

兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 03 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 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	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	10
3.3 其他指标	13
3.4 过去三年基金的利润分配情况	13
§ 4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	18
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	18
§ 5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	18
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	18
§ 6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
§ 7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	23
7.4 报表附注	24

§ 8 投资组合报告	60
8.1 期末基金资产组合情况	60
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	61
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	62
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	67
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	69
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	69
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	69
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	69
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	69
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	70
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	70
8.12 投资组合报告附注	70
§ 9 基金份额持有人信息	72
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	72
9.2 期末上市基金前十名持有人	72
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	73
9.4 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	73
§ 10 开放式基金份额变动	73
§ 11 重大事件揭示	74
11.1 基金份额持有人大会决议	74
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	74
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	74
11.4 基金投资策略的改变	74
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	74
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	74
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	74
11.8 其他重大事件	75
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	78
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	78
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	78
§ 13 备查文件目录	79
13.1 备查文件目录	79
13.2 存放地点	79
13.3 查阅方式	79

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)	
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	
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	
报告期末基金份额总额	1,793,592,941.08 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2011 年 1 月 19 日	
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	1,735,651,859.03 份	57,941,082.05 份

基金的份额总额	
---------	--

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。

2.2 基金产品说明

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（详见本基金基金合同及招募说明书更新）
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。投资者可在二级市场买卖基金 A 类份额，受市场供需关系等各种因素的影响，投资者买卖基金 A 类份额有可能面临相应的折溢价风险。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨卫东
	联系电话	021-20398888
	电子邮箱	yangwd@xqfunds.com
客户服务电话	4006780099, 021-38824536	95599
传真	021-20398858	010-68121816
注册地址	上海市黄浦区金陵东路 368 号	北京东城区建国门内大街 69 号
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	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	201204	100031
法定代表人	杨华辉	谷澍

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市延安东路 222 号 30 楼
注册登记机构	A 份额: 中国证券登记结算有限责任公司 C 份额: 兴证全球基金管理有限公司	北京市西城区太平桥大街 17 号 上海市浦东新区芳甸路 1155 号嘉里城办公楼 28-30 楼

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位: 人民币元

3.1 .1 期间 数据 和 指标	2021 年		2020 年		2019 年		2019 年 6 月 5 日(基金合同生效日)-2019 年 12 月 31 日
	兴全沪深 300 指数 (LOF) A	兴全沪深 300 指数 C	兴全沪深 300 指数 (LOF) A	兴全沪深 300 指数 C	兴全沪深 300 指数 (LOF) A	兴全沪深 300 指数 C	
本期已实现收益	261,723,383.77	6,637,698.61	452,063,810.75	13,077,943.17	132,797,394.11	2,040,587.64	
本期利润	-301,663,743.35	-9,844,042.58	1,344,281,539.28	35,835,411.20	996,695,903.49	10,934,906.25	
加权平均基金份额本	-0.1638	-0.1772	0.5803	0.5335	0.5680	0.2995	

期利润						
本期加权平均净值利润率	-6.19%	-6.76%	25.57%	23.19%	29.43%	14.93%
本期基金份额净值增长率	-6.37%	-6.74%	28.70%	28.19%	39.23%	16.05%
3.1 .2 期末数据和指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
期末可供分配利润	2,295,630,15 9.69	70,290,837 .08	2,356,610,99 3.62	50,177,502 .06	2,320,718,08 9.98	48,480,404 .43
期末可	1.3226	1.2131	1.1828	1.0846	0.9768	0.8882

供分配基金份额利润						
期末基金资产净值	4,447,379,509.79	147,280,978.02	5,452,329,114.84	126,097,209.54	5,051,758,377.62	116,052,812.39
期末基金份额净值	2.5624	2.5419	2.7366	2.7256	2.1263	2.1263
3.1.3 累计期末指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
基金份额累计净值增长率	156.24%	38.73%	173.66%	48.76%	112.63%	16.05%

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》第 9 页 共 79 页

披露编报规则第 1 号〈主要财务指标的计算及披露〉、《证券投资基金会计核算业务指引》等相关法规。

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴全沪深 300 指数 (LOF) A

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	2.85%	0.80%	1.46%	0.75%	1.39%	0.05%
过去六个月	-3.99%	1.01%	-5.13%	0.97%	1.14%	0.04%
过去一年	-6.37%	1.13%	-4.85%	1.11%	-1.52%	0.02%
过去三年	67.78%	1.23%	60.67%	1.22%	7.11%	0.01%
过去五年	83.70%	1.14%	47.13%	1.14%	36.57%	0.00%
自基金合同生效起至今	156.24%	1.34%	42.16%	1.35%	114.08%	-0.01%

兴全沪深 300 指数 C

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	2.75%	0.80%	1.46%	0.75%	1.29%	0.05%
过去六个月	-4.18%	1.01%	-5.13%	0.97%	0.95%	0.04%
过去一年	-6.74%	1.13%	-4.85%	1.11%	-1.89%	0.02%
自基金合同生效起 至今	38.73%	1.18%	35.52%	1.17%	3.21%	0.01%

注：1、本基金为指数增强型证券投资基金，标的指数是沪深 300 指数，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：

$$\text{Return}_t = 95\% \times (\text{沪深 300 指数}_t / \text{沪深 300 指数}_{t-1} - 1) + 5\% \times (\text{同业存款利率}_t / 360)$$

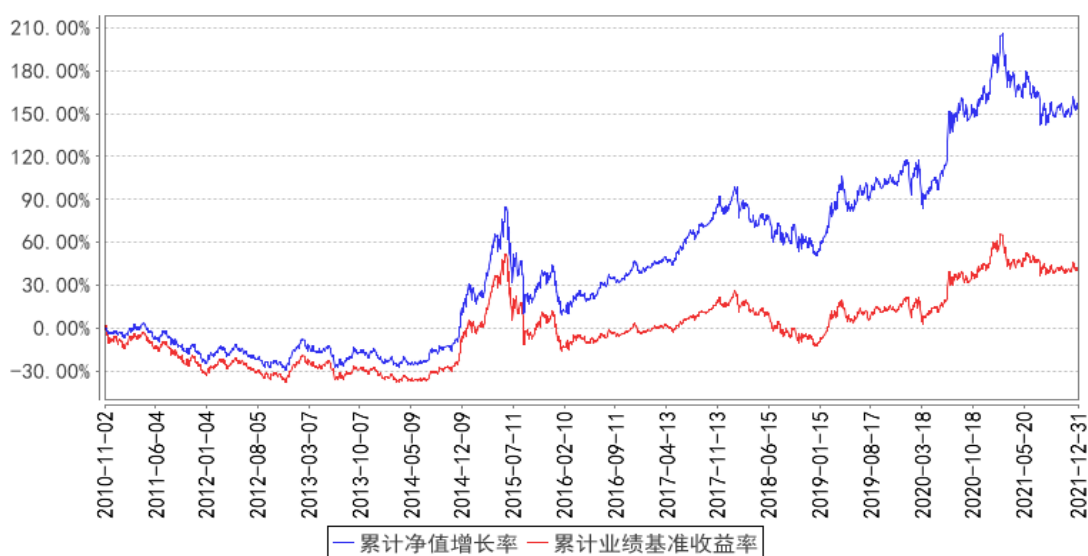
$$\text{Benchmark}_t = (1 + \text{Return}_t) \times (1 + \text{Benchmark}_{t-1}) - 1$$

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

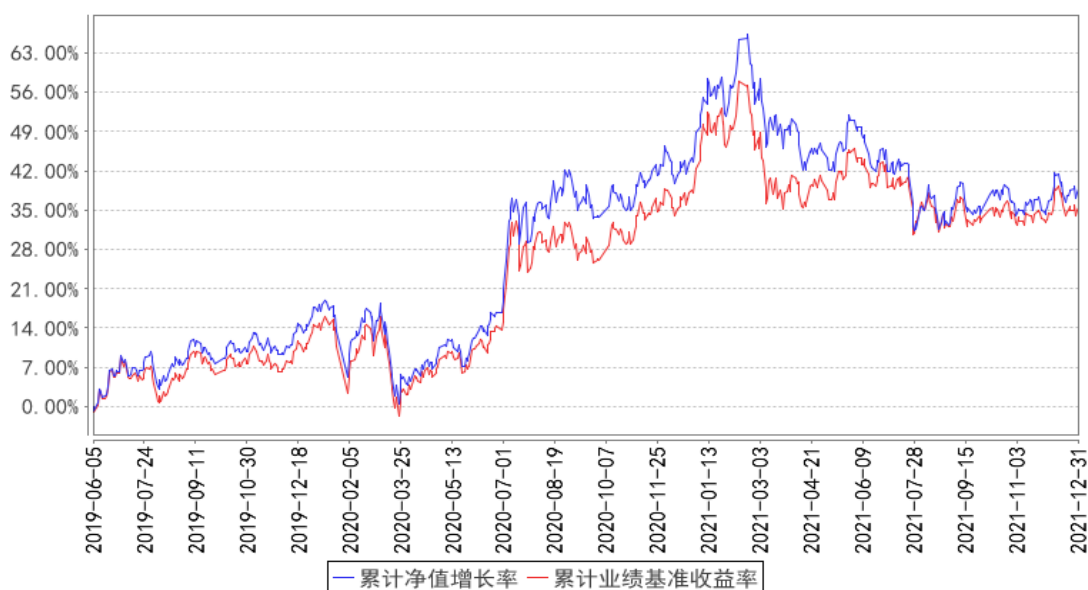
3、经与基金托管人中国农业银行协商一致，并报中国证监会备案，管理人决定自 2019 年 6 月 5 日起增设兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) C 类份额 (代码：007230)。详情请见管理人网站公告。

