

# 兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF） 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：兴证全球基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 其他指标 .....	8
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	12
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	12
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 .....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表 .....	13
6.2 利润表 .....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	16
6.4 报表附注 .....	19
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	48
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	48
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	48

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	48
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	49
7.12 投资组合报告附注 .....	49
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>50</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	50
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	50
8.4 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 .....	50
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>51</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>51</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	51
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	51
10.4 基金投资策略的改变 .....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	51
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	52
10.8 其他重大事件 .....	54
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>54</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	55
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>55</b>
12.1 备查文件目录 .....	55
12.2 存放地点 .....	55
12.3 查阅方式 .....	55

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）
基金简称	兴全趋势投资混合（LOF）
场内简称	兴全趋势
基金主代码	163402
前端交易代码	163402
后端交易代码	163403
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2005 年 11 月 3 日
基金管理人	兴证全球基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	32,268,225,783.28 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	2006 年 1 月 19 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金旨在把握投资对象中长期可测的确定收益，增加投资组合收益的确定性和稳定性；分享中国上市公司高速增长带来的资本增值；减少决策的失误率，实现最优化的风险调整后的投资收益。
投资策略	根据对股市趋势分析的结论实施灵活的大类资产配置；运用兴全多维趋势分析系统，对公司成长趋势、行业景气趋势和价格趋势进行分析，并运用估值把关来精选个股。在固定收益类证券投资方面，本基金主要运用“兴全固定收益证券组合优化模型”，在固定收益资产组合久期控制的条件下追求最高的投资收益率。
业绩比较基准	沪深 300 指数×50%+中证国债指数×45%+同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金在混合型基金大类中属于强调控制风险，中高风险，中高回报的基金产品。投资者可在二级市场买卖基金份额，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。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		兴证全球基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨卫东	李真
	联系电话	021-20398888	021-52629999-212051
	电子邮箱	yangwd@xqfunds.com	tgb_lizhen@cib.com.cn
客户服务电话		4006780099, 021-38824536	95561
传真		021-20398858	021-62159217
注册地址		上海市黄浦区金陵东路 368 号	福建省福州市台江区江滨中大

办公地址	上海市浦东新区芳甸路 1155 号嘉里城办公楼 28-29 楼	道 398 号兴业银行大厦 上海市银城路 167 号兴业大厦 4 楼
邮政编码	201204	200120
法定代表人	杨华辉	吕家进

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-956,557,223.35
本期利润	-5,210,267,957.38
加权平均基金份额本期利润	-0.1548
本期加权平均净值利润率	-21.11%
本期基金份额净值增长率	-17.29%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	2,967,852,846.49
期末可供分配基金份额利润	0.0920
期末基金资产净值	23,415,233,922.57
期末基金份额净值	0.7256
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	2,087.85%

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

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：开放式基金的申购赎

回费、红利再投资费、基金转换费等)，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率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
过去一个月	6.35%	1.06%	4.70%	0.53%	1.65%	0.53%
过去三个月	0.90%	1.47%	3.65%	0.71%	-2.75%	0.76%
过去六个月	-17.29%	1.49%	-3.75%	0.73%	-13.54%	0.76%
过去一年	-13.98%	1.22%	-4.70%	0.62%	-9.28%	0.60%
过去三年	41.92%	1.16%	16.54%	0.63%	25.38%	0.53%
自基金合同生效起至今	2,087.85%	1.21%	248.49%	0.83%	1,839.36%	0.38%

注：本基金业绩比较基准为沪深 300 指数×50%+中证国债指数×45%+同业存款利率×5%，业绩比较基准的选取上主要基于如下考虑：本基金采用沪深 300 指数作为股票投资部分的业绩比较基准主要是因为沪深 300 指数选取了 A 股市场上规模最大、流动性最好的 300 只股票作为其成份股，对沪深市场的覆盖度高，具有良好的市场代表性。中证国债指数是一个全面反映国债市场（包括银行间、上交所、深交所）的综合性指数，也是债券品种中比较基准的参考。基于本基金的股票、债券和现金比例，选用该业绩比较基准能够忠实反映本基金的风险收益特征。

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：

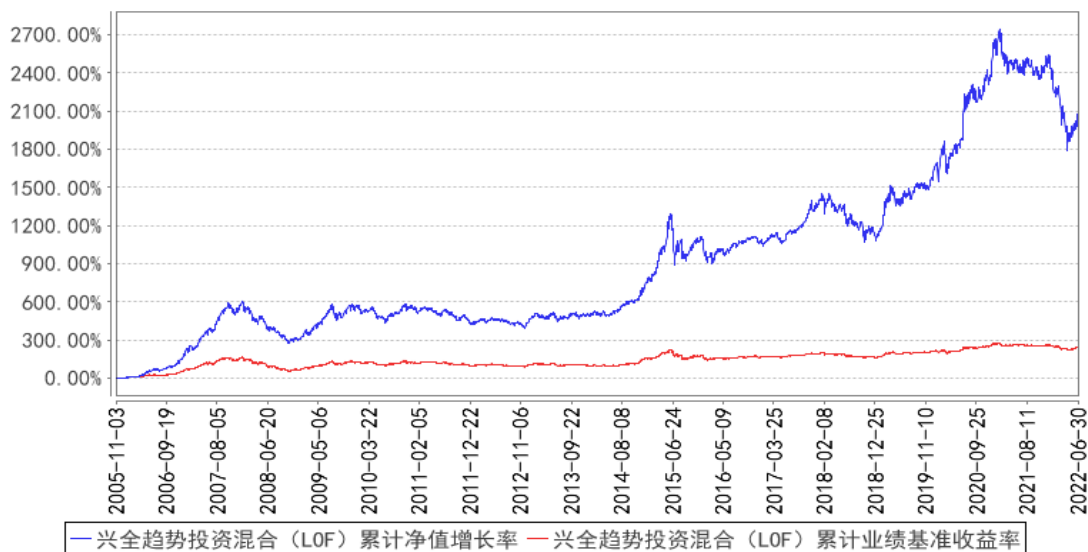
$$\text{Return}_t = 50\% \times (\text{沪深 300 指数}_t / \text{中证国债指数}_{t-1} - 1) + 45\% \times (\text{沪深 300 指数}_t / \text{中证国债指数}_{t-1} - 1) + 5\% \times (\text{同业存款利率}_t / 360)$$

