

兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金
(LOF)
2021 年第 3 季度报告

2021 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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 10 月 27 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 26 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 2021 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 兴全沪深 300 指数 (LOF) |
| 场内简称 | 兴全 300 |
| 基金主代码 | 163407 |
| 前端交易代码 | 163407 |
| 后端交易代码 | 163408 |
| 基金运作方式 | 上市契约型开放式 (LOF) |
| 基金合同生效日 | 2010 年 11 月 2 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,886,956,057.96 份 |
| 投资目标 | 本基金采用指数复制结合相对增强的投资策略，即通过指数复制的方法拟合、跟踪沪深 300 指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的组合管理，谋求基金资产的长期增值。本基金力争日均跟踪误差不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，日均下方跟踪误差不超过 0.3%，年下方跟踪误差不超过 4.75%。 |
| 投资策略 | 本基金采用指数复制结合相对增强的投资策略，即通过指数复制的方法拟合、跟踪沪深 300 指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的组合管理。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数×95%+同业存款利率×5% |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型基金，预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数增强型基金，跟踪标的指数市场表现，追求接近或超越沪深 300 指数所代表的市场平均收益，是股票基金中 |

| | | |
|-----------------|---------------------|-----------------|
| | 处于中等风险水平的基金产品。 | |
| 基金管理人 | 兴证全球基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 兴全沪深 300 指数 (LOF) A | 兴全沪深 300 指数 C |
| 下属分级基金的场内简称 | 兴全 300 | 无 |
| 下属分级基金的交易代码 | 163407 | 007230 |
| 下属分级基金的前端交易代码 | 163407 | - |
| 下属分级基金的后端交易代码 | 163408 | - |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,826,512,713.52 份 | 60,443,344.44 份 |

注：1、本基金 A 类份额场内扩位简称：兴全沪深 300 LOF。

2、自 2019 年 6 月 5 日起增设兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) C 类份额，仅 A 类份额上市交易。详情请见管理人网站公告。

§ 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 (2021 年 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日) | |
|-----------------|--------------------------------------|----------------|
| | 兴全沪深 300 指数 (LOF) A | 兴全沪深 300 指数 C |
| 1. 本期已实现收益 | 72,785,685.25 | 2,158,140.64 |
| 2. 本期利润 | -322,605,594.12 | -9,879,409.99 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.1747 | -0.1662 |
| 4. 期末基金资产净值 | 4,550,430,689.61 | 149,532,346.72 |
| 5. 期末基金份额净值 | 2.4913 | 2.4739 |

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、经与基金托管人中国农业银行协商一致，并报中国证监会备案，管理人决定自 2019 年 6 月 5 日起增设兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) C 类份额（代码：007230）。详情请见管理人网站公告。

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

兴全沪深 300 指数 (LOF) 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 | ①-③ | ②-④ |
|----|--------|---------------|----------------|----------------|-----|-----|
|----|--------|---------------|----------------|----------------|-----|-----|