3.2.2 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



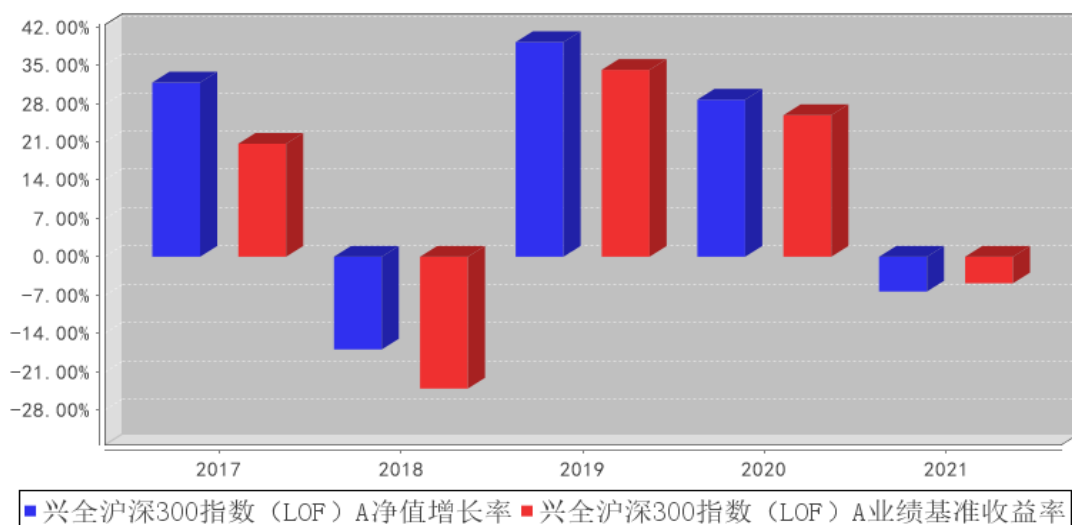
注：1、净值表现所取数据截至到 2021 年 12 月 31 日。

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。

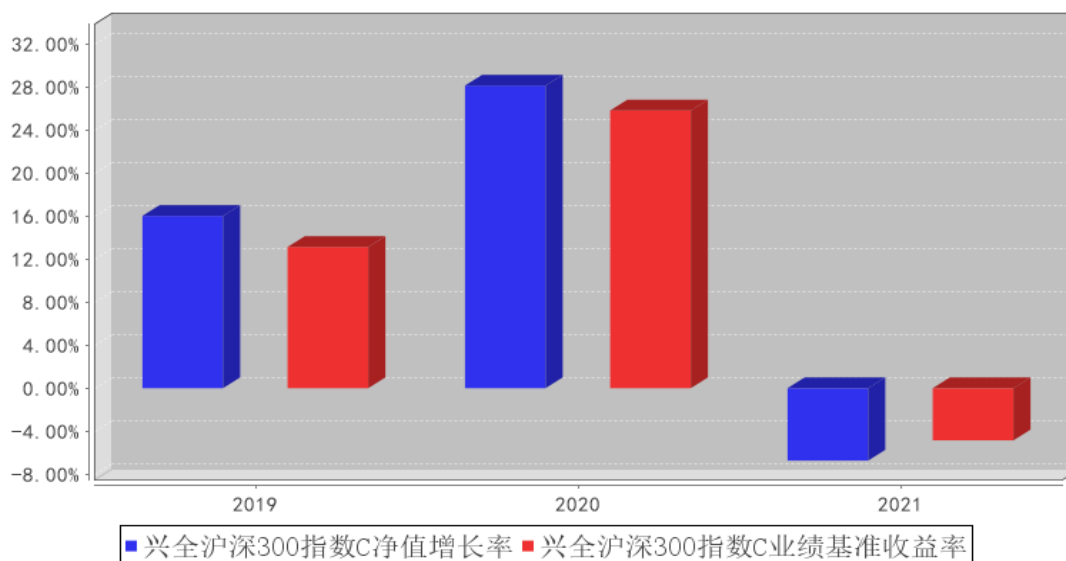
3、经与基金托管人中国农业银行协商一致，并报中国证监会备案，管理人决定自 2019 年 6 月 5 日起增设兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) C 类份额 (代码：007230)。详情请见管理人网站公告。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴全沪深300指数 (LOF) A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



兴全沪深300指数C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：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 C 类份额，2019 年度数据统计区间为 2019 年 6 月 5 日至 2019 年 12 月 31 日，数据按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

注：无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过去三年未进行利润分配。

§ 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		
申庆	兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)、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、兴全恒益债券型证券投资基金基金经理。
张峰	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助理、兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金经理助理	2015 年 12 月 16 日	2021 年 5 月 13 日	10 年	硕士，历任兴证全球基金管理有限公司 FOF 投资与金融工程部研究员、固定收益部研究员。

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 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。

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 年下半年延续了极度分化的结构性行情，使得指数增强依旧成为一件具有挑战性的工作。下半年沪深 300、中证 500、创业板指的涨幅分别为-5.43%、8.10%、-4.44%，受益于对“专精特新”的扶持，中小市值风格突出，而交易拥挤度较高的“赛道”资产回撤明显。

随着上市公司盈利拐点的确认，以及稳增长预期增强，下半年的市场风格变得更为均衡，无论是高景气的“赛道”资产，还是高 ROE 稳定成长的“核心”资产，表现均较为一般。中小市值风格虽然相对较强，但波动也较大。之前我们判断高景气类资产的拐点可能由报表低于预期而触发，目前看仅仅情绪扰动，甚至无需低于预期也会导致了相关板块的回调。回头看，下半年表现相对一般的大市值“核心资产”和“高景气资产”两者共同特征是交易拥挤度高，多少都经历过抱团拔估值的正反馈，建立在一致预期上的高估值合理化信仰都给上述资产带来脆弱性。

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。随着投资策略工具箱的不断扩大，我们有信心在未来复杂多变的 market 环境中有效降低整体组合的下方风险，并持续积累更多的超额收益。

4.4.2 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 2.5624 元，本报告期基金份额净值增长率为-6.37%，同期业绩比较基准收益率为-4.85%；截至本报告期末兴全沪深 300 指数 C 的基金份额净值为 2.5419 元，本报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-4.85%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前宏观经济面临一定挑战，稳增长成为共识。货币政策进一步发力，央行于年初调降利率，宽信用也有所加码，一月份社融超预期。需要关注海外经济体加息造成的影响。

目前市场面临的问题是拥挤交易之后重归理性。虽然部分“核心”、“赛道”经历年初的调整，估值相对合理化，但一方面钟摆效应可能导致合理估值未必就是最合理的配置时机，另一方面上述资产的“合理”估值仍有很大程度上建立在高度趋同的一致预期上。此外，居民财富再配置的节奏也是重要的影响因素。

我们坚持之前的判断，历史上任何时期的情绪化高估值品种都会向合理水平回归。从投资研究实践看，我们仍认为市场对较为长期的未来并无太强的预测能力。无论是采用超长期预测的“终局”给出乐观的远期估值，还是草木皆兵地对一些政策甚至谣言过度反应，都反映出市场较为浮躁，高度情绪化。作为投资者，我们既要面向未来，努力从经济转型带来的新技术、新产业、新模式中获益，又不能简单地随波逐流，而是要独立思考，从第一性原理出发，进行合乎理性的定价。

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 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

本条不适用。

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

在托管本基金的过程中, 本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定, 对本基金基金管理人—兴证全球基金管理有限公司 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日基金的投资运作, 进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督, 认真履行了托管人的义务, 没有从事任何损害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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为, 兴证全球基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上, 不存在损害基金份额持有人利益的行为; 在报告期内, 严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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

本托管人认为, 兴证全球基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定, 基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整, 未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(22)第 P01784 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金(LOF)全体基金份额持有人

审计意见	<p>我们审计了兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 的财务报表, 包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表, 2021 年度的利润表、所有者权益 (基金净值) 变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为, 后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制, 公允反映了兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。</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, 我们独立于兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF), 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	不适用
其他事项	不适用
其他信息	<p>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。其他信息包括兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 2021 年度报告中涵盖的信息, 但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息, 我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计, 我们的责任是阅读其他信息, 在此过程中, 考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。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>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表, 使其实现公允反映, 并设计、执行和维护必要的内部控制, 以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时, 基金管理人管理层负责评估兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 的持续经营能力, 披露与持续经营相关的事项 (如适用), 并运用持续经营假设, 除非基金管理人管理层计划清算兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)、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沪深 300 指数增强型证券投资</p>

