兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金 金 2022 年中期报告

2022年6月30日

基金管理人: 兴证全球基金管理有限公司

基金托管人: 兴业银行股份有限公司

送出日期: 2022年8月31日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计 。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§	1	重要提示及目录		2
		.1 重要提示		
§	2	. 基金简介		5
	2.2.2.	2.1 基金基本情况 2.2 基金产品说明 2.3 基金管理人和基金托管人 2.4 信息披露方式 2.5 其他相关资料 2.5 其他相关资料	5	5 5 5
§	3	3 主要财务指标和基金净值表现	(6
	3.	3.1 主要会计数据和财务指标 3.2 基金净值表现	(6
§	4	上管理人报告	8	8
	 4. 4. 4. 4. 4. 	1.1 基金管理人及基金经理情况		9 0 1 3
§	5	5 托管人报告	13	3
	5.	5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	说明 13	3
§	6	5 半年度财务会计报告(未经审计)	14	4
	6. 6.	5.1 资产负债表 5.2 利润表		5 7
§	7	′投资组合报告	43	3
	7. 7. 7. 7.	7.1 期末基金资产组合情况		3 4 5 7

	7.9 期末按公允价值占基金资产净值 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 7.11 报告期末本基金投资的国债期货	比例大小排序的前五名权证投资明细	47 47 48 48 48
§	§ 8 基金份额持有人信息		49
	8.2 期末基金管理人的从业人员持有	本基金的情况	49 49 49
§	§ 9 开放式基金份额变动		49
§	§ 10 重大事件揭示		50
	10.2 基金管理人、基金托管人的专门 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基 10.4 基金投资策略的改变 10.5 为基金进行审计的会计师事务所 10.6 管理人、托管人及其高级管理人 10.7 基金租用证券公司交易单元的有]基金托管部门的重大人事变动	50 50 50 50 50 50 50 52
§	§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.		53
			53 53
§	§ 12 备查文件目录		53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	兴全有机增长混合
基金主代码	340008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年3月25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	667, 662, 959. 21 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金投资于有机增长能力强的公司,获取当前收益及实现长期资
	本增值。
投资策略	本基金采取"自上而下"的方法,定性与定量研究相结合,在股票
	与债券等资产类别之间进行资产配置。在宏观与微观层面对各类资
	产的价值增长能力展开综合评估,动态优化资产配置。并借鉴海外
	有机增长的研究成果,构建"兴证全球有机增长筛选系统",将有
	机增长投资作为本基金股票组合投资的核心理念。
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	本基金是混合型证券投资基金,预计长期平均风险与收益低于股票
	型证券投资基金,高于可转债、债券型、货币型证券投资基金,属
	于中高风险、中高收益的证券投资基金品种。

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	姓名	杨卫东	李真	
行总级路 负责人	联系电话	021-20398888	021-52629999-212051	
贝贝八	电子邮箱	yangwd@xqfunds.com	tgb_lizhen@cib.com.cn	
客户服务电	已话	4006780099, 021-38824536	95561	
传真		021-20398858	021-62159217	
注册地址		上海市黄浦区金陵东路 368 号	福建省福州市台江区江滨中大	
			道 398 号兴业银行大厦	
办公地址		上海市浦东新区芳甸路 1155 号嘉	上海市银城路 167 号兴业大厦 4	
		里城办公楼 28-29 楼	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	http://www.xqfunds.com

址	
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022年1月1日-2022年6月30日)
本期已实现收益	-359, 732, 034. 98
本期利润	-524, 648, 066. 54
加权平均基金份额本期利润	-0. 7859
本期加权平均净值利润率	-20. 42%
本期基金份额净值增长率	-16. 94%
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	1, 912, 837, 720. 13
期末可供分配基金份额利润	2. 8650
期末基金资产净值	2, 580, 500, 679. 34
期末基金份额净值	3. 8650
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	459. 98%