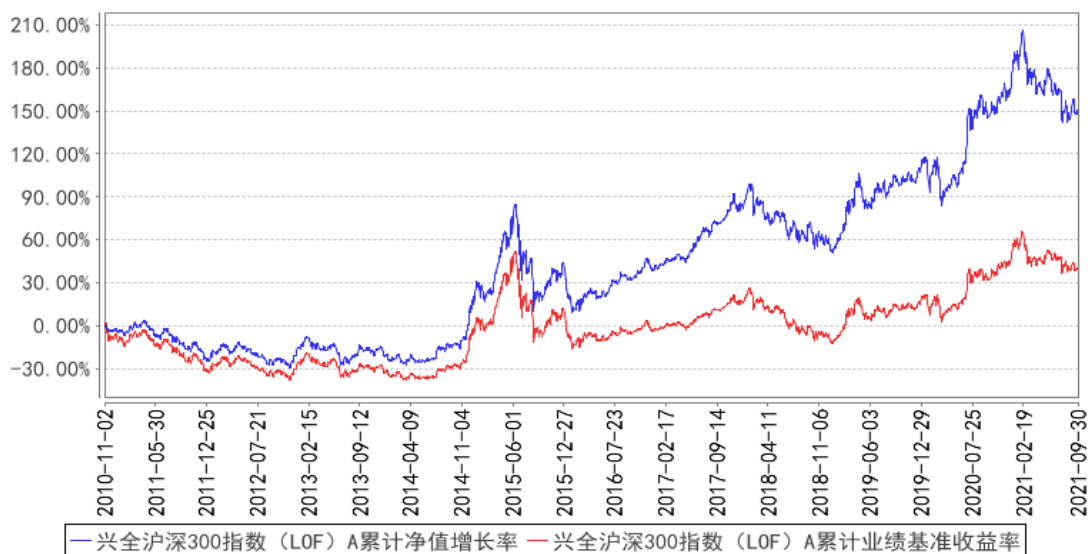
| | | | | 准差④ | | |
|----------------|---------|-------|--------|-------|---------|--------|
| 过去三个月 | -6.65% | 1.19% | -6.49% | 1.14% | -0.16% | 0.05% |
| 过去六个月 | -8.75% | 1.08% | -3.38% | 1.04% | -5.37% | 0.04% |
| 过去一年 | 1.33% | 1.16% | 5.88% | 1.15% | -4.55% | 0.01% |
| 过去三年 | 44.88% | 1.28% | 39.64% | 1.29% | 5.24% | -0.01% |
| 过去五年 | 87.82% | 1.14% | 47.45% | 1.14% | 40.37% | 0.00% |
| 自基金合同 生效起至今 | 149.13% | 1.35% | 40.12% | 1.36% | 109.01% | -0.01% |

兴全沪深 300 指数 C

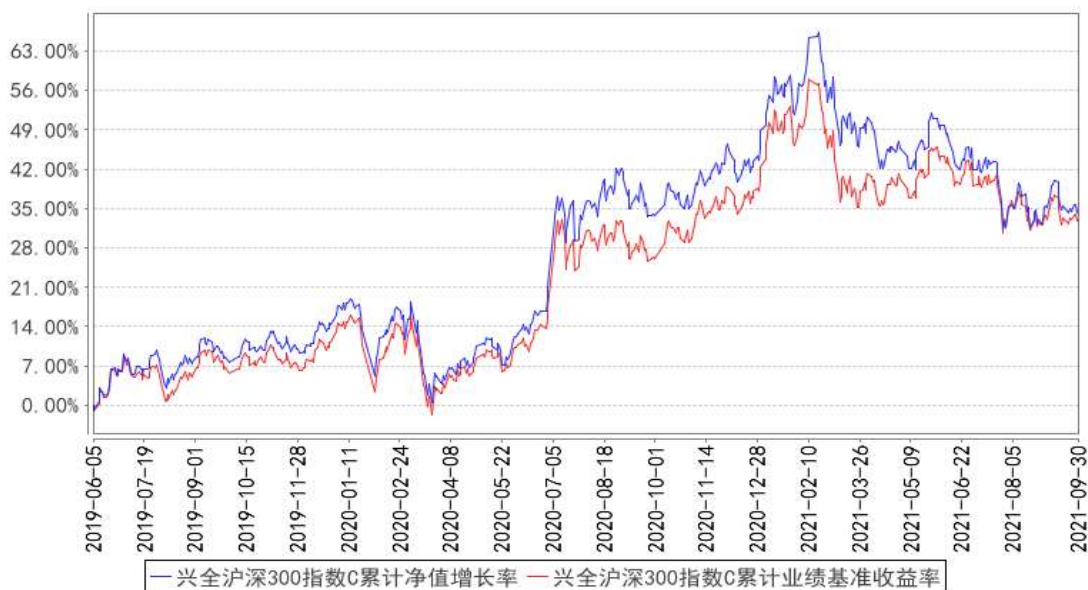
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----------------|--------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -6.74% | 1.19% | -6.49% | 1.14% | -0.25% | 0.05% |
| 过去六个月 | -8.93% | 1.08% | -3.38% | 1.04% | -5.55% | 0.04% |
| 过去一年 | 0.93% | 1.16% | 5.88% | 1.15% | -4.95% | 0.01% |
| 自基金合同 生效起至今 | 35.02% | 1.21% | 33.58% | 1.20% | 1.44% | 0.01% |

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

兴全沪深300指数 (LOF) 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



兴全沪深300指数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 2021 年 9 月 30 日。

2、按照《兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金合同》的规定，本基金建仓期为 2010 年 11 月 2 日至 2011 年 5 月 1 日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