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

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

### 3.2.2 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

兴全趋势投资混合（LOF）累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、净值表现所取数据截至到 2022 年 06 月 30 日。

2、按照《兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金合同》的规定，本基金建仓期为 2005 年 11 月 03 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。

### 3.3 其他指标

注：无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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



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

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
童兰	兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理	2020 年 7 月 2 日	-	14 年	硕士，历任国信证券股份有限公司湖北分公司投资顾问，长江证券股份有限公司研究员，国泰君安证券股份有限公司研究员，兴证全球基金管理有限公司研究员、研究组长。
董理	研究部副总监、兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理	2021 年 10 月 20 日	-	14 年	博士，历任国信智能有限公司技术部系统工程师，嘉实基金管理有限公司分析师、基金经理，华夏久盈资产管理有限公司投资经理，兴证全球基金管理有限公司兴全社会责任混合型证券投资基金基金经理、兴全多维价值混合型证券投资基金基金经理。
谢治宇	副总经理兼基金管理部投资总监、研究部总监、兴全合润混合型证券投资基金基金经理、兴全合宜灵活配置混合型证	2021 年 10 月 20 日	-	15 年	硕士，历任兴证全球基金管理有限公司研究部研究员，专户投资部投资经理，基金管理部基金经理、基金管理部投资副总监兼基金经理、基金管理部投资总监兼基金经理、公司总经理助理兼基金管理部投资总监、兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理。

券投资基金（LOF）基金经理、兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金基金经理、兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理				
--	--	--	--	--

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

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

3、证券从业的涵义遵从行业的相关规定，包括资管相关行业从业经历。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本报告期末，本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划的投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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、《兴全趋势投资混合型证券投资基金（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 公平交易制度的执行情况

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

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年市场在海外战争和疫情的连续黑天鹅打击下，资本市场的风险偏好快速降低，导致了市场的深度回调。组合年初以来继续了之前的调整策略，将一些未来压力较大的行业和个股进行了减持，新买入了一些行业成长性更好的品种。尽管有黑天鹅的扰动，我们依然维持年初对市场的判断，相对宽松的流动性对股票市场依然会形成足够有力的支撑，其实上半年流动性就已经明显得到了释放，只是受制于实体经济的疲弱和疫情，资金堆积在银行体系无法流入实体，这个问题终将解决。基于对市场的信心，我们没有在仓位上做重大调整，正如年初所说，我们认为结构才是问题的核心。因此上半年的工作更多在寻找优质的行业和个股上，也做了相应的持仓调整。

本产品会坚持聚焦于符合市场发展方向，在中长期维度上具有良好变化趋势的行业和个股。个股选择上减持对风险控制的高标准，期望在中长期贡献合理的稳健回报。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.7256 元；本报告期基金份额净值增长率为-17.29%，业绩比较基准收益率为-3.75%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年，实体的疲弱和流动性的宽松依然是最重要的宏观背景，在这个背景下，我们看好两类投资机会。

一类是对实体经济复苏卡脖子的核心矛盾必须得到解决，其中最典型的莫过于房地产。房住不炒与房地产企业健康发展并不矛盾，靠合理房价地价差卖新房赚钱的优秀龙头地产公司，在未来会面临极好的竞争格局和良好的融资环境。此外市场对于房地产销售面积有片面担忧，而忽视了房地产销售金额在消费支出的比例刚性，也低估了集中度的大幅提升带来的 ROE 提升，这些都是目前错误定价的来源。

第二类是符合经济发展方向，技术变革或者产业变革推动的从 0 到 1 或者从 1 到 N 早期的投资机会。这类投资机会的特质在于他们会充分受益于新方向带来的估值弹性，对于流动性宽松的市场具有明显的资金吸引力。同时老业务尽管受到经济整体不景气的压力，但是因为不是股价的核心矛盾而降低了不利影响。

同时，下半年我们会积极关注那些商业模式优秀的行业，尽管阶段性仍未进入合理的价格区间，但是随着经济压力的增大，可能会带来买入的机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金合同》及其他相关法律法规的规定，本报告期内未进行利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金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 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在

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

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,565,365,335.77	4,334,602,109.82
结算备付金		15,024,144.51	43,432,255.99
存出保证金		4,679,353.24	2,538,965.43
交易性金融资产	6.4.7.2	21,742,405,091.00	25,588,768,313.09
其中：股票投资		20,725,165,932.26	25,588,768,313.09
基金投资		-	-
债券投资		1,017,239,158.74	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		165,330,794.26	21,612,892.26
应收股利		-	-
应收申购款		12,848,168.73	26,688,171.72
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.8	-	483,027.49
资产总计		23,505,652,887.51	30,018,125,735.80
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年6月30日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	14,415,342.18
应付赎回款		45,986,985.93	55,113,049.49
应付管理人报酬		28,067,224.35	39,299,998.83
应付托管费		4,677,870.72	6,549,999.79
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		14.78	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	11,686,869.16	22,543,281.45
负债合计		90,418,964.94	137,921,671.74
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.10	8,079,217,796.55	8,527,364,421.53
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	15,336,016,126.02	21,352,839,642.53
净资产合计		23,415,233,922.57	29,880,204,064.06
负债和净资产总计		23,505,652,887.51	30,018,125,735.80