- 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

	份额净	份额净值	业绩比较基	业绩比较基准		
阶段	值增长	增长率标	准收益率③	收益率标准差	1)-3	2-4
	率①	准差②		4		

过去一个月	4. 00%	1.12%	4. 70%	0. 53%	-0. 70%	0. 59%
过去三个月	4. 96%	1.50%	3. 65%	0.71%	1.31%	0. 79%
过去六个月	-16. 94%	1.51%	-3. 75%	0.73%	-13. 19 %	0. 78%
过去一年	-9.80%	1.30%	-4.70%	0. 62%	-5. 10%	0. 68%
过去三年	62. 01%	1. 26%	16. 54%	0. 63%	45. 47%	0. 63%
自基金合同生效起 至今	459. 98%	1.31%	84. 37%	0.72%	375. 61 %	0. 59%

注:本基金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。

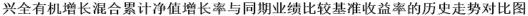
本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算,按下列公式计算:

Return t =50%×(沪深 300 指数 t / 沪深 300 指数 t-1 -1)+45%×(中证国债指数 t / 中证国债指数 t / 中证国债指数 t / 360)

Benchmark $t = (1+Return t) \times (1+Benchmark t-1) -1$

其中, t=1, 2, 3, …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





注: 1、净值表现所取数据截至到 2022 年 06 月 30 日。

2、按照《兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定,本基金建仓期为 2009年03月25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、F0F 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

		证券从	说明		
,		任职日期	离任日期	业年限	25,7
钱鑫	兴全有机 增长灵混为 配置进券金型证券金经理	2020 年 12月9日	_	12 年	硕士,历任上海证大投资管理有限公司投资经理助理,兴证全球基金管理有限公司研究员、基金经理助理。

- 注: 1、职务指截止报告期末的职务(报告期末仍在任的)或离任前的职务(报告期内离任的)。
- 2. 任职日期指基金合同生效之日(基金成立时即担任基金经理)或公司作出聘任决定之日(基金成立后担任基金经理); 离任日期指公司作出解聘决定之日。
 - 3、证券从业的涵义遵从行业的相关规定,包括资管相关行业从业经历。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注: 本报告期末,本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划的投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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

是否存在非公平的因素。

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

随着新一轮疫情卷土重来,上半年国内经济和金融市场均承受了较大的压力。面对复杂的外部环境,市场主体难以建立起稳定的预期,出现决策短期化和行为消极化的倾向,降低了经济系统内生的增长动力。过去两年,我国防疫措施不断根据病毒的特征变化进行调整,在供给侧有效保障了生产的正常开展。从早期的医疗物资到后期的耐用消费品,出口份额不断提升,一方面拉动了国内的经济增长,另一方面也为填补全球经济的产出缺口做出了巨大的贡献。然而本轮奥密克戎的疫情扩散过于迅速,大幅压缩了社交隔离和经济正常运转之间的空间,不仅导致服务性消费需求受到抑制,而且阶段性对供应链造成了冲击,对经济的平稳运行造成了前所未有的困难。

相比经济数据所展现出的情况,隐藏在总量背后的结构性压力可能更令人担忧。通过一些针对特定区域和特定行业的颗粒度更细的草根调查,我们观察到大量中小企业由于无法获得足够的外部救助,在经历了多轮疫情的反复冲击后,或主动或被动地退出了市场。资源向更高效的主体集中固然有利于提升整体的效率,但作为吸纳就业的主要力量,中小微企业的大量关停势必会导致失业率的明显上升。考虑到这一影响的时滞效应,以及六月之后大批应届毕业生将正式进入劳动力市场,下半年的就业形势恐怕不容乐观。