	资基金 (LOF) 的财务报告过程。	
注册会计师对财务报表审计的责任	<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，就可能对兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金不能持续经营。</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	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	吴凌志	冯适
会计师事务所的地址	上海市延安东路 222 号 30 楼	
审计报告日期	2022 年 3 月 29 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	10,118,006.07	363,031.95
结算备付金		6,694,211.62	11,464,041.04
存出保证金		103,630.16	604,180.11
交易性金融资产	7.4.7.2	4,812,198,852.24	5,816,601,142.73
其中：股票投资		4,379,185,139.40	5,352,995,578.31
基金投资		-	-
债券投资		433,013,712.84	463,605,564.42
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	-	2,000,000.00
应收证券清算款		15,327,355.12	58,264,095.25
应收利息	7.4.7.5	4,585,385.93	4,550,116.40
应收股利		-	-
应收申购款		6,601,872.40	10,782,525.12
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		4,855,629,313.54	5,904,629,132.60
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
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		228,093,047.42	284,999,499.50
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		28,206,989.28	35,581,742.10
应付管理人报酬		3,178,636.84	3,792,299.09
应付托管费		595,994.40	711,056.09
应付销售服务费		50,014.24	49,550.78
应付交易费用	7.4.7.7	361,266.03	480,605.47
应交税费		2,011.25	2,333.60
应付利息		93,996.12	80,702.37
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	386,870.15	505,019.22
负债合计		260,968,825.73	326,202,808.22
所有者权益：			

实收基金	7.4.7.9	1,793,592,941.08	2,038,634,951.85
未分配利润	7.4.7.10	2,801,067,546.73	3,539,791,372.53
所有者权益合计		4,594,660,487.81	5,578,426,324.38
负债和所有者权益总计		4,855,629,313.54	5,904,629,132.60

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，兴全沪深 300 指数 (LOF) A 基金份额净值 2.5624 元，基金份额总额 1,735,651,859.03 份；兴全沪深 300 指数 C 基金份额净值 2.5419 元，基金份额总额 57,941,082.05 份。兴全沪深 300 指数 (LOF) 份额总额合计为 1,793,592,941.08 份。

7.2 利润表

会计主体：兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		-253,442,648.17	1,444,797,172.08
1. 利息收入		8,388,891.58	8,904,553.71
其中：存款利息收入	7.4.7.11	178,669.91	308,391.02
债券利息收入		8,164,786.94	8,454,115.08
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		45,434.73	142,047.61
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		313,722,967.11	512,405,886.75
其中：股票投资收益	7.4.7.12	199,367,935.58	364,236,563.36
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	14,543,956.81	22,436,825.46
资产支持证券投资	7.4.7.13.5	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	99,811,074.72	125,732,497.93
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-579,868,868.31	914,975,196.56
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	4,314,361.45	8,511,535.06
减：二、费用		58,065,137.76	64,680,221.60

1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	40,241,731.59	43,217,307.35
2. 托管费	7.4.10.2.2	7,545,324.72	8,103,245.15
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	582,035.94	615,734.38
4. 交易费用	7.4.7.19	3,058,432.27	6,441,149.33
5. 利息支出		5,525,867.44	5,119,960.37
其中：卖出回购金融资产支出		5,525,867.44	5,119,960.37
6. 税金及附加		3,394.92	3,280.53
7. 其他费用	7.4.7.20	1,108,350.88	1,179,544.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-311,507,785.93	1,380,116,950.48
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-311,507,785.93	1,380,116,950.48

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,038,634,951.85	3,539,791,372.53	5,578,426,324.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-311,507,785.93	-311,507,785.93
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）	-245,042,010.77	-427,216,039.87	-672,258,050.64
其中：1. 基金申购款	1,295,191,338.88	2,183,069,481.67	3,478,260,820.55
2. 基金赎回款	-1,540,233,349.65	-2,610,285,521.54	-4,150,518,871.19
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)	1,793,592,941.08	2,801,067,546.73	4,594,660,487.81
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,430,393,556.81	2,737,417,633.20	5,167,811,190.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,380,116,950.48	1,380,116,950.48
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)	-391,758,604.96	-577,743,211.15	-969,501,816.11
其中：1. 基金申购款	2,828,237,710.05	3,408,396,941.46	6,236,634,651.51
2. 基金赎回款	-3,219,996,315.01	-3,986,140,152.61	-7,206,136,467.62
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	2,038,634,951.85	3,539,791,372.53	5,578,426,324.38

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

兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) (原名兴业沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF))，(以下简称“本基金”)，系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[2010]1068 号《关于核准兴业沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 募集的批复》的核准，由兴证全球基金管理有限公司作为管理人向社会公开发行募集，基金合同于 2010 年 11 月 2 日正

式生效,首次设立募集规模为 2,955,476,122.49 份基金份额。本基金为契约型上市开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为兴证全球基金管理有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。本基金于 2011 年 1 月 1 日起更名为兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金(LOF)。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。

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括投资于国内依法发行上市的股票、存托凭证、债券、权证以及经中国证监会批准允许本基金投资的其它金融工具。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90%-95%,投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 90%。现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-10%,其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%;其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

本基金的业绩基准为:沪深 300 指数 \times 95%+同业存款利率 \times 5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

本基金系在持续经营假设的基础上编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

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

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

(1) 金融资产分类

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

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

(2) 金融负债分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

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

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

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

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

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

(2) 债券投资

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

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

卖出债券于交易日确认债券投资收益；卖出债券的成本按移动加权平均法结转。

(3) 回购协议

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利, 且该种法定权利现在是可执行的, 同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时, 金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外, 金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示, 不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时, 申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时, 申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算, 并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

(4) 买入返售金融资产收入, 按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同

利率差异较小时，也可以用合同利率)，在回购期内逐日计提。

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

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

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

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

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 的年费率逐日计提。

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率逐日计提。

(3) C 类基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.4% 的年费率逐日计提。

(4) 基金指数使用费用包括指数许可使用固定费和指数许可使用基点费。其中，指数许可使用固定费是为获取使用指数开发基金而支付的一次性费用，不列入基金费用；在通常情况下，指数许可使用基点费按前一日的基金资产净值的 0.016% 年费率计提，每日计算，逐日累计，按季支付，每季度指数许可使用基点费的下限为 5 万元。

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金的每份基金份额享有同等分配权；

(2) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 60%；若基金合同生效不满 3 个月，可不进行收益分配；基金的收益分配比例应当以收益分配基准日可供分配利润为基准计算。收益分配基准日可供分配利润指收益分配基准日本基金资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数；

- (3) 基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
- (4) 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，基金投资者可选择现金红利或将现金红利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；（本基金场内份额的分红方式只能是现金分红。）基金实施收益分配的，基金红利发放日距离收益分配基准日，即收益分配基准日可供分配利润计算截止日，不得超过 15 个工作日；
- (5) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.12 分部报告

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

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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

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

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入,由上市公司代扣代缴个人所得税;从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 对于基金从事A股买卖,出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税,对受让方不再缴纳印花税。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	10,118,006.07	363,031.95
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	10,118,006.07	363,031.95

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,370,575,605.98	4,379,185,139.40	1,008,609,533.42
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	214,954,413.76	252,674,712.84
	银行间市场	180,594,740.00	180,339,000.00
	合计	395,549,153.76	433,013,712.84
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	3,766,124,759.74	4,812,198,852.24	1,046,074,092.50
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,740,421,918.58	5,352,995,578.31	1,612,573,659.73
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	320,378,303.34	333,660,564.42
	银行间市场	129,857,960.00	129,945,000.00
	合计	450,236,263.34	463,605,564.42
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	4,190,658,181.92	5,816,601,142.73	1,625,942,960.81

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	2,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	2,000,000.00	-

注：本基金本报告期末及上年度末各项买入返售金融资产余额均为零。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未通过买断式逆回购交易取得债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	674.67	2,166.12
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	3,313.64	5,674.68
应收债券利息	4,581,346.25	4,541,976.62
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	51.37	298.98
合计	4,585,385.93	4,550,116.40

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	353,145.02	476,345.83
银行间市场应付交易费用	8,121.01	4,259.64
合计	361,266.03	480,605.47

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	19,804.90	107,569.40
应付证券出借违约金	-	-
预提信息披露费	120,000.00	120,000.00
应付指数使用费	191,065.25	221,449.82
预提审计费	56,000.00	56,000.00
合计	386,870.15	505,019.22

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

兴全沪深 300 指数 (LOF) A

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	1,992,371,296.24	1,992,371,296.24
本期申购	1,195,623,440.85	1,195,623,440.85
本期赎回 (以“-”号填列)	-1,452,342,878.06	-1,452,342,878.06
-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	1,735,651,859.03	1,735,651,859.03

兴全沪深 300 指数 C

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	46,263,655.61	46,263,655.61
本期申购	99,567,898.03	99,567,898.03
本期赎回 (以“-”号填列)	-87,890,471.59	-87,890,471.59
-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	57,941,082.05	57,941,082.05

注：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

兴全沪深 300 指数 (LOF) A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,356,610,993.62	1,103,346,824.98	3,459,957,818.60
本期利润	261,723,383.77	-563,387,127.12	-301,663,743.35
本期基金份额交易产生的变动数	-322,704,217.70	-123,862,206.79	-446,566,424.49
其中：基金申购款	1,514,907,118.31	499,833,639.63	2,014,740,757.94
基金赎回款	-1,837,611,336.01	-623,695,846.42	-2,461,307,182.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,295,630,159.69	416,097,491.07	2,711,727,650.76

兴全沪深 300 指数 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	50,177,502.06	29,656,051.87	79,833,553.93
本期利润	6,637,698.61	-16,481,741.19	-9,844,042.58
本期基金份额交易产生的变动数	13,475,636.41	5,874,748.21	19,350,384.62
其中：基金申购款	115,540,737.76	52,787,985.97	168,328,723.73
基金赎回款	-102,065,101.35	-46,913,237.76	-148,978,339.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	70,290,837.08	19,049,058.89	89,339,895.97