3、经与基金托管人中国农业银行协商一致，并报中国证监会备案，管理人决定自 2019 年 6 月 5 日起增设兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) C 类份额 (代码：007230)。详情请见管理人网站公告。

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 | | |
| 申庆 | 兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）、兴全恒益债券型证券投资基金、兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金基金经理 | 2010 年 11 月 2 日 | - | 24 年 | 硕士，历任兴业证券研究发展中心研究员，兴证全球基金管理有限公司行业研究员，兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理助理、兴全全球视野股票型证券投资基金基金经理、基金管理部总监助理。 |

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

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

3、证券从业的涵义遵从行业的相关规定，包括资管相关行业从业经历。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）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

三季度在超预期降准作用下，资金面较二季度更为宽松，A 股也继续延续结构性行情的状态。和二季度相比，中小市值强于大市值的风格得以延续，但“两创”的超额收益大面积回吐。期间在宽松的货币环境下，市场日均成交额显著提高，流动性向部分中小市值股票溢出；另一方面，期间商品大幅上涨，“能耗双控”政策也使得一些高能耗行业生产受限，中小市值公司数量较多的周期行业表现较强，两者可能共同促使了三季度中小市值相对强势的表现。相对而言，经营稳健但业绩缺乏爆发力的消费板块以及受政策影响较大的“两创”板块在三季度表现一般。

历史经验告诉我们任何时期的情绪化高估值品种都会向合理水平回归。三季度“两创”类资产的表现一定程度上印证了我们的观点。从公司治理的角度而言，上市公司存在诸多利益相关者，股东只是其中之一。而不同的文化对于利益相关者之间利益分配有着不同的处理方式，并不能粗率地把股东利益最大化看成普遍原则。其中直接融资主导下的英美模式更重视股东利益，缺陷是一定程度上忽略员工等利益方的合理权益，而间接融资主导下的德国模式通过多元化监事会（来自员工、债权人的成员），有助于实现更均衡的利益分配。考虑到制度、文化因素，我们认为基于英美模式前提下单纯追寻股东利益最大化的投资策略未必完全适合中国市场，反之，需要更重视中国式 ESG，综合考虑上市公司运营过程中的各种外部性影响。当然，这也并不意味着股东回报不重要。

在具体操作上，我们依然坚持在保持总体行业和风格均衡前提下的行业内相对综合价值比较的选股策略，并积极把握各种确定性的超额收益甚至绝对收益，从而尽可能在市场回落过程中降低整体组合的下方波动，同时又能在市场上升过程中紧跟市场。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末兴全沪深 300 指数 (LOF) A 的基金份额净值为 2.4913 元，本报告期基金份额净值增长率为 -6.65%，截至本报告期末兴全沪深 300 指数 C 的基金份额净值为 2.4739 元，本

告期基金份额净值增长率为-6.74%，同期业绩比较基准收益率为-6.49%。

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 | 4,456,964,346.68 | 90.08 |
| | 其中：股票 | 4,456,964,346.68 | 90.08 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 465,147,609.56 | 9.40 |
| | 其中：债券 | 465,147,609.56 | 9.40 |
| | 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 | 10,190,675.00 | 0.21 |
| 8 | 其他资产 | 15,227,107.41 | 0.31 |
| 9 | 合计 | 4,947,529,738.65 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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 | 1,682,282.20 | 0.04 |
| B | 采矿业 | 142,167,410.18 | 3.02 |
| C | 制造业 | 2,116,826,297.71 | 45.04 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 45,780,311.00 | 0.97 |
| E | 建筑业 | 32,686,740.00 | 0.70 |
| F | 批发和零售业 | 21,872,663.73 | 0.47 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 63,021,209.06 | 1.34 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 144,991,404.53 | 3.08 |
| J | 金融业 | 1,112,295,212.29 | 23.67 |

| | | | |
|---|---------------|------------------|-------|
| K | 房地产业 | 112,160,974.22 | 2.39 |
| L | 租赁和商务服务业 | 340,830,280.32 | 7.25 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 1,865,503.77 | 0.04 |
| 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 | 54,305,622.14 | 1.16 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 74,222,366.57 | 1.58 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 4,264,708,277.72 | 90.74 |