在股票的定价模型中,由经济周期决定的盈利增长和由货币政策决定的折现成本是两大核心变量。我们习惯于将股市比作市场的晴雨表,其中暗含了两个假设:其一,盈利是定价的主要矛盾;其二,盈利服从周期性的变化,是可辨识和可预测的。但随着后金融危机时代逆周期调控政策的力度不断加大,全球经济周期被大幅抹平,市场逐渐陷入到一种货币崇拜的情结之中。当流动性取代盈利成为决定牛熊的主要矛盾,市场和经济的映射关系也随之由前瞻变成了对立:即经济越差,货币越宽,市场越好。在这样一种叙事逻辑之下,经济和股市之间更多表现为一种相关性关系而非此前的因果关系——作为政策共同的应变量,两者在时间维度上的一致性尽管变得难以辨认,但在结构维度上依然表现出相同的头部化特征。

从各个行业白马股之间列王的纷争,到科技、消费、医药的三足鼎立,再到宁王和茅王的寡 头均势,A 股这一轮大逃杀游戏随着新能源的君临天下逐步走入到了终局。不止风光和汽车,包 括电子、有色、机械、化工、乃至环保在内的诸多行业,无不为了获得市场的青睐而努力证明自己和新能源沾亲带故。实体经济的转型必须遵循客观规律,通常是缓慢而曲折的,钱在其中充其量只是必要条件。但在一个充满货币崇拜的市场中,投资逻辑往往脱离当前的事实,转而依赖对于未来的美好想象。从本质上说,是过度充盈的流动性需要一个更大的池子来承载,所以才必须借用想象力来打破事实所构筑的壁垒。我们之所以在股票市场观察到比实体领域更极致的冷热分化,是因为这里流动性催生的泡沫化更为严重。但是矛盾论告诉我们,趋势不可能永远只朝着单一的方向发展,赢家通吃之后,随之而来的往往是推倒重来。面对当下这个进退维谷的市场环境,固执己见和随波逐流似乎都不是足够理性的选择,在常识允许的边界内适度参与可能更具可操作性。

本基金在报告期内保持了一个相对高的股票仓位,同时在二季度将债券持仓中部分偏债型转债置换成了偏股型转债,希望借此弥补组合向上弹性不足的缺点。行业方面继续持有此前看好的航空、酒店和电力设备、虽然疫情冲击之下持仓公司在实际经营和预期层面都承受了较大的压力,但长期竞争优势扩大的逻辑既未遭到破坏、也未得到充分的演绎。在未来可预见的修复叠加增长的过程中,相信股价仍有相当大的向上空间。在泛新能源领域,基金选择了中游输配电环节和下游汽车智能化领域的相关公司进行配置,主要考虑仍旧是估值和基本面的匹配程度尚在可以接受的区间之内。在增量方面,二季度基金对于物流板块的持仓比例有所提升。预期随着下半年经济活动的加速恢复,货物的流转需求将持续增加,由此带来景气度的反转和龙头公司长期价值的发现。除此以外,基金还持有了部分石油煤炭等传统能源公司,除了看好产品的价格潜力,更多还是出于对其高分红收益率的偏好。

本基金在报告期内的表现不甚理想,其中既有因风格保守导致组合结构偏离市场主流偏好的原因,也有受制于个人能力而对部分行业把握程度不够的影响。我们无力改变市场,也不会因为追求短期的业绩而做过度的迎合,因此只能在既定投资框架允许的范畴内做尽可能及时的调整和应对。投资框架固然也需要不断进化,尤其是对于一名新人而言,但这个过程可能更接近实体经济的渐进调整而非市场风格的快速切换。时间会成为长期者的朋友,前提是我们要相信它的力量。

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 3.8650 元; 本报告期基金份额净值增长率为-16.94%, 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

展望下半年,机会与风险并存。随着实体经济加速恢复,淤积在金融市场的资金将持续流出,如果央行在基础货币投放上仍旧保持克制,那么市场将会面对一个边际趋紧的流动性环境。在限

制货币政策进一步宽松的诸多因素中,猪、油价格共振推升通胀的风险位居首位,其次才是美联储加息对人民币汇率造成的贬值压力。市场预期国内 CPI 将于 9 月突破 3%,四季度大概率会出现"紧货币+宽信用"的政策组合。在此基准假设情境之下,热门赛道的估值水平预计将面对较大的收缩压力。