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.7256 元，基金份额总额 32,268,225,783.28 份。以上比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号（年度报告和中期报告）》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年度末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年度末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 6.2 利润表

会计主体：兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

<b>一、营业总收入</b>		-4,995,259,540.96	-53,910,268.70
1. 利息收入		4,518,163.78	22,205,822.60
其中：存款利息收入	6.4.7.13	4,518,163.78	22,186,729.99
债券利息收入		-	1,801.73
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	17,290.88
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-749,564,167.66	4,143,708,253.69
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-880,493,406.82	4,028,306,745.20
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	4,579,390.38	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	126,349,848.78	115,401,508.49
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-4,253,710,734.03	-4,242,085,774.39
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	3,497,196.95	22,261,429.40
<b>减：二、营业总支出</b>		215,008,416.42	370,957,064.83
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	184,182,362.67	293,588,179.65
2. 托管费	6.4.10.2.2	30,697,060.50	48,931,363.25
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费	6.4.10.2.1.1	-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		3.24	6.30
8. 其他费用	6.4.7.23	128,990.01	28,437,515.63
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-5,210,267,957.38	-424,867,333.53
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-5,210,267,957.38	-424,867,333.53
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-5,210,267,957.38	-424,867,333.53

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

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	8,527,364,421.53	-	21,352,839,642.53	29,880,204,064.06
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	8,527,364,421.53	-	21,352,839,642.53	29,880,204,064.06
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-448,146,624.98	-	-6,016,823,516.51	-6,464,970,141.49
（一）、综合收益总额	-	-	-5,210,267,957.38	-5,210,267,957.38
（二）、本期基	-448,146,624.98	-	-806,555,559.13	-1,254,702,184.11



基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）				
其中：1. 基金申购款	857,716,111.63	-	1,693,759,095.50	2,551,475,207.13
2. 基金赎回款	-1,305,862,736.61	-	-2,500,314,654.63	-3,806,177,391.24
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	8,079,217,796.55	-	15,336,016,126.02	23,415,233,922.57
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	8,818,746,369.49	-	26,435,728,593.81	35,254,474,963.30
加：会计政策变	-	-	-	-

更				
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产(基金净值)	8,818,746,369.49	-	26,435,728,593.81	35,254,474,963.30
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	816,133,024.00	-	2,348,375,059.51	3,164,508,083.51
(一)、综合收益总额	-	-	-424,867,333.53	-424,867,333.53
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	816,133,024.00	-	2,773,242,393.04	3,589,375,417.04
其中:1.基金申购款	5,072,109,072.62	-	16,140,438,829.14	21,212,547,901.76
2.基金赎回款	-4,255,976,048.62	-	-13,367,196,436.10	-17,623,172,484.72
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少)	-	-	-	-

以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	9,634,879,393.49	-	28,784,103,653.32	38,418,983,046.81

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>杨华辉</u>	<u>庄园芳</u>	<u>詹鸿飞</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

兴全趋势投资混合型证券投资基金(LOF)(原名“兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)”) (以下简称“本基金”), 经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于同意兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)募集的批复》(证监许可[2005]156号文)的核准, 由兴证全球基金管理有限公司(原名“兴业全球基金管理有限公司”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法规和《兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)基金合同》发售, 基金合同于 2005 年 11 月 3 日生效。本基金为契约型上市开放式, 存续期限不定, 首次设立募集规模为 927,645,098.72 份基金份额。本基金的基金管理人为兴证全球基金管理有限公司, 注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司, 基金托管人为兴业银行股份有限公司。本基金于 2011 年 1 月 1 日起更名为“兴全趋势投资混合型证券投资基金(LOF)”。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《兴全趋势投资混合型证券投资基金(LOF)基金合同》和《兴全趋势投资混合型证券投资基金(LOF)招募说明书(更新)》的有关规定, 本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市交易的股票和固定收益证券(包括各种债券和货币市场工具)及中国证监会规定的其他证券品种和法律法规允许的金融工具。在正常市场情况下, 本基金投资组合的比例范围为: 固定收益类证券的投资比重为 0—65%, 股票的投资比重为 30%—95%; 现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于 5%, 其中, 现金不包括结算备付金、存出保证金、

应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数×50%+中证国债指数×45%+同业存款利率×5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日的财务状况、2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值净资产变动情况。

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

除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外,本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金自 2022 年度起执行了财政部发布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量(修订)》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移(修订)》、《企业会计准则第 24 号——套期会计(修订)》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报(修订)》(统称“新金融工具准则”)和 2022 年中国证监会发布的修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》。

##### (a) 新金融工具准则

根据财政部发布的新金融工具准则相关衔接规定,以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,本基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

新金融工具准则修订了财政部于 2006 年颁布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》和《企业会计准则第 24 号——套期保值》以及财政部于 2014 年修订的《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(统称“原金融工具准则”)。

新金融工具准则将金融资产划分为三个基本分类:(1)以摊余成本计量的金融资产;(2)以

公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产；及（3）以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在新金融工具准则下，金融资产的分类是基于本基金管理金融资产的商业模式及该资产的合同现金流量特征而确定。新金融工具准则取消了原金融工具准则中规定的持有至到期投资、贷款和应收款项及可供出售金融资产三个分类类别。根据新金融工具准则，嵌入衍生工具不再从金融资产的主合同中分拆出来，而是将混合金融工具整体适用关于金融资产分类的相关规定。

新金融工具准则以“预期信用损失”模型替代了原金融工具准则中的“已发生损失”模型。“预期信用损失”模型要求持续评估金融资产的信用风险，因此在新金融工具准则下，本基金信用损失的确认时点早于原金融工具准则。