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	41,138.72	99,194.39
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	128,952.50	151,793.83
其他	8,578.69	57,402.80
合计	178,669.91	308,391.02

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	199,367,935.58	364,236,563.36
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	199,367,935.58	364,236,563.36

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出股票成交总额	1,407,546,419.27	2,742,521,923.08
减：卖出股票成本总额	1,208,178,483.69	2,378,285,359.72
买卖股票差价收入	199,367,935.58	364,236,563.36

7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	14,543,956.81	22,436,825.46
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	14,543,956.81	22,436,825.46

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	516,535,702.57	479,888,618.44
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	492,826,476.96	447,733,668.49
减：应收利息总额	9,165,268.80	9,718,124.49
买卖债券差价收入	14,543,956.81	22,436,825.46

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债权投资收益赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债权投资收益申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未投资衍生工具。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	99,811,074.72	125,732,497.93
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	99,811,074.72	125,732,497.93

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	-579,868,868.31	914,975,196.56
股票投资	-603,964,126.31	921,297,442.62
债券投资	24,095,258.00	-6,322,246.06
资产支持证券投资	-	-

基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减: 应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-579,868,868.31	914,975,196.56

7.4.7.18 其他收入

单位: 人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
基金赎回费收入	4,193,273.70	8,314,393.23
基金转换费收入	121,087.75	197,141.83
合计	4,314,361.45	8,511,535.06

7.4.7.19 交易费用

单位: 人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	3,051,382.27	6,429,474.33
银行间市场交易费用	7,050.00	11,675.00
合计	3,058,432.27	6,441,149.33

7.4.7.20 其他费用

单位: 人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	56,000.00	56,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
上市费用	60,000.00	60,000.00
指数使用费	804,834.61	864,346.15
其他费用	600.00	-
银行费用	30,316.27	41,998.34
账户维护费用	36,600.00	37,200.00
合计	1,108,350.88	1,179,544.49

7.4.7.21 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要在财务报表辅助中说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金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、基金销售机构、注册登记机构（C 份额）
中国农业银行股份有限公司（以下简称“农业银行”）	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
全球人寿保险国际公司（AEGON International B.V）	基金管理人的股东
兴证全球资本管理（上海）有限公司（“兴证全球资本”）	基金管理人控制的公司

注：以下关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
兴业证券	1,906,711,411.79	100.00	4,270,602,898.33	100.00

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1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期债券 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	141,284,366.84	100.00	168,685,977.08	100.00

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1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期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	17,266,948,000.00	100.00	18,408,049,000.00	100.00

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
兴业证券	1,395,946.85	100.00	353,145.02	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
兴业证券	3,131,424.91	100.00	476,345.83	100.00

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用（包括但不限于买（卖）经手费、证券结算风险基金和买（卖）证管费等）。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	40,241,731.59
其中：支付销售机构的客户维护费	11,837,648.99	11,377,584.18

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.80% 的年费率计提。计算方法如下：每日应支付的

基金管理费=前一日的基金资产净值×0.80%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	7,545,324.72	8,103,245.15

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。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。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2021年1月1日至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴全沪深300指数(LOF) A	兴全沪深300指数C	合计
兴证全球基金	-	38,895.29	38,895.29
合计	-	38,895.29	38,895.29
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020年1月1日至2020年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴全沪深300指数(LOF) A	兴全沪深300指数C	合计
兴证全球基金	-	145,460.99	145,460.99
合计	-	145,460.99	145,460.99

注：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。基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售、服务等各项费用，由基金管理人支配使用。本报告期内本基金的 A 类份额不收取销售服务费，C 类份额基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.40% 的年费率计提。计算方法如下：每日应支付的 C 类基金份额销售服务费=C 类基金份额前一日的基金资产净值×年销售服务费率/当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	本期
	2021年1月1日至2021年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
	兴全沪深300指数(LOF)A	兴全沪深300指数C
基金合同生效日(2010年11月2日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	0.00	-
报告期内申购/买入总份额	0.00	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0000%	-
项目	上年度可比期间	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
	兴全沪深300指数(LOF)A	兴全沪深300指数C
基金合同生效日(2010年11	-	-

月 2 日) 持有的基金份额		
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份 额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-

注: 本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

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: 本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31 日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
农业银行	10,118,006.07	41,138.72	363,031.95	99,194.39

注: 注: 本基金的银行存款由基金托管人农业银行保管, 按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

注: 本基金本报告期内未进行利润分配。

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	2022 年 1	新股 流通	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-

		月 31 日	月 11 日	受限							
002452	长高集团	2021年9月6日	2022年3月8日	非公开发行流通受限	4.70	8.98	808,511	3,800,001.70	7,260,428.78	-	
002555	三七互娱	2021年10月20日	2022年4月20日	大宗交易购入流通受限	21.10	25.37	500,000	10,550,000.00	12,685,000.00	-	
002555	三七互娱	2021年12月21日	2022年6月21日	大宗交易购入流通受限	23.43	24.77	100,000	2,343,000.00	2,477,000.00	-	
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	5,000,000	45,000,000.00	35,800,000.00	-	
002627	三峡旅游	2021年7月19日	2022年1月20日	非公开发行流通受限	4.79	5.28	1,043,841	4,999,998.39	5,511,480.48	注 2	
002728	特一药业	2021年11月29日	2022年6月1日	非公开发行流通受限	10.92	15.86	915,751	10,000,000.92	14,523,810.86	-	
002792	通宇通讯	2021年12月7日	2022年6月10日	非公开发行流通受限	12.64	15.33	300,632	3,799,988.48	4,608,688.56	-	
002915	中欣氟材	2021年8月20日	2022年2月28日	非公开发行流通受限	17.05	27.10	293,255	4,999,997.75	7,947,210.50	-	
002938	鹏鼎控股	2021年7月	2022年1	大宗交易	32.65	41.72	500,000	16,325,000.00	20,860,000.00	-	

		9 日	月 10 日	购入 流通 受限							
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	208,446	8,337,840.00	8,264,883.90	-	
002947	恒铭 达	2021 年 9 月 7 日	2022 年 3 月 8 日	非公 开发 行流 通受 限	20.10	35.24	248,756	4,999,995.60	8,766,161.44	-	
300293	蓝英 装备	2021 年 11 月 16 日	2022 年 5 月 17 日	非公 开发 行流 通受 限	11.61	12.15	68,906	799,998.66	837,207.90	-	
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	424,088	4,999,997.52	5,962,677.28	-	
300413	芒果 超媒	2021 年 8 月 19 日	2022 年 2 月 24 日	非公 开发 行流 通受 限	49.81	54.34	93,689	4,666,649.09	5,091,060.26	-	
300506	名家 汇	2021 年 12 月 28 日	2022 年 6 月 30 日	非公 开发 行流 通受 限	6.30	6.85	793,651	5,000,001.30	5,436,509.35	-	
300507	苏奥 传感	2021 年 8 月 4 日	2022 年 2 月 7 日	非公 开发 行流 通受 限	7.22	13.11	1,246,537	8,999,997.14	16,342,100.07	-	
300774	倍杰 特	2021 年 7 月 26 日	2022 年 02 月 16 日	新股 流通 受限	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-	
300814	中富 电路	2021 年 8 月	2022 年 2	新股 流通	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-	

		4 日	月 14 日	受限							
301017	漱玉平民	2021 年 6 月 23 日	2022 年 1 月 5 日	新股流通受限	8.86	23.80	555	4,917.30	13,209.00	-	
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股流通受限	10.64	30.44	421	4,479.44	12,815.24	-	
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股流通受限	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-	
301025	读客文化	2021 年 7 月 6 日	2022 年 01 月 24 日	新股流通受限	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-	
301026	浩通科技	2021 年 7 月 8 日	2022 年 1 月 17 日	新股流通受限	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-	
301027	华蓝集团	2021 年 7 月 8 日	2022 年 01 月 19 日	新股流通受限	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-	
301028	东亚机械	2021 年 7 月 12 日	2022 年 1 月 20 日	新股流通受限	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-	
301029	怡合达	2021 年 7 月 14 日	2022 年 1 月 24 日	新股流通受限	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-	
301030	仕净科技	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 24 日	新股流通受限	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-	
301032	新柴股份	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 24 日	新股流通受限	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-	
301033	迈普医学	2021 年 7 月	2022 年 1 月	新股流通	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-	

		15 日	月 26 日	受限						
301036	双乐股份	2021 年 7 月 21 日	2022 年 02 月 16 日	新股流通受限	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301037	保立佳	2021 年 7 月 21 日	2022 年 2 月 7 日	新股流通受限	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301038	深水规院	2021 年 7 月 22 日	2022 年 2 月 7 日	新股流通受限	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301039	中集车辆	2021 年 7 月 1 日	2022 年 1 月 10 日	新股流通受限	6.96	12.51	2,064	14,365.44	25,820.64	-
301040	中环海陆	2021 年 7 月 26 日	2022 年 2 月 7 日	新股流通受限	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301041	金百泽	2021 年 8 月 2 日	2022 年 2 月 11 日	新股流通受限	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301046	能辉科技	2021 年 8 月 10 日	2022 年 2 月 17 日	新股流通受限	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301048	金鹰重工	2021 年 8 月 11 日	2022 年 02 月 28 日	新股流通受限	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301049	超越科技	2021 年 8 月 17 日	2022 年 2 月 24 日	新股流通受限	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301050	雷电微力	2021 年 8 月 17 日	2022 年 2 月 24 日	新股流通受限	60.64	234.74	233	14,129.12	54,694.42	-
301052	果麦文化	2021 年 8 月	2022 年 02	新股流通	8.11	33.64	252	2,043.72	8,477.28	-