就需求而言,基建和制造业投资是当下为数不多仍有较强增长动能的领域。作为基建投资的 实际主体,中央财政尚有较大的负债空间。近期可以观察到专项债发行和获批项目落地都在加速 推进,包括水利、农业、电网、东数西算在内的一系列新老基建项目有望接力上半年的大规模留 抵退税,撑起财政发力的下半场。制造业投资方面,则将继续沿着补齐短板和发扬优势两条主线 展开,前者对应半导体上游设备和材料的国产替代,后者指向光伏风电设备及锂电池制造产业的全球化扩张。

如果我们把视线投向更远处,一些可能改变人类未来生活的新技术也已逐渐进入到商业化的前夜。尽管消费电子在宏观经济周期和产品生命周期的双重压力之下境况惨淡,但部分公司凭借多年积累的技术和团队,已经默默参与到下一代计算平台的开发之中。我们对于虚拟现实的期待绝不止于一台更为酷炫的游戏设备,它所能创造的可能性需要等待一款类似当年 iPhone 3GS 这样的终端来向我们揭示。考虑到行业当前的估值普遍处于历史底部区域,持有的机会成本较低,从风险收益比的角度而言不失为一个好的配置选择。

关于风险,我们的整体排序是内因重于外因。国内方面,通胀是下半年最主要的核心矛盾,其次是地产信用风险暴露对金融稳定构成的潜在威胁。从市场表现来看,前者尚未得到充分定价,而后者似乎有些反应过度,背后是预期不明确下决策的短期化效应,即对当下已经观察到的风险给予更高的权重。外部风险大致可以分为两个层面。首先是美联储加息推动中美利差走阔,从而对我们货币政策的空间造成一定的制约。其次是欧日两大经济体潜在的债务违约风险,尽管目前看欧洲央行和日本央行仍有对应的政策工具来稳定市场信心。但代价可能是自身国内需求的萎靡,从而对我们的出口造成一定的负面压力。

关于下半年基金的投资策略,考虑到流动性环境大概率趋紧,当前偏高的股票仓位需要适当下降,同时债券组合的结构也需要做再平衡调整,以减少风险暴露。行业配置方面暂不考虑做大的变动,仍旧看好航空、酒店和电力设备等行业的景气度提升、以及组合内公司的长期竞争力,静待被市场价值发现。此外,研究上会着力加强对各家消费电子公司在技术创新和产品布局方面的前瞻性分析,视基本面与估值的匹配程度选择合适的标的进行逆向布局。

最后,感谢所有投资者在这样一个艰难的环境下仍旧给予我们的耐心,我们将一如既往地秉持以持有人利益为优先的核心价值观,坚持长期投资和价值投资的基本原则,力争通过自身的努

力为大家创造长期稳定的价值回报,希望能有幸与您继续一路同行。

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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: 兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金

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	上年度末	
页 厂	附在专	2022年6月30日	2021年12月31日	
资 产:				
银行存款	6. 4. 7. 1	263, 853, 192. 85	216, 396, 338. 15	
结算备付金		2, 754, 957. 83	4, 843, 956. 85	
存出保证金		923, 343. 52	809, 860. 77	
交易性金融资产	6. 4. 7. 2	2, 333, 983, 342. 26	2, 818, 659, 047. 05	
其中: 股票投资		1, 999, 629, 230. 13	2, 382, 102, 952. 45	
基金投资		_	-	
债券投资		334, 354, 112. 13	436, 556, 094. 60	
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		4, 727. 03	-	
应收股利		-	-	
应收申购款		1, 012, 577. 73	2, 274, 447. 13	
递延所得税资产		_		
其他资产	6. 4. 7. 8	_	760, 866. 20	
资产总计		2, 602, 532, 141. 22	3, 043, 744, 516. 15	