本基金按照新金融工具准则的衔接规定，对新金融工具准则施行日（即 2022 年 1 月 1 日）未终止确认的金融工具的分类和计量（含减值）进行追溯调整。本基金未调整比较财务报表数据，将金融工具的原账面价值和在新金融工具准则施行日的新账面价值之间的差额计入 2022 年年初留存收益或其他综合收益。

执行新金融工具准则对 2022 年 1 月 1 日本基金资产负债表各项目的的影响汇总如下：

(i) 金融工具的分类影响

以摊余成本计量的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收申购款，对应的账面价值分别为人民币 4,334,602,109.82 元、43,432,255.99 元、2,538,965.43 元、483,027.49 元和 26,688,171.72 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金和应收申购款，对应的账面价值分别为人民币 4,335,064,176.36 元、43,451,800.49 元、2,540,107.93 元和 26,688,445.67 元。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币 25,588,768,313.09 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币 25,588,768,313.09 元。

以摊余成本计量的金融负债

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为应付交易费

用和其他负债，对应的账面价值分别为人民币 22,149,222.85 元和 394,058.60 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为其他负债，对应的账面价值为人民币 22,543,281.45 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等对应的应计利息余额均列示在应收利息或应付利息科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则，将上述应计利息分别转入银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》

本基金根据修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》编制财务报表时，调整了部分财务报表科目的列报和披露，未对财务报表列报和披露产生重大影响。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号）、财税 [2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56 号《关于资管产品增值

税有关问题的通知》、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，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所

得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，其股息红利所得暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。

(e) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	1,565,365,335.77
等于：本金	1,565,225,530.20
加：应计利息	139,805.57
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	1,565,365,335.77

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	21,684,660,953.31	-	20,725,165,932.26	-959,495,021.05
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债	5,765,000.00	895.34	6,662,172.44	896,277.10



券	市场				
	银行间 市场	999,800,000.00	9,676,986.30	1,010,576,986.30	1,100,000.00
	合计	1,005,565,000.00	9,677,881.64	1,017,239,158.74	1,996,277.10
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		22,690,225,953.31	9,677,881.64	21,742,405,091.00	-957,498,743.95

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末各项买入返售金融资产余额为零。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未通过买断式逆回购交易取得债券。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本报告期内本基金无债权投资。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本报告期内本基金未发生债权投资减值准备。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

## 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

## 6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	117,207.55
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	11,460,565.67
其中：交易所市场	11,458,265.67
银行间市场	2,300.00
应付利息	-
预提信息披露费	59,507.37
预提审计费用	49,588.57
合计	11,686,869.16

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	34,058,134,533.87	8,527,364,421.53
本期申购	3,425,706,296.76	857,716,111.63
本期赎回（以“-”号填列）	-5,215,615,047.35	-1,305,862,736.61
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	32,268,225,783.28	8,079,217,796.55
-----	-------------------	------------------

注：申购含红利再投资、转入转换份额，赎回含转换转出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	4,111,752,986.14	17,241,086,656.39	21,352,839,642.53
本期利润	-956,557,223.35	-4,253,710,734.03	-5,210,267,957.38
本期基金份额交易产生的变动数	-187,342,916.30	-619,212,642.83	-806,555,559.13
其中：基金申购款	391,166,003.97	1,302,593,091.53	1,693,759,095.50
基金赎回款	-578,508,920.27	-1,921,805,734.36	-2,500,314,654.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,967,852,846.49	12,368,163,279.53	15,336,016,126.02

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	4,256,856.59
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	218,575.38
其他	42,731.81
合计	4,518,163.78

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-880,493,406.82
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	-880,493,406.82

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	17,562,051,658.57
减：卖出股票成本总额	18,395,897,112.70
减：交易费用	46,647,952.69
买卖股票差价收入	-880,493,406.82

#### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	4,581,690.38
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-2,300.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	4,579,390.38

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-
减：应计利息总额	-
减：交易费用	2,300.00
买卖债券差价收入	-2,300.00

##### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

##### 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

##### 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

##### 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

##### 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

##### 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内未进行衍生工具买卖交易。

##### 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	126,349,848.78
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	126,349,848.78

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-4,253,710,734.03
股票投资	-4,255,707,011.13
债券投资	1,996,277.10
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	-4,253,710,734.03

## 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	3,435,736.44
基金转换费收入	61,460.51
合计	3,497,196.95

## 6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

## 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	49,588.57

信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	1,294.07
账户维护费	18,600.00
合计	128,990.01

#### 6.4.7.24 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

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

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
兴业证券	5,972,965,295.44	16.90	2,794,838,399.90	14.42

### 6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内均未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
兴业证券	4,368,033.81	16.76	1,099,230.84	9.59
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
兴业证券	2,044,114.50	13.49	481,376.17	15.11

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

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	184,182,362.67	293,588,179.65
其中：支付销售机构的客户维护费	50,096,125.49	72,243,997.90

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%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×1.5%/当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元



项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	30,697,060.50	48,931,363.25

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 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×0.25%/当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2005 年 11 月 3 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	18,285,073.15	15,455,219.13
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	18,285,073.15	15,455,219.13
报告期末持有的基金份额	0.0567%	0.0402%

占基金总份额比例		
----------	--	--

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

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

#### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)
兴业证券	2,000,000.00	0.0062	2,000,000.00	0.0059

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	1,565,365,335.77	4,256,856.59	14,197,322,860.73	22,008,580.90

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本报告期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。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。

#### 6.4.12 期末(2022年6月30日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300682	朗新科技	2022年2月24日	6个月	大宗交易购入流通受限	30.55	24.18	2,000,000	61,100,000.00	48,360,000.00	-
300769	德	2022	6个月	大宗	246.95	372.35	320,000	79,024,000.00	119,152,000.00	-