5.2.2 报告期末积极投资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 | 18,116.82 | 0.00 |
| B | 采矿业 | 23,947,332.00 | 0.51 |
| C | 制造业 | 120,980,372.51 | 2.57 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,210,937.50 | 0.07 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 4,197,269.02 | 0.09 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 5,668,056.63 | 0.12 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 17,095,917.63 | 0.36 |
| J | 金融业 | 74,241.10 | 0.00 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 19,443.64 | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 17,035,429.49 | 0.36 |
| 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 | 8,952.62 | 0.00 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 192,256,068.96 | 4.09 |

5.2.3 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 报告期末指数投资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 | 601888 | 中国中免 | 1,294,605 | 336,597,300.00 | 7.16 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 137,100 | 250,893,000.00 | 5.34 |
| 3 | 000100 | TCL 科技 | 30,979,000 | 193,928,540.00 | 4.13 |
| 4 | 600036 | 招商银行 | 3,358,870 | 169,454,991.50 | 3.61 |
| 5 | 601601 | 中国太保 | 6,177,639 | 167,661,122.46 | 3.57 |
| 6 | 601318 | 中国平安 | 3,209,863 | 155,228,974.68 | 3.30 |
| 7 | 000895 | 双汇发展 | 5,506,009 | 149,488,144.35 | 3.18 |
| 8 | 601009 | 南京银行 | 13,188,856 | 119,359,146.80 | 2.54 |
| 9 | 000858 | 五粮液 | 499,229 | 109,525,850.31 | 2.33 |
| 10 | 600741 | 华域汽车 | 4,690,800 | 107,044,056.00 | 2.28 |

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

| 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 | 600195 | 中牧股份 | 2,700,085 | 30,294,953.70 | 0.64 |
| 2 | 300070 | 碧水源 | 2,188,000 | 17,000,760.00 | 0.36 |
| 3 | 000983 | 山西焦煤 | 1,188,000 | 14,089,680.00 | 0.30 |
| 4 | 000723 | 美锦能源 | 1,187,028 | 12,784,291.56 | 0.27 |
| 5 | 300507 | 苏奥传感 | 1,246,537 | 9,398,888.98 | 0.20 |

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 | 120,140,000.00 | 2.56 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 130,355,000.00 | 2.77 |
| | 其中：政策性金融债 | 130,355,000.00 | 2.77 |
| 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) | 214,652,609.56 | 4.57 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 465,147,609.56 | 9.90 |

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 | 160312 | 16 进出 12 | 600,000 | 60,048,000.00 | 1.28 |
| 2 | 132018 | G 三峡 EB1 | 318,880 | 41,722,259.20 | 0.89 |
| 3 | 113050 | 南银转债 | 272,230 | 31,404,452.80 | 0.67 |
| 4 | 102101 | 国债 2101 | 300,000 | 30,024,000.00 | 0.64 |
| 5 | 200002 | 20 付息国债 02 | 300,000 | 29,997,000.00 | 0.64 |

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：本基金本报告期末未持有贵金属。

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股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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中，招商银行股份有限公司、南京银行股份有限公司具有在报告编制日前一年内受到监管部门处罚的情形；本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

本基金投资的前十名证券发行主体中，未见其他发行主体有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 116,287.88 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 5,358,895.05 |
| 5 | 应收申购款 | 9,751,924.48 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 15,227,107.41 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------------|--------------|
| 1 | 132018 | G 三峡 EB1 | 41,722,259.20 | 0.89 |
| 2 | 132020 | 19 蓝星 EB | 24,258,302.00 | 0.52 |
| 3 | 110059 | 浦发转债 | 21,038,657.70 | 0.45 |
| 4 | 110051 | 中天转债 | 18,384,414.00 | 0.39 |
| 5 | 132014 | 18 中化 EB | 16,459,032.80 | 0.35 |
| 6 | 132015 | 18 中油 EB | 13,329,735.80 | 0.28 |
| 7 | 110061 | 川投转债 | 9,779,623.00 | 0.21 |
| 8 | 113044 | 大秦转债 | 6,079,007.20 | 0.13 |
| 9 | 113042 | 上银转债 | 5,472,879.30 | 0.12 |
| 10 | 113525 | 台华转债 | 3,537,496.80 | 0.08 |
| 11 | 110045 | 海澜转债 | 2,358,400.00 | 0.05 |
| 12 | 113026 | 核能转债 | 2,085,042.40 | 0.04 |
| 13 | 113021 | 中信转债 | 1,637,857.20 | 0.03 |
| 14 | 110062 | 烽火转债 | 1,291,197.50 | 0.03 |

