证券投资基金（LOF）”，并接受场内、场外申购和赎回，场外简称变更为“大成科创主题混合（LOF）”，场内简称、基金代码不变，场内简称为“科创大

成”，场内扩位简称为“科创大成 LOF”，基金代码为“501079”。

2、根据银华科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金《基金合同》及《招募说明书》的相关规定，银华科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的封闭期自 2019 年 7 月 5 日至 2022 年 7 月 5 日止，自 2022 年 7 月 6 日起，本基金转换为上市开放式基金

（LOF），基金名称变更为银华科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF），场外基金简称变更为“银华科创主题灵活配置混合（LOF）”，扩位证券简称变更为“科创银华 LOF”，场内基金简称及代码不变。

3、泰康资管的公募事业部申请了公募牌照泰康基金，人员、系统、场所等将转移到泰康基金，基金管理人由泰康资产变更为泰康基金。

§ 7 开放式基金份额变动

单位：份

项目	兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF A	兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF C
报告期期初基金份额总额	1,403,223,100.56	1,027,767,759.55
报告期期间基金总申购份额	19,237,253.58	109,276,888.15
减：报告期期间基金总赎回份额	-	-
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	1,422,460,354.14	1,137,044,647.70

注：买入/申购总份额含红利再投资、转换转入份额，卖出/赎回总份额含转换转出份额。

§ 8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF A	兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF C
报告期期初管理人持有的本基金份额	50,003,500.07	0.00
报告期期间买入/申购总份额	0.00	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	50,003,500.07	0.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	3.52	0.00

注：1、买入/申购总份额含红利再投资、转换转入份额，卖出/赎回总份额含转换转出份额。

2、“占基金总份额比例”对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额。

8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本基金管理人本报告期未运用固有资金投资本基金。

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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。							

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金每份基金份额的最短持有期限为 6 个月。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 6 个月后的月度对日（即最短持有期到期日）。若该月度对日为非工作日或不存在对应日期的，则顺延至下一个工作日。本基金每份基金份额自其最短持有期到期日（含该日）起，基金份额持有人方可就该基金份额提出赎回申请。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、中国证监会关于准予兴证全球优选稳健六个月持有期债券型基金中基金（FOF）注册的批复文件

2、《兴证全球优选稳健六个月持有期债券型基金中基金（FOF）基金合同》

3、《兴证全球优选稳健六个月持有期债券型基金中基金（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

10.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

10.3 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。

兴证全球基金管理有限公司

2022 年 10 月 26 日