	方 纳 米	年 5 月 17 日		交易 购入 流通 受限							
600938	中 国 海 油	2022 年 4 月 14 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	10.80	15.86	84,004	907,243.20	1,332,303.44	-	
603666	亿 嘉 和	2022 年 1 月 19 日	6 个月	大 宗 交 易 购 入 流 通 受 限	71.44	66.49	141,000	10,073,040.00	9,375,090.00	-	
603666	亿 嘉 和	2022 年 1 月 20 日	6 个月	大 宗 交 易 购 入 流 通 受 限	69.10	66.43	2,067,300	142,850,430.00	137,330,739.00	-	
688220	翱 捷 科 技	2022 年 1 月 6 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	164.54	68.59	12,371	2,035,524.34	848,526.89	-	
688400	凌 云 光	2022 年 6 月 27 日	1 个月 内(含)	新 股 流 通 受 限	21.93	21.93	13,111	287,524.23	287,524.23	-	

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌的股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基

金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级列示的债券投资。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

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

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级列示的同业存单投资。

##### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	6,421,579.94	-
AAA 以下	240,592.50	-
未评级	-	-
合计	6,662,172.44	-

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

##### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

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

##### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级列示的同业存单投资。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金为开放式基金，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。

### 6.4.13.4 市场风险

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

#### 6.4.13.4.1 利率风险

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年6月 30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,565,365,335.77	-	-	-	-	-	1,565,365,335.77
结算备付金	15,024,144.51	-	-	-	-	-	15,024,144.51
存出保证金	4,679,353.24	-	-	-	-	-	4,679,353.24
交易性金融资产	-	-	1,010,576,986.30	5,495,884.52	1,166,287.92	20,725,165,932.26	21,742,405,091.00
应收申购款	235,344.39	-	-	-	-	12,612,824.34	12,848,168.73
应收清算款	-	-	-	-	-	165,330,794.26	165,330,794.26
资产总计	1,585,304,177.91	-	1,010,576,986.30	5,495,884.52	1,166,287.92	20,903,109,550.86	23,505,652,887.51
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	45,986,985.93	45,986,985.93
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	28,067,224.35	28,067,224.35
应付托管费	-	-	-	-	-	4,677,870.72	4,677,870.72
应交税费	-	-	-	-	-	14.78	14.78
其他负债	-	-	-	-	-	11,686,869.16	11,686,869.16
负债总计	-	-	-	-	-	90,418,964.94	90,418,964.94
利率敏感度 缺口	1,585,304,177.91	-	1,010,576,986.30	5,495,884.52	1,166,287.92	20,812,690,585.92	23,415,233,922.57
上年度末 2021年12月 31日							
资产							
银行存款	4,334,602,109.82	-	-	-	-	-	4,334,602,109.82

结算备付金	43,432,255.99	-	-	-	-	43,432,255.99
存出保证金	2,538,965.43	-	-	-	-	2,538,965.43
交易性金融资产	-	-	-	-	25,588,768,313.09	25,588,768,313.09
应收申购款	1,812,323.15	-	-	-	24,875,848.57	26,688,171.72
应收证券清算款	-	-	-	-	21,612,892.26	21,612,892.26
其他资产	-	-	-	-	483,027.49	483,027.49
资产总计	4,382,385,654.39	-	-	-	25,635,740,081.41	30,018,125,735.80
负债	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	55,113,049.49	55,113,049.49
应付管理人报酬	-	-	-	-	39,299,998.83	39,299,998.83
应付托管费	-	-	-	-	6,549,999.79	6,549,999.79
应付证券清算款	-	-	-	-	14,415,342.18	14,415,342.18
其他负债	-	-	-	-	22,543,281.45	22,543,281.45
负债总计	-	-	-	-	137,921,671.74	137,921,671.74
利率敏感度缺口	4,382,385,654.39	-	-	-	25,497,818,409.67	29,880,204,064.06

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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)。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末(2022年6月30日)	上年度末(2021年12月31日)
	利率+1%	-5,318,242.11	-
	利率-1%	5,375,373.49	-

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。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

汇率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，因此无重大汇率风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险，主要是基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	20,725,165,932.26	88.51	25,588,768,313.09	85.64
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	1,017,239,158.74	4.34	—	—
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	21,742,405,091.00	92.86	25,588,768,313.09	85.64

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假设单个证券的公允价值和市场组合的公允价值依照资本-资产定价模型 (CAPM) 描述的规律进行变动
	使用本基金业绩比较基准所对应的市场组合进行分析
	在业绩基准变化 10%时，对单个证券相应的公允价值变化进行加总得到基金净值



		的变化	
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准上升 10%	4,640,523,850.87	4,296,958,387.47
	业绩比较基准下降 10%	-4,640,523,850.87	-4,296,958,387.47

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

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	20,409,646,036.62	25,295,504,729.84
第二层次	1,016,360,395.05	5,504.49
第三层次	316,398,659.33	293,258,078.76
合计	21,742,405,091.00	25,588,768,313.09

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

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等，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不会将相关股票和可转换债券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（2021 年 12 月 31 日：无）。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2022 年 6 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	20,725,165,932.26	88.17
	其中：股票	20,725,165,932.26	88.17
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,017,239,158.74	4.33
	其中：债券	1,017,239,158.74	4.33
	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	1,580,389,480.28	6.72
8	其他各项资产	182,858,316.23	0.78
9	合计	23,505,652,887.51	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	20,794,683.44	0.09
C	制造业	11,857,777,480.72	50.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,703,400,173.88	7.27
E	建筑业	358,924,460.19	1.53
F	批发和零售业	399,472,466.59	1.71
G	交通运输、仓储和邮政业	227,266,412.68	0.97
H	住宿和餐饮业	246,316,400.00	1.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	855,465,287.46	3.65
J	金融业	836,490,708.00	3.57
K	房地产业	3,129,440,296.60	13.36
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	18,688,444.38	0.08
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	1,071,129,118.32	4.57
S	综合	-	-
	合计	20,725,165,932.26	88.51