| | | | | |
|----|--------|----------|--------------|------|
| 15 | 132021 | 19 中电 EB | 1,233,911.10 | 0.03 |
| 16 | 110053 | 苏银转债 | 1,229,482.80 | 0.03 |
| 17 | 113011 | 光大转债 | 1,189,941.50 | 0.03 |
| 18 | 120004 | 20 华菱 EB | 1,030,867.01 | 0.02 |
| 19 | 127012 | 招路转债 | 928,937.50 | 0.02 |
| 20 | 128022 | 众信转债 | 832,960.00 | 0.02 |
| 21 | 127005 | 长证转债 | 778,224.00 | 0.02 |
| 22 | 110057 | 现代转债 | 555,657.30 | 0.01 |
| 23 | 127015 | 希望转债 | 549,776.70 | 0.01 |
| 24 | 113528 | 长城转债 | 479,980.60 | 0.01 |
| 25 | 127020 | 中金转债 | 440,716.80 | 0.01 |
| 26 | 128057 | 博彦转债 | 320,051.20 | 0.01 |
| 27 | 127006 | 敖东转债 | 281,956.91 | 0.01 |
| 28 | 128081 | 海亮转债 | 281,144.00 | 0.01 |
| 29 | 113545 | 金能转债 | 243,294.00 | 0.01 |
| 30 | 113024 | 核建转债 | 229,924.60 | 0.00 |
| 31 | 110060 | 天路转债 | 214,840.50 | 0.00 |
| 32 | 110056 | 亨通转债 | 210,828.80 | 0.00 |
| 33 | 110052 | 贵广转债 | 182,490.00 | 0.00 |
| 34 | 123022 | 长信转债 | 169,601.40 | 0.00 |
| 35 | 128075 | 远东转债 | 157,976.00 | 0.00 |
| 36 | 123023 | 迪森转债 | 141,021.20 | 0.00 |
| 37 | 127013 | 创维转债 | 137,293.00 | 0.00 |
| 38 | 113530 | 大丰转债 | 127,635.30 | 0.00 |
| 39 | 128100 | 搜特转债 | 88,786.40 | 0.00 |
| 40 | 127011 | 中鼎转 2 | 69,875.00 | 0.00 |
| 41 | 113030 | 东风转债 | 35,109.20 | 0.00 |
| 42 | 110043 | 无锡转债 | 3,546.00 | 0.00 |
| 43 | 113594 | 淳中转债 | 3,277.80 | 0.00 |
| 44 | 113505 | 杭电转债 | 1,200.40 | 0.00 |
| 45 | 110038 | 济川转债 | 1,067.70 | 0.00 |

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五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 | 300507 | 苏奥传感 | 9,398,888.98 | 0.20 | 非公开发行流通受限 |

5.11.6 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 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 兴全沪深 300 指数 (LOF) A | 兴全沪深 300 指数 C |
|----------------------------|------------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 1,876,035,148.89 | 54,983,869.59 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 299,939,118.21 | 23,124,149.11 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 349,461,553.58 | 17,664,674.26 |
| 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 | 1,826,512,713.52 | 60,443,344.44 |

注：1、总申购份额含红利再投资、转换转入份额，总赎回份额含转换转出份额。

2、经与基金托管人中国农业银行协商一致，并报中国证监会备案，管理人决定自 2019 年 6 月 5 日起增设兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) C 类份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| 项目 | 兴全沪深 300 指数 (LOF) A | 兴全沪深 300 指数 C |
|---------------------------|------------------------|---------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 0.00 | 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 | 0.00 | 0.00 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%) | 0.00 | 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。

7.2 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末运用固有资金对本基金进行交易。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

投资者可在二级市场买卖本基金 A 类基金份额，受市场供需关系等各种因素的影响，投资者买卖基金份额有可能面临相应的折溢价风险。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金设立的文件
- 2、《兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金合同》
- 3、《兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 托管协议》
- 4、《兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 更新招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件。

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

9.3 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

2021 年 10 月 27 日