		23 日	月 28 日	受限						
301053	远信工业	2021 年 8 月 25 日	2022 年 3 月 1 日	新股流通受限	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301056	森赫股份	2021 年 8 月 27 日	2022 年 3 月 7 日	新股流通受限	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301057	汇隆新材	2021 年 8 月 31 日	2022 年 3 月 9 日	新股流通受限	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301059	金三江	2021 年 9 月 3 日	2022 年 3 月 14 日	新股流通受限	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301062	上海艾录	2021 年 9 月 7 日	2022 年 3 月 14 日	新股流通受限	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301063	海锅股份	2021 年 9 月 9 日	2022 年 3 月 24 日	新股流通受限	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
301072	中捷精工	2021 年 9 月 22 日	2022 年 3 月 29 日	新股流通受限	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301078	孩子王	2021 年 9 月 30 日	2022 年 4 月 14 日	新股流通受限	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301079	邵阳液压	2021 年 10 月 11 日	2022 年 4 月 19 日	新股流通受限	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-
301081	严牌股份	2021 年 10 月 13 日	2022 年 4 月 20 日	新股流通受限	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-
301083	百胜智能	2021 年 10 月	2022 年 4 月	新股流通	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-

		月 13 日	月 21 日	受限						
301089	拓新 药业	2021 年 10 月 20 日	2022 年 4 月 27 日	新股 流通 受限	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301092	争光 股份	2021 年 10 月 21 日	2022 年 5 月 5 日	新股 流通 受限	36.31	35.52	323	11,728.13	11,472.96	-
301093	华兰 股份	2021 年 10 月 21 日	2022 年 5 月 5 日	新股 流通 受限	58.08	49.85	409	23,754.72	20,388.65	-
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	-
301098	金埔 园林	2021 年 11 月 4 日	2022 年 5 月 12 日	新股 流通 受限	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	-
301138	华研 精机	2021 年 12 月 8 日	2022 年 6 月 15 日	新股 流通 受限	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10	-
301149	隆华 新材	2021 年 11 月 3 日	2022 年 5 月 10 日	新股 流通 受限	10.07	16.76	1,214	12,224.98	20,346.64	-
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	2022 年 6	新股 流通	27.85	27.46	575	16,013.75	15,789.50	-

		月 17 日	月 24 日	受限							
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	-	
600152	维科 技术	2021 年 7 月 26 日	2022 年 1 月 24 日	非公 开发 行流 通受 限	6.13	8.04	815,660	4,999,995.80	6,557,906.40	-	
600745	闻泰 科技	2021 年 8 月 20 日	2022 年 2 月 21 日	大宗 交易 购入 流通 受限	92.81	125.52	100,000	9,281,000.00	12,552,000.00	-	
601360	三六 零	2021 年 7 月 12 日	2022 年 1 月 12 日	大宗 交易 购入 流通 受限	11.48	12.63	900,000	10,332,000.00	11,367,000.00	-	
601728	中国 电信	2021 年 8 月 11 日	2022 年 2 月 21 日	新股 流通 受限	4.53	4.27	394,011	1,784,869.83	1,682,426.97	-	
603042	华脉 科技	2021 年 7 月 21 日	2022 年 01 月 20 日	非公 开发 行流 通受 限	10.24	12.95	292,969	3,000,002.56	3,793,948.55	-	
603496	恒为 科技	2021 年 8 月 25 日	2022 年 02 月 24 日	非公 开发 行流 通受 限	11.99	15.05	417,014	4,999,997.86	6,276,060.70	-	
688036	传音 控股	2021 年 11 月 19 日	2022 年 5 月 19 日	大宗 交易 购入 流通 受限	160.00	145.49	70,000	11,200,000.00	10,184,300.00	-	
688187	时代 电气	2021 年 8 月 30 日	2022 年 3 月 7 日	新股 流通 受限	31.38	76.65	33,865	1,062,683.70	2,595,752.25	-	

688190	云路股份	2021年11月18日	2022年5月26日	新股流通受限	46.63	92.51	3,026	141,102.38	279,935.26	-
688255	凯尔达	2021年10月14日	2022年4月25日	新股流通受限	47.11	37.87	1,648	77,637.28	62,409.76	-
688511	天微电子	2021年7月22日	2022年2月7日	新股流通受限	28.09	54.52	1,490	41,854.10	81,234.80	-
688772	珠海冠宇	2021年9月30日	2022年4月15日	新股流通受限	14.43	39.09	12,960	187,012.80	506,606.40	-

注：1、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。

2、公司证券简称自 2021 年 8 月 5 日起由“宜昌交运”变更为“三峡旅游”。

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的流通受限股票。

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

截止本报告期末 2021 年 12 月 31 日，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额 81,839,047.42 元，是以如下证券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
210216	21 国开 16	2022 年 1 月 12 日	99.96	140,000	13,994,400.00
190003	19 付息国债 03	2022 年 1 月 19 日	100.13	100,000	10,013,000.00
150204	15 国开 04	2022 年 1 月 4 日	100.16	100,000	10,016,000.00
190207	19 国开 07	2022 年 1 月 4 日	100.32	70,000	7,022,400.00
200312	20 进出 12	2022 年 1 月 4 日	100.35	230,000	23,080,500.00
210216	21 国开 16	2022 年 1 月 4 日	99.96	5,000	499,800.00

		日			
200002	20 付息国 债 02	2022 年 1 月 7 日	100.01	10,000	1,000,100.00
210304	21 进出 04	2022 年 1 月 7 日	100.03	100,000	10,003,000.00
210407	21 农发 07	2022 年 1 月 7 日	99.84	100,000	9,984,000.00
合计				855,000	85,613,200.00

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末 2021 年 12 月 31 日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 146,254,000.00 元,于 2022 年 1 月 4 日、2022 年 1 月 5 日、2022 年 1 月 6 日、2022 年 1 月 7 日、2022 年 1 月 11 日、2022 年 1 月 12 日、2022 年 1 月 13 日及 2022 年 1 月 25 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算标准券后,不低于债券回购交易的余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注:本基金本报告期末未持有因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

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

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

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息,导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券,且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券,不得超过该证券的 10%。

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金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。

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。

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。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	192,609,440.63	130,675,956.02
AAA 以下	6,063,516.81	41,228,820.80
未评级	-	-
合计	198,672,957.44	171,904,776.82

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。

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。

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。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比

例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金为开放式基金，投资者可在合同规定的交易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	10,118,006.07	-	-	-	-	-	10,118,006.07
结算备付金	6,694,211.6	-	-	-	-	-	6,694,211.6

	2						62
存出保证金	103,630.16	-	-	-	-	-	103,630.16
交易性金融资产	30,006,000.00	75,117,924.20	132,777,308.50	153,774,918.16	41,337,561.98	4,379,185,139.40	4,812,198,852.24
应收利息	-	-	-	-	-	4,585,385.93	4,585,385.93
应收申购款	98,929.54	-	-	-	-	6,502,942.86	6,601,872.40
应收证券清算款	-	-	-	-	-	15,327,355.12	15,327,355.12
资产总计	47,020,777.39	75,117,924.20	132,777,308.50	153,774,918.16	41,337,561.98	4,405,600,823.31	4,855,629,313.54
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	28,206,989.28	28,206,989.28
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,178,636.84	3,178,636.84
应付托管费	-	-	-	-	-	595,994.40	595,994.40
卖出回购金融资产款	228,093,047.42	-	-	-	-	-	228,093,047.42
应付销售服务费	-	-	-	-	-	50,014.24	50,014.24
应付交易费用	-	-	-	-	-	361,266.03	361,266.03
应付利息	-	-	-	-	-	93,996.12	93,996.12
应交税费	-	-	-	-	-	2,011.25	2,011.25
其他负债	-	-	-	-	-	386,870.15	386,870.15
负债总计	228,093,047.42	-	-	-	-	32,875,778.31	260,968,825.73
利率敏感度缺口	-181,072,270.03	75,117,924.20	132,777,308.50	153,774,918.16	41,337,561.98	4,372,725,045.00	4,594,660,487.81
上年度末							
2020年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	363,031.95	-	-	-	-	-	363,031.95
结算备付金	11,464,041.04	-	-	-	-	-	11,464,041.04
存出保证金	604,180.11	-	-	-	-	-	604,180.11
交易性金融资产	20,498,950.00	130,119,919.60	141,081,918.00	157,724,254.49	14,180,522.33	5,352,995,578.31	5,816,601,142.73
买入返售金融	2,000,000.00	-	-	-	-	-	2,000,000.00