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600048	保利发展	108,407,289	1,892,791,265.94	8.08
2	601985	中国核电	166,566,328	1,142,645,010.08	4.88
3	002138	顺络电子	39,850,334	1,085,921,601.50	4.64
4	300413	芒果超媒	32,108,187	1,071,129,118.32	4.57
5	300769	德方纳米	2,479,635	1,001,751,631.80	4.28
6	300750	宁德时代	1,733,933	925,920,222.00	3.95
7	002049	紫光国微	4,656,598	883,449,772.56	3.77
8	300059	东方财富	32,595,765	827,932,431.00	3.54

9	002938	鹏鼎控股	21,058,790	636,186,045.90	2.72
10	600745	闻泰科技	7,281,514	619,729,656.54	2.65
11	600011	华能国际	78,304,343	551,262,574.72	2.35
12	002036	联创电子	35,722,150	548,692,224.00	2.34
13	600131	国网信通	40,593,528	545,982,951.60	2.33
14	000002	万科 A	25,988,392	532,762,036.00	2.28
15	603666	亿嘉和	7,646,094	519,738,497.40	2.22
16	600690	海尔智家	16,205,605	445,005,913.30	1.90
17	001979	招商蛇口	31,738,230	426,244,428.90	1.82
18	300476	胜宏科技	21,888,170	401,866,801.20	1.72
19	600580	卧龙电驱	23,708,041	341,869,951.22	1.46
20	603939	益丰药房	5,648,273	298,398,262.59	1.27
21	300682	朗新科技	11,198,362	280,066,738.78	1.20
22	600383	金地集团	20,657,929	277,642,565.76	1.19
23	600426	华鲁恒升	9,099,855	265,715,766.00	1.13
24	600585	海螺水泥	7,499,864	264,595,201.92	1.13
25	601369	陕鼓动力	27,265,761	261,751,305.60	1.12
26	600754	锦江酒店	3,916,000	246,316,400.00	1.05
27	002028	思源电气	6,505,357	231,981,030.62	0.99
28	601633	长城汽车	6,049,981	224,091,296.24	0.96
29	300286	安科瑞	7,633,523	207,250,149.45	0.89
30	600398	海澜之家	42,075,846	199,860,268.50	0.85
31	600703	三安光电	8,087,987	198,802,720.46	0.85
32	300014	亿纬锂能	2,024,978	197,435,355.00	0.84
33	601669	中国电建	23,998,979	188,871,964.73	0.81
34	002120	韵达股份	10,802,004	184,282,188.24	0.79
35	600346	恒力石化	7,999,908	177,917,953.92	0.76
36	601233	桐昆股份	9,499,886	150,858,189.68	0.64
37	002101	广东鸿图	5,927,826	135,154,432.80	0.58
38	002916	深南电路	1,405,200	131,681,292.00	0.56
39	688116	天奈科技	641,918	108,792,262.64	0.46
40	002920	德赛西威	700,897	103,732,756.00	0.44
41	603883	老百姓	2,983,300	101,074,204.00	0.43
42	002635	安洁科技	5,999,744	98,215,809.28	0.42
43	601800	中国交建	9,920,436	92,061,646.08	0.39
44	300638	广和通	3,292,863	87,227,940.87	0.37
45	603517	绝味食品	1,248,203	72,171,097.46	0.31
46	601186	中国铁建	8,999,915	71,099,328.50	0.30
47	300316	晶盛机电	999,927	67,585,065.93	0.29
48	603589	口子窖	1,102,944	64,643,547.84	0.28
49	603348	文灿股份	1,199,976	64,318,713.60	0.27
50	603305	旭升股份	2,099,849	63,457,436.78	0.27

51	601012	隆基绿能	771,920	51,433,029.60	0.22
52	688233	神工股份	868,562	48,813,184.40	0.21
53	002032	苏泊尔	850,000	47,889,000.00	0.20
54	601799	星宇股份	250,407	42,819,597.00	0.18
55	600460	士兰微	762,300	39,639,600.00	0.17
56	002415	海康威视	1,089,500	39,439,900.00	0.17
57	688213	思特威	600,000	34,386,000.00	0.15
58	688100	威胜信息	1,634,103	34,299,821.97	0.15
59	300308	中际旭创	990,867	30,766,420.35	0.13
60	300124	汇川技术	451,500	29,740,305.00	0.13
61	603799	华友钴业	298,480	28,540,657.60	0.12
62	000786	北新建材	803,810	27,827,902.20	0.12
63	601231	环旭电子	1,937,504	27,822,557.44	0.12
64	002841	视源股份	351,100	26,444,852.00	0.11
65	603338	浙江鼎力	512,254	25,971,277.80	0.11
66	600309	万华化学	262,106	25,421,660.94	0.11
67	300408	三环集团	831,800	25,037,180.00	0.11
68	603986	兆易创新	171,118	24,334,690.78	0.10
69	601966	玲珑轮胎	944,515	23,962,345.55	0.10
70	600031	三一重工	1,246,486	23,758,023.16	0.10
71	603225	新凤鸣	1,999,789	23,077,565.06	0.10
72	002384	东山精密	985,392	22,595,038.56	0.10
73	600893	航发动力	480,100	21,849,351.00	0.09
74	002468	申通快递	1,740,200	20,743,184.00	0.09
75	600233	圆通速递	1,000,100	20,392,039.00	0.09
76	603112	华翔股份	1,331,085	19,846,477.35	0.08
77	601899	紫金矿业	2,086,000	19,462,380.00	0.08
78	002884	凌霄泵业	946,934	19,402,677.66	0.08
79	603989	艾华集团	684,610	19,306,002.00	0.08
80	300054	鼎龙股份	909,794	19,260,338.98	0.08
81	300416	苏试试验	760,311	18,688,444.38	0.08
82	603707	健友股份	656,434	18,511,438.80	0.08
83	688122	西部超导	196,528	18,119,881.60	0.08
84	002851	麦格米特	689,359	18,102,567.34	0.08
85	002001	新和成	750,616	17,121,550.96	0.07
86	601179	中国西电	3,643,700	17,052,516.00	0.07
87	000938	紫光股份	824,240	15,990,256.00	0.07
88	002064	华峰化学	1,615,616	13,635,799.04	0.06
89	002250	联化科技	750,521	12,286,028.77	0.05
90	600741	华域汽车	500,000	11,500,000.00	0.05
91	600862	中航高科	407,600	11,453,560.00	0.05
92	688508	芯朋微	147,189	10,965,580.50	0.05

93	002879	长缆科技	639,700	9,966,526.00	0.04
94	002555	三七互娱	458,846	9,741,300.58	0.04
95	600038	中直股份	211,400	9,555,280.00	0.04
96	688200	华峰测控	26,658	9,500,911.20	0.04
97	600116	三峡水利	945,477	9,492,589.08	0.04
98	300454	深信服	83,700	8,686,386.00	0.04
99	601318	中国平安	183,300	8,558,277.00	0.04
100	000657	中钨高新	537,700	8,065,500.00	0.03
101	600438	通威股份	134,500	8,051,170.00	0.03
102	002223	鱼跃医疗	270,200	6,933,332.00	0.03
103	300982	苏文电能	146,753	6,891,520.88	0.03
104	603187	海容冷链	180,522	6,598,079.10	0.03
105	002594	比亚迪	15,000	5,002,350.00	0.02
106	300207	欣旺达	150,000	4,740,000.00	0.02
107	000733	振华科技	30,000	4,079,100.00	0.02
108	300083	创世纪	300,000	3,450,000.00	0.01
109	600882	妙可蓝多	68,200	3,191,760.00	0.01
110	603816	顾家家居	54,582	3,090,978.66	0.01
111	002271	东方雨虹	59,997	3,088,045.59	0.01
112	601865	福莱特	80,000	3,048,000.00	0.01
113	600885	宏发股份	72,800	3,046,680.00	0.01
114	000858	五粮液	15,000	3,028,950.00	0.01
115	000568	泸州老窖	12,000	2,958,480.00	0.01
116	688002	睿创微纳	70,000	2,780,400.00	0.01
117	002179	中航光电	42,000	2,659,440.00	0.01
118	300274	阳光电源	25,000	2,456,250.00	0.01
119	600660	福耀玻璃	50,000	2,090,500.00	0.01
120	688308	欧科亿	30,000	1,996,800.00	0.01
121	002245	蔚蓝锂芯	79,664	1,849,001.44	0.01
122	002139	拓邦股份	150,000	1,840,500.00	0.01
123	600938	中国海油	84,004	1,332,303.44	0.01
124	688220	翱捷科技	12,371	848,526.89	0.00
125	688559	海目星	7,680	558,336.00	0.00
126	688400	凌云光	13,111	287,524.23	0.00
127	688766	普冉股份	181	29,526.53	0.00
128	002212	天融信	2,200	22,330.00	0.00
129	000625	长安汽车	130	2,251.60	0.00
130	300737	科顺股份	100	1,318.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300413	芒果超媒	1,118,958,144.87	3.74
2	300750	宁德时代	910,269,798.10	3.05
3	300059	东方财富	802,617,036.83	2.69
4	300769	德方纳米	763,915,468.19	2.56
5	002049	紫光国微	748,651,997.08	2.51
6	601899	紫金矿业	686,565,105.51	2.30
7	002230	科大讯飞	665,273,014.18	2.23
8	601985	中国核电	659,508,922.77	2.21
9	600585	海螺水泥	623,612,806.85	2.09
10	002036	联创电子	532,608,359.62	1.78
11	600131	国网信通	504,059,120.51	1.69
12	601800	中国交建	459,313,520.93	1.54
13	002916	深南电路	446,777,134.99	1.50
14	603666	亿嘉和	432,097,610.92	1.45
15	002027	分众传媒	376,386,478.40	1.26
16	000683	远兴能源	375,667,760.36	1.26
17	600426	华鲁恒升	369,673,180.52	1.24
18	600011	华能国际	354,062,510.16	1.18
19	601668	中国建筑	312,009,800.68	1.04
20	002371	北方华创	309,426,285.53	1.04

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600048	保利发展	1,324,998,462.99	4.43
2	600703	三安光电	1,146,454,196.99	3.84
3	000002	万科 A	1,079,111,766.81	3.61
4	601899	紫金矿业	833,448,631.08	2.79
5	300059	东方财富	599,506,887.02	2.01
6	600011	华能国际	599,291,325.93	2.01
7	002415	海康威视	566,429,577.46	1.90
8	600893	航发动力	551,772,623.19	1.85
9	002230	科大讯飞	504,639,893.56	1.69
10	002049	紫光国微	496,936,562.67	1.66
11	002916	深南电路	473,127,519.01	1.58
12	300054	鼎龙股份	468,728,904.51	1.57
13	000683	远兴能源	394,660,016.77	1.32
14	600038	中直股份	377,524,480.13	1.26
15	002027	分众传媒	373,808,882.83	1.25
16	601800	中国交建	363,265,523.25	1.22