资产	0						00
应收利息	-	-	-	-	-	4,550,116.40	4,550,116.40
应收申购款	100,632.18	-	-	-	-	10,681,892.94	10,782,525.12
应收证券清算款	-	-	-	-	-	58,264,095.25	58,264,095.25
资产总计	35,030,835.28	130,119,919.60	141,081,918.00	157,724,254.49	14,180,522.33	5,426,491,682.90	5,904,629,132.60
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	35,581,742.10	35,581,742.10
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,792,299.09	3,792,299.09
应付托管费	-	-	-	-	-	711,056.09	711,056.09
卖出回购金融资产款	284,999,499.50	-	-	-	-	-	284,999,499.50
应付销售服务费	-	-	-	-	-	49,550.78	49,550.78
应付交易费用	-	-	-	-	-	480,605.47	480,605.47
应付利息	-	-	-	-	-	80,702.37	80,702.37
应交税费	-	-	-	-	-	2,333.60	2,333.60
其他负债	-	-	-	-	-	505,019.22	505,019.22
负债总计	284,999,499.50	-	-	-	-	41,203,308.72	326,202,808.22
利率敏感度缺口	-249,968,664.22	130,119,919.60	141,081,918.00	157,724,254.49	14,180,522.33	5,385,288,374.18	5,578,426,324.38

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)	上年度末(2020年12月31日)	
分析	利率+1%	-850,020.78	-1,002,072.64

	利率-1%	859,254.70	1,012,486.73
--	-------	------------	--------------

注：上表反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

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

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

本基金投资组合中股票投资比例范围为本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 90%。现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-10%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	4,379,185,139.40	95.31	5,352,995,578.31	95.96
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	433,013,712.84	9.42	463,605,564.42	8.31
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	4,812,198,852.24	104.73	5,816,601,142.73	104.27

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)	上年度末 (2020 年 12 月 31 日)
分析	业绩比较基准+10%	470,489,213.99	574,665,666.93
	业绩比较基准-10%	-470,489,213.99	-574,665,666.93

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

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

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

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日, 本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 4,317,555,340.69 元, 第二层次的余额为人民币 494,643,511.55 元, 无属于第三层次的余额 (2020 年 12 月 31 日: 属于第一层次的余额为人民币 5,237,790,572.53 元, 第二层次的余额为人民币 578,810,570.20 元, 无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

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

(iii) 第三层次公允价值计量的金融工具

无。

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

经评估，新金融工具准则预期不会对本基金财务报表产生重大影响。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	4,379,185,139.40	90.19
	其中：股票	4,379,185,139.40	90.19
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	433,013,712.84	8.92
	其中：债券	433,013,712.84	8.92
	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	16,812,217.69	0.35
8	其他各项资产	26,618,243.61	0.55
9	合计	4,855,629,313.54	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	2,239,167.60	0.05
B	采矿业	130,895,051.11	2.85
C	制造业	2,172,324,706.04	47.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	47,222,138.60	1.03
E	建筑业	36,322,980.00	0.79
F	批发和零售业	22,702,170.96	0.49
G	交通运输、仓储和邮政业	71,565,768.72	1.56
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	153,654,803.93	3.34
J	金融业	1,010,351,091.35	21.99
K	房地产业	105,307,615.73	2.29
L	租赁和商务服务业	293,436,855.49	6.39
M	科学研究和技术服务业	1,484,452.18	0.03
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	35,800,000.00	0.78
Q	卫生和社会工作	60,584,243.30	1.32
R	文化、体育和娱乐业	13,929,204.24	0.30
S	综合	-	-
	合计	4,157,820,249.25	90.49

8.2.2 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	-	-
B	采矿业	15,909,540.00	0.35
C	制造业	176,552,083.21	3.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	5,448,029.34	0.12
F	批发和零售业	22,386.84	0.00
G	交通运输、仓储和	5,511,480.48	0.12

	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	13,378,524.18	0.29
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	45,710.34	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	15,811.84	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	4,481,323.92	0.10
S	综合	-	-
	合计	221,364,890.15	4.82

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

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

8.3.1 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	601888	中国中免	1,315,805	288,700,775.05	6.28
2	600519	贵州茅台	137,100	281,055,000.00	6.12
3	000100	TCL 科技	30,979,000	191,140,430.00	4.16
4	000895	双汇发展	5,486,009	173,083,583.95	3.77
5	601601	中国太保	6,248,639	169,463,089.68	3.69
6	600036	招商银行	3,348,870	163,123,457.70	3.55
7	601318	中国平安	3,228,863	162,766,983.83	3.54
8	600741	华域汽车	4,690,800	132,749,640.00	2.89
9	601009	南京银行	12,788,856	114,588,149.76	2.49
10	000858	五粮液	499,229	111,158,329.14	2.42
11	600690	海尔智家	3,588,000	107,245,320.00	2.33
12	601336	新华保险	2,438,880	94,823,654.40	2.06
13	000938	紫光股份	3,769,538	86,133,943.30	1.87
14	300124	汇川技术	1,228,200	84,254,520.00	1.83
15	603799	华友钴业	688,577	75,956,928.87	1.65

16	600309	万华化学	688,959	69,584,859.00	1.51
17	600161	天坛生物	2,310,700	66,917,872.00	1.46
18	002044	美年健康	7,717,738	60,584,243.30	1.32
19	000333	美的集团	709,491	52,367,530.71	1.14
20	601166	兴业银行	2,699,818	51,404,534.72	1.12
21	002821	凯莱英	117,126	50,949,810.00	1.11
22	601360	三六零	3,960,000	50,290,200.00	1.09
23	002555	三七互娱	1,888,182	49,968,677.64	1.09
24	601225	陕西煤业	3,888,007	47,433,685.40	1.03
25	000001	平安银行	2,788,800	45,959,424.00	1.00
26	000568	泸州老窖	176,800	44,884,216.00	0.98
27	300450	先导智能	555,716	41,328,598.92	0.90
28	001979	招商蛇口	2,929,883	39,084,639.22	0.85
29	600406	国电南瑞	958,016	38,349,380.48	0.83
30	002607	中公教育	5,000,000	35,800,000.00	0.78
31	601628	中国人寿	1,178,478	35,460,403.02	0.77
32	601899	紫金矿业	3,587,180	34,795,646.00	0.76
33	600276	恒瑞医药	673,119	34,133,864.49	0.74
34	601838	成都银行	2,758,900	33,106,800.00	0.72
35	002142	宁波银行	834,600	31,948,488.00	0.70
36	002352	顺丰控股	457,636	31,540,273.12	0.69
37	002938	鹏鼎控股	717,426	29,505,905.30	0.64
38	600760	中航沈飞	430,500	29,291,220.00	0.64
39	000069	华侨城 A	4,134,100	29,104,064.00	0.63
40	000651	格力电器	776,191	28,742,352.73	0.63
41	601088	中国神华	1,273,808	28,686,156.16	0.62
42	000063	中兴通讯	778,800	26,089,800.00	0.57
43	600436	片仔癀	58,813	25,710,102.95	0.56
44	601012	隆基股份	296,447	25,553,731.40	0.56
45	000338	潍柴动力	1,413,600	25,289,304.00	0.55
46	601985	中国核电	2,817,500	23,385,250.00	0.51
47	600196	复星医药	463,200	22,669,008.00	0.49
48	600048	保利发展	1,380,000	21,569,400.00	0.47
49	600585	海螺水泥	528,973	21,317,611.90	0.46
50	600019	宝钢股份	2,938,880	21,042,380.80	0.46
51	600016	民生银行	4,281,133	16,696,418.70	0.36
52	600584	长电科技	530,035	16,441,685.70	0.36
53	601816	京沪高铁	3,358,500	16,221,555.00	0.35
54	600893	航发动力	254,302	16,138,004.92	0.35
55	601668	中国建筑	3,167,100	15,835,500.00	0.34
56	600009	上海机场	338,800	15,818,572.00	0.34
57	600028	中国石化	3,710,085	15,693,659.55	0.34

58	600383	金地集团	1,198,883	15,549,512.51	0.34
59	002841	视源股份	188,823	15,370,192.20	0.33
60	600000	浦发银行	1,758,000	14,995,740.00	0.33
61	600660	福耀玻璃	316,300	14,910,382.00	0.32
62	601398	工商银行	3,188,820	14,764,236.60	0.32
63	000157	中联重科	2,037,616	14,609,706.72	0.32
64	601633	长城汽车	296,900	14,411,526.00	0.31
65	300413	芒果超媒	248,148	13,929,204.24	0.30
66	601607	上海医药	694,106	13,791,886.22	0.30
67	601877	正泰电器	252,100	13,585,669.00	0.30
68	601390	中国中铁	2,288,800	13,252,152.00	0.29
69	002050	三花智控	501,800	12,695,540.00	0.28
70	600795	国电电力	3,978,800	12,612,796.00	0.27
71	600745	闻泰科技	100,000	12,552,000.00	0.27
72	000768	中航西飞	336,400	12,278,600.00	0.27
73	601818	光大银行	3,688,800	12,246,816.00	0.27
74	002008	大族激光	215,771	11,651,634.00	0.25
75	002624	完美世界	569,600	11,568,576.00	0.25
76	601600	中国铝业	1,787,800	10,887,702.00	0.24
77	688036	传音控股	70,000	10,184,300.00	0.22
78	000538	云南白药	96,723	10,122,061.95	0.22
79	002241	歌尔股份	183,799	9,943,525.90	0.22
80	601229	上海银行	1,319,836	9,410,430.68	0.20
81	600352	浙江龙盛	708,000	8,942,040.00	0.19
82	601169	北京银行	1,998,800	8,874,672.00	0.19
83	601939	建设银行	1,488,800	8,724,368.00	0.19
84	002007	华兰生物	272,441	7,938,930.74	0.17
85	002601	龙佰集团	260,552	7,449,181.68	0.16
86	002594	比亚迪	27,448	7,359,357.76	0.16
87	002271	东方雨虹	136,150	7,172,382.00	0.16
88	600362	江西铜业	301,313	6,728,319.29	0.15
89	600085	同仁堂	148,700	6,688,526.00	0.15
90	601186	中国铁建	812,000	6,333,600.00	0.14
91	000725	京东方 A	1,146,870	5,791,693.50	0.13
92	601989	中国重工	1,318,200	5,562,804.00	0.12
93	603833	欧派家居	36,274	5,350,415.00	0.12
94	000425	徐工机械	886,000	5,307,140.00	0.12
95	600104	上汽集团	250,000	5,157,500.00	0.11
96	600655	豫园股份	486,668	5,012,680.40	0.11
97	601688	华泰证券	281,500	4,999,440.00	0.11
98	600030	中信证券	186,700	4,930,747.00	0.11
99	600886	国投电力	427,300	4,901,131.00	0.11