17	600027	华电国际	350,384,424.35	1.17
18	601985	中国核电	342,977,036.43	1.15
19	600745	闻泰科技	322,472,397.52	1.08
20	300750	宁德时代	316,514,242.34	1.06

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	17,788,001,743.00
卖出股票收入（成交）总额	17,562,051,658.57

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,010,576,986.30	4.32
	其中：政策性金融债	1,010,576,986.30	4.32
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）	6,662,172.44	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,017,239,158.74	4.34

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	220201	22 国开 01	10,000,000	1,010,576,986.30	4.32
2	132026	G 三峡 EB2	49,050	5,495,884.52	0.02
3	113053	隆 22 转债	6,710	925,695.42	0.00
4	113059	福莱转债	1,890	240,592.50	0.00

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。



## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 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本期未出现被监管部门立案调查，并且未在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 7.12.2 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中没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

### 7.12.3 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	4,679,353.24
2	应收清算款	165,330,794.26
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	12,848,168.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	182,858,316.23

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
----	------	------	-------------	--------------	----------

1	300769	德方纳米	119,152,000.00	0.51	大宗交易购入 流通受限
---	--------	------	----------------	------	----------------

### 7.12.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
2,032,549	15,875.74	1,563,465,508.26	4.85	30,704,760,275.02	95.15

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	项宇涛	28,125,623.00	1.38
2	梁健雄	16,960,867.00	0.83
3	西藏工布江达县九盛投资有限责任公司	15,247,142.00	0.75
4	张艳红	12,330,886.00	0.60
5	泰山财产保险股份有限公司-自有资金	10,000,000.00	0.49
6	刘世杰	7,360,000.00	0.36
7	深圳市美格莱特电子有限公司	6,631,241.00	0.32
8	王永华	6,180,000.00	0.30
9	山西锦筑化工技术有限公司	5,900,000.00	0.29
10	斛晋滨	5,621,098.00	0.28

注：持有人为 LOF 基金场内持有人。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	6,553,722.54	0.0203

### 8.4 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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

注：本基金的基金经理之一也是本公司高级管理人员及研究部门负责人，故上述两点统计数据有

重合部分。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2005 年 11 月 3 日） 基金份额总额	927,645,098.72
本报告期期初基金份额总额	34,058,134,533.87
本报告期基金总申购份额	3,425,706,296.76
减：本报告期基金总赎回份额	5,215,615,047.35
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	32,268,225,783.28

注：总申购份额含红利再投资、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 报告期内基金管理人重大人事变动。

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

(2) 报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

### 10.6 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、基金托管人及其高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 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	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国盛证券	2	12,196,352,919.97	34.51	7,700,480.74	29.55	-
兴业证券	6	5,972,965,295.44	16.90	4,368,033.81	16.76	-
东方证券	1	3,778,216,963.97	10.69	3,521,309.58	13.51	-
中信证券	3	3,331,200,524.68	9.43	2,390,973.01	9.18	-
申万宏源证券	1	2,219,346,004.82	6.28	2,066,891.91	7.93	-
广发证券	3	1,754,513,388.65	4.96	1,107,615.23	4.25	-
中金公司	1	1,441,019,340.38	4.08	1,342,004.44	5.15	-
海通证券	2	1,355,661,490.56	3.84	1,262,514.01	4.85	-
招商证券	3	1,260,120,344.22	3.57	795,516.27	3.05	-
天风证券	1	1,172,050,841.83	3.32	739,921.43	2.84	-
华泰证券	1	641,238,542.95	1.81	597,185.17	2.29	-
中信建投证券	3	220,517,783.11	0.62	162,417.94	0.62	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
中信华南证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-

山西证券	2	-	-	-	-	-
中银国际 证券	1	-	-	-	-	-

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

### 10.7.2 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 (%)
国盛证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投 证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中信华南 证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-

中银国际 证券	-	-	-	-	-	-
------------	---	---	---	---	---	---

## 10.8 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	关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则工作的公告	证券时报、指定互联网网站	2022-01-05
2	关于调整旗下部分基金单笔最低交易限额的公告	证券时报、指定互联网网站	2022-01-06
3	关于副总经理离任的公告	证券时报、指定互联网网站	2022-01-21
4	关于我司旗下基金参与腾安基金销售赎回费率优惠活动的公告	证券时报、指定互联网网站	2022-01-26
5	关于使用自有资金自购旗下偏股型公募基金壹亿元的公告	证券时报、指定互联网网站	2022-01-27
6	关于公司副总经理任职的公告	证券时报、指定互联网网站	2022-01-28
7	关于增加华安证券为旗下部分基金销售机构并调整旗下部分基金在部分销售机构费率优惠活动的公告	证券时报、指定互联网网站	2022-04-18
8	关于增加兴业银行为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、指定互联网网站	2022-05-06
9	关于终止瑞银证券有限责任公司办理旗下部分基金相关销售业务的公告	证券时报、指定互联网网站	2022-05-20
10	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、指定互联网网站	2022-06-17
11	关于公司副总经理变更的公告	证券时报、指定互联网网站	2022-06-30

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

产品特有风险

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

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

2、“赎回份额”包含份额赎回、转换转出等导致投资者持有份额减少的情形。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》（财会〔2020〕22 号）等有关规定，兴证全球基金管理有限公司（以下简称“本公司”）旗下管理的公开募集证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具相关会计准则。执行新会计准则后，本公司旗下公开募集证券投资基金将按照新金融工具相关会计准则的规定进行会计计量。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金设立的文件
- 2、《兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金合同》
- 3、《兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）托管协议》
- 4、《兴全趋势投资混合型证券投资基金（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。

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

### 12.3 查阅方式

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

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

兴证全球基金管理有限公司

2022 年 8 月 31 日