100	600926	杭州银行	373,200	4,784,424.00	0.10
101	601138	工业富联	398,404	4,748,975.68	0.10
102	002027	分众传媒	578,276	4,736,080.44	0.10
103	600989	宝丰能源	267,900	4,650,744.00	0.10
104	601021	春秋航空	80,487	4,571,661.60	0.10
105	002415	海康威视	80,000	4,185,600.00	0.09
106	600332	白云山	122,100	4,175,820.00	0.09
107	600025	华能水电	582,300	3,837,357.00	0.08
108	002252	上海莱士	515,500	3,515,710.00	0.08
109	601111	中国国航	373,900	3,413,707.00	0.07
110	002202	金风科技	200,000	3,294,000.00	0.07
111	000776	广发证券	132,300	3,253,257.00	0.07
112	603993	洛阳钼业	499,800	2,788,884.00	0.06
113	002179	中航光电	27,210	2,736,237.60	0.06
114	600900	长江电力	109,498	2,485,604.60	0.05
115	600111	北方稀土	49,600	2,271,680.00	0.05
116	300498	温氏股份	116,260	2,239,167.60	0.05
117	002001	新和成	70,000	2,178,400.00	0.05
118	601658	邮储银行	398,384	2,031,758.40	0.04
119	000963	华东医药	47,205	1,897,641.00	0.04
120	300760	迈瑞医疗	4,800	1,827,840.00	0.04
121	600588	用友网络	50,043	1,795,542.84	0.04
122	300122	智飞生物	14,000	1,744,400.00	0.04
123	600999	招商证券	96,242	1,698,671.30	0.04
124	601728	中国电信	394,011	1,682,426.97	0.04
125	601898	中煤能源	238,000	1,497,020.00	0.03
126	603259	药明康德	11,151	1,322,285.58	0.03
127	300408	三环集团	29,585	1,319,491.00	0.03
128	002236	大华股份	51,416	1,207,247.68	0.03
129	002024	苏宁易购	288,077	1,186,877.24	0.03
130	601669	中国电建	111,600	901,728.00	0.02
131	601933	永辉超市	200,762	813,086.10	0.02
132	600031	三一重工	29,241	666,694.80	0.01
133	600438	通威股份	9,039	406,393.44	0.01
134	601878	浙商证券	22,392	295,126.56	0.01
135	300676	华大基因	1,847	162,166.60	0.00
136	300433	蓝思科技	287	6,595.26	0.00
137	002916	深南电路	18	2,192.76	0.00

8.3.2 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	002773	康弘药业	3,188,000	64,875,800.00	1.41
2	600195	中牧股份	1,978,000	25,852,460.00	0.56
3	300507	苏奥传感	1,246,537	16,342,100.07	0.36
4	002728	特一药业	915,751	14,523,810.86	0.32
5	000983	山西焦煤	1,188,000	9,824,760.00	0.21
6	002947	恒铭达	248,756	8,766,161.44	0.19
7	002915	中欣氟材	293,255	7,947,210.50	0.17
8	002452	长高集团	808,511	7,260,428.78	0.16
9	300292	吴通控股	1,687,285	6,732,267.15	0.15
10	600152	维科技术	815,660	6,557,906.40	0.14
11	603496	恒为科技	417,014	6,276,060.70	0.14
12	601699	潞安环能	538,000	6,084,780.00	0.13
13	300383	光环新网	424,088	5,962,677.28	0.13
14	002627	三峡旅游	1,043,841	5,511,480.48	0.12
15	300506	名家汇	793,651	5,436,509.35	0.12
16	600487	亨通光电	318,587	4,817,035.44	0.10
17	002792	通宇通讯	300,632	4,608,688.56	0.10
18	002739	万达电影	288,400	4,464,432.00	0.10
19	603042	华脉科技	292,969	3,793,948.55	0.08
20	688187	时代电气	33,865	2,595,752.25	0.06
21	300293	蓝英装备	68,906	837,207.90	0.02
22	600718	东软集团	47,475	643,761.00	0.01
23	688772	珠海冠宇	12,960	506,606.40	0.01
24	688190	云路股份	3,026	279,935.26	0.01
25	301155	海力风电	1,054	101,974.50	0.00
26	688511	天微电子	1,490	81,234.80	0.00
27	688255	凯尔达	1,648	62,409.76	0.00
28	301050	雷电微力	233	54,694.42	0.00
29	301029	怡合达	462	41,519.94	0.00
30	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.00
31	301221	光庭信息	280	24,841.60	0.00
32	603607	京华激光	1,439	23,311.80	0.00
33	002899	英派斯	1,408	21,669.12	0.00
34	301096	百诚医药	272	21,360.16	0.00
35	301093	华兰股份	409	20,388.65	0.00
36	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.00
37	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
38	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
39	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
40	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
41	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
42	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.00

43	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
44	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
45	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
46	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
47	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
48	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
49	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
50	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
51	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
52	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
53	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
54	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
55	301052	果麦文化	252	8,477.28	0.00
56	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
57	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
58	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
59	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
60	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
61	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
62	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
63	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
64	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
65	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
66	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
67	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
68	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
69	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
70	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
71	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
72	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
73	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
74	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
75	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
76	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
77	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
78	301079	邵阳液压	140	3,474.80	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	600161	天坛生物	64,999,991.00	1.17
2	002607	中公教育	48,733,000.00	0.87

3	601360	三六零	48,037,800.00	0.86
4	002044	美年健康	43,404,642.45	0.78
5	603799	华友钴业	38,000,004.00	0.68
6	601601	中国太保	28,442,405.91	0.51
7	002938	鹏鼎控股	24,662,840.00	0.44
8	002558	巨人网络	23,339,700.00	0.42
9	300123	亚光科技	22,470,424.00	0.40
10	600016	民生银行	21,046,937.69	0.38
11	600741	华域汽车	19,425,371.51	0.35
12	000895	双汇发展	17,329,055.74	0.31
13	601012	隆基股份	16,677,500.13	0.30
14	000723	美锦能源	15,799,996.80	0.28
15	601816	京沪高铁	15,647,685.00	0.28
16	600584	长电科技	14,999,990.50	0.27
17	600519	贵州茅台	13,429,032.00	0.24
18	601318	中国平安	13,331,648.00	0.24
19	002841	视源股份	13,312,821.67	0.24
20	002555	三七互娱	12,893,000.00	0.23

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002558	巨人网络	75,063,836.05	1.35
2	002739	万达电影	71,378,638.64	1.28
3	000723	美锦能源	39,565,110.12	0.71
4	600690	海尔智家	37,444,159.73	0.67
5	603799	华友钴业	33,280,421.46	0.60
6	601166	兴业银行	32,077,976.00	0.58
7	601398	工商银行	31,747,500.00	0.57
8	600487	亨通光电	29,708,071.05	0.53
9	601318	中国平安	28,923,322.00	0.52
10	300123	亚光科技	27,511,913.00	0.49
11	000895	双汇发展	27,316,385.05	0.49
12	601601	中国太保	27,162,995.24	0.49
13	600900	长江电力	25,103,989.94	0.45
14	601997	贵阳银行	24,532,751.55	0.44
15	601888	中国中免	22,706,848.22	0.41
16	600195	中牧股份	22,128,407.85	0.40
17	601012	隆基股份	22,065,872.24	0.40
18	000063	中兴通讯	20,452,059.00	0.37
19	600104	上汽集团	20,076,908.00	0.36

20	601169	北京银行	19,949,606.00	0.36
----	--------	------	---------------	------

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	838,332,171.09
卖出股票收入（成交）总额	1,407,546,419.27

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	104,030,755.40	2.26
2	央行票据	-	-
3	金融债券	130,310,000.00	2.84
	其中：政策性金融债	130,310,000.00	2.84
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）	198,672,957.44	4.32
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	433,013,712.84	9.42

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	200312	20 进出 12	500,000	50,175,000.00	1.09
2	132018	G 三峡 EB1	318,880	44,611,312.00	0.97
3	113050	南银转债	272,230	32,210,253.60	0.70
4	102101	国债 2101	300,000	30,006,000.00	0.65
5	200002	20 付息国债 02	300,000	30,003,000.00	0.65

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 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，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。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	103,630.16
2	应收证券清算款	15,327,355.12
3	应收股利	-
4	应收利息	4,585,385.93
5	应收申购款	6,601,872.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,618,243.61

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	132018	G 三峡 EB1	44,611,312.00	0.97
2	113050	南银转债	32,210,253.60	0.70
3	132020	19 蓝星 EB	25,112,809.80	0.55
4	110059	浦发转债	21,390,955.50	0.47
5	132014	18 中化 EB	19,188,471.20	0.42
6	132015	18 中油 EB	13,217,817.40	0.29
7	110061	川投转债	9,498,195.00	0.21
8	113044	大秦转债	6,304,838.40	0.14
9	113042	上银转债	5,565,648.90	0.12
10	110079	杭银转债	2,362,523.80	0.05
11	110045	海澜转债	2,339,600.00	0.05
12	113026	核能转债	2,306,648.80	0.05
13	113021	中信转债	1,665,144.60	0.04
14	110062	烽火转债	1,380,822.50	0.03
15	132021	19 中电 EB	1,252,410.00	0.03
16	110053	苏银转债	1,246,330.80	0.03
17	113011	光大转债	1,170,609.00	0.03
18	127012	招路转债	993,483.00	0.02
19	128022	众信转债	922,880.00	0.02
20	123107	温氏转债	917,324.08	0.02
21	127005	长证转债	791,058.00	0.02
22	110057	现代转债	592,290.90	0.01
23	127015	希望转债	570,818.25	0.01
24	127020	中金转债	456,651.20	0.01
25	128081	海亮转债	302,636.60	0.01
26	127006	敖东转债	300,286.71	0.01
27	113024	核建转债	259,675.10	0.01
28	110056	亨通转债	239,119.10	0.01
29	110060	天路转债	221,408.00	0.00
30	110052	贵广转债	192,080.00	0.00
31	128075	远东转债	168,064.00	0.00
32	127013	创维转债	157,313.00	0.00
33	113530	大丰转债	139,136.40	0.00
34	123023	迪森转债	133,028.80	0.00
35	127011	中鼎转 2	106,220.00	0.00
36	128100	搜特转债	92,923.00	0.00
37	113594	淳中转债	4,102.20	0.00
38	110043	无锡转债	3,593.10	0.00
39	110038	济川转债	1,418.50	0.00

40	113505	杭电转债	1,244.60	0.00
----	--------	------	----------	------

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 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。

8.12.5.2 期末积极投资前五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	300507	苏奥传感	16,342,100.07	0.36	非公开发行流通受限
2	002728	特一药业	14,523,810.86	0.32	非公开发行流通受限

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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 (%)
兴全沪深 300 指数 (LOF)A	605,212	2,867.84	210,512,137.41	12.13	1,525,139,721.62	87.87
兴全沪深 300 指数 C	30,311	1,911.55	1,256,436.10	2.17	56,684,645.95	97.83
合计	635,523	2,822.23	211,768,573.51	11.81	1,581,824,367.57	88.19

9.2 期末上市基金前十名持有人

兴全沪深 300 指数 (LOF) A

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	钱春香	1,305,501.00	3.58
2	陈周阳	1,023,000.00	2.80
3	浙江德源智能科技股份有限公司	914,447.00	2.51

4	高怀之	787,165.00	2.16
5	钟贵洋	581,528.00	1.59
6	吴林萍	412,429.00	1.13
7	李广涛	405,975.00	1.11
8	王义华	400,000.00	1.10
9	王磊	391,459.00	1.07
10	查晟	339,070.00	0.93

注：无。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	兴全沪深 300 指数 (LOF) A	3,932,971.66	0.2266
	兴全沪深 300 指数 C	24,428.17	0.0422
	合计	3,957,399.83	0.2206

注：“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；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总数）。

9.4 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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	兴全沪深 300 指数 (LOF) A	0~10
	兴全沪深 300 指数 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	兴全沪深 300 指数 (LOF) A	>100
	兴全沪深 300 指数 C	0
	合计	>100

§ 10 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
基金合同生效日 (2010 年 11 月 2 日) 基金份额总额	2,955,476,122.49	-
本报告期期初基金份额总额	1,992,371,296.24	46,263,655.61

本报告期基金总申购份额	1, 195, 623, 440. 85	99, 567, 898. 03
减：本报告期基金总赎回份额	1, 452, 342, 878. 06	87, 890, 471. 59
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	1, 735, 651, 859. 03	57, 941, 082. 05

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) 报告期内基金管理人无重大人事变动。

(2) 2021 年 5 月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁；2021 年 8 月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部副总裁。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自 2015 年起连续 7 年聘请德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。本年度应支付给所聘任的会计师事务所 5.6 万元人民币。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	-----	------	-----------	----

	元数量	成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
兴业证券	3	1,906,711,411.79	100.00%	1,395,946.85	100.00%	新增 1 个

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
兴业证券	141,284,366.84	100.00%	17,266,948,000.00	100.00%	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) C 份额暂停接受五十万元以上申购、转换转入申请的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-01-04
2	关于旗下部分基金投资兄弟科技 (002562) 非公开发行股票的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-01-07
3	关于旗下部分基金投资盛洋科技 (603703) 非公开发行股票的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-01-07
4	关于旗下部分基金投资三六零 (601360) 非公开发行股票的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-01-08
5	关于旗下部分基金投资一汽夏利 (000927) 非公开发行股票的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-01-09
6	关于旗下部分基金投资美锦能源 (000723) 非公开发行股票的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-02-01
7	关于旗下部分基金投资范围增加存托凭证并修改基金合同和托管协议的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-02-09
8	关于调整旗下基金在湘财证券费率优惠活动的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-02-10
9	关于旗下部分基金投资华友钴业 (603799) 非公开发行股票的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-02-20
10	关于旗下部分基金投资四维图新 (002405) 非公开发行股票的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-02-25

11	关于兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) A 份额暂停接受大额申购、转换转入、定期定额投资申请的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-02-26
12	关于旗下部分基金投资双杰电气 (300444) 非公开发行股票的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-03-02
13	关于增加中原证券为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-03-05
14	关于调整网上直销招行直连借记卡基金转换优惠费率的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-03-19
15	关于旗下部分基金投资金证股份 (600446) 非公开发行股票的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-03-31
16	关于旗下部分基金投资美康生物 (300439) 非公开发行股票的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-03-31
17	关于旗下部分基金修改基金合同的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-03-31
18	关于增加阳光人寿为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-04-01
19	关于旗下部分基金投资银宝山新 (002786) 非公开发行股票的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-04-15
20	增加上海大智慧为旗下部分基金销售机构公告	证券时报及规定互联网网站	2021-04-21
21	关于旗下部分基金投资天坛生物 (600161) 非公开发行股票的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-04-28
22	关于旗下部分基金投资古越龙山 (600059) 非公开发行股票的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-04-30
23	关于旗下部分基金投资长电科技 (600584) 非公开发行股票的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-05-06
24	关于旗下部分基金投资惠伦晶体 (300460) 非公开发行股票的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-05-11
25	关于旗下部分基金投资吴通控股 (300292) 非公开发行股票的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-05-26
26	关于旗下部分基金投资彩讯股份 (300634) 非公开发行股票的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-06-12
27	关于增加北京新浪仓石基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-06-16
28	关于增加泛华普益基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-06-17
29	关于调整网上直销基金转换、赎回转购、汇款交易优惠费率的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-06-18
30	关于调整旗下基金在交通银行股份有限公司费率优惠活动的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-07-01
31	关于旗下部分基金投资宜昌交运 (002627) 非公开发行股票的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-07-21

32	关于旗下部分基金投资华脉科技(603042)非公开发行股票的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-07-23
33	关于调整旗下部分基金在长江证券最低定期定额投资金额的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-07-23
34	关于旗下部分基金投资维科技术(600152)非公开发行股票的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-07-28
35	关于放开我司转换补差费折扣及开展网上直销平台基金转换补差费率优惠活动的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-08-04
36	关于旗下部分基金投资苏奥传感(300507)非公开发行股票的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-08-06
37	关于兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) A 份额暂停接受八百万元以上申购(含定投)、转换转入申请的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-08-09
38	关于旗下部分基金投资芒果超媒(300413)非公开发行股票的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-08-21
39	关于旗下深交所基金新增扩位简称的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-08-21
40	关于旗下部分基金投资中欣氟材(002915)非公开发行股票的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-08-24
41	关于旗下部分基金投资恒为科技(603496)非公开发行股票的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-08-27
42	关于调整旗下部分基金在工商银行定期定额投资费率优惠活动的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-08-30
43	关于旗下部分基金投资长高集团(002452)非公开发行股票的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-09-08
44	关于旗下部分基金投资恒铭达(002947)非公开发行股票的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-09-09
45	关于调整旗下基金在山西证券股份有限公司费率优惠活动的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-09-13
46	关于旗下部分基金投资蓝英装备(300293)非公开发行股票的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-11-18
47	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	证券时报及规定互联网网站	2021-11-24
48	关于旗下所有采取后端收费模式的基金份额暂停通过网上直销系统办理部分业务的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-11-26
49	关于旗下部分基金投资特一药业(002728)非公开发行股票的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-12-01
50	关于旗下部分基金投资通宇通讯(002792)非公开发行股票的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-12-09
51	关于调整网上直销基金转换、赎回转	证券时报及规定互联网	2021-12-10

	购、汇款交易优惠费率的公告	网站	
52	关于增加申万宏源西部证券为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-12-13
53	关于增加国泰君安证券为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-12-15
54	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	证券时报及规定互联网网站	2021-12-24
55	关于旗下部分基金投资名家汇(300506)非公开发行股票的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-12-30
56	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	证券时报及规定互联网网站	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

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。

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；
- 6、基金托管人业务资格批件、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