负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
		2022年0月30日	2021 平 12 万 31 日
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		11, 261, 349. 33	10, 321, 925. 23
应付赎回款		4, 904, 959. 51	4, 776, 404. 77
应付管理人报酬		3, 078, 729. 76	3, 785, 302. 31
应付托管费		513, 121. 63	630, 883. 71
应付销售服务费		_	-
应付投资顾问费		_	-
应交税费		3, 307. 45	4, 026. 66
应付利润		_	-
递延所得税负债			-
其他负债	6. 4. 7. 9	2, 269, 994. 20	2, 134, 158. 52
负债合计		22, 031, 461. 88	21, 652, 701. 20
净资产:			
实收基金	6. 4. 7. 10	667, 662, 959. 21	649, 496, 706. 16
其他综合收益	6. 4. 7. 11	-	_
未分配利润	6. 4. 7. 12	1, 912, 837, 720. 13	2, 372, 595, 108. 79
净资产合计		2, 580, 500, 679. 34	3, 022, 091, 814. 95
负债和净资产总计		2, 602, 532, 141. 22	3, 043, 744, 516. 15

注: 1、报告截止日 2022 年 06 月 30 日,基金份额净值 3.8650 元,基金份额总额 667,662,959.21 份。

2、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: 兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期: 2022年1月1日至2022年6月30日

单位:人民币元

		本期	上年度可比期间
项 目	附注号	2022年1月1日至2022年	2021年1月1日至2021年
		6月30日	6月30日
一、营业总收入		-502, 170, 305. 76	229, 694, 052. 26

6. 4. 7. 14 6. 4. 7. 15 6. 4. 7. 16 6. 4. 7. 17 6. 4. 7. 18	- - - - -337, 864, 264. 39 -336, 923, 770. 66 - - -9, 101, 908. 02	2, 325, 259. 35 - 415, 378, 602. 44 397, 519, 593. 21 - 5, 559, 486. 39
6. 4. 7. 15 6. 4. 7. 16 6. 4. 7. 17 6. 4. 7. 18	-336, 923, 770. 66 -	397, 519, 593. 21
6. 4. 7. 15 6. 4. 7. 16 6. 4. 7. 17 6. 4. 7. 18	-336, 923, 770. 66 -	397, 519, 593. 21
6. 4. 7. 15 6. 4. 7. 16 6. 4. 7. 17 6. 4. 7. 18	-336, 923, 770. 66 -	397, 519, 593. 21
6. 4. 7. 15 6. 4. 7. 16 6. 4. 7. 17 6. 4. 7. 18	-336, 923, 770. 66 -	397, 519, 593. 21
6. 4. 7. 15 6. 4. 7. 16 6. 4. 7. 17 6. 4. 7. 18	-336, 923, 770. 66 -	397, 519, 593. 21
6. 4. 7. 15 6. 4. 7. 16 6. 4. 7. 17 6. 4. 7. 18	-336, 923, 770. 66 -	397, 519, 593. 21
6. 4. 7. 15 6. 4. 7. 16 6. 4. 7. 17 6. 4. 7. 18	-336, 923, 770. 66 -	397, 519, 593. 21
6. 4. 7. 15 6. 4. 7. 16 6. 4. 7. 17 6. 4. 7. 18	-336, 923, 770. 66 -	397, 519, 593. 21
6. 4. 7. 15 6. 4. 7. 16 6. 4. 7. 17 6. 4. 7. 18	-	-
6. 4. 7. 16 6. 4. 7. 17 6. 4. 7. 18	-9, 101, 908. 02 - -	5, 559, 486. 39 - -
6. 4. 7. 16 6. 4. 7. 17 6. 4. 7. 18	-9, 101, 908. 02 - -	5, 559, 486. 39 - - -
6. 4. 7. 17 6. 4. 7. 18		
6. 4. 7. 17 6. 4. 7. 18		
6. 4. 7. 18		
	_	
C 1 7 10		
0. 4. 7. 19	8, 161, 414. 29	12, 299, 522. 84
	_	_
	-	
6. 4. 7. 20	-164, 916, 031. 56	-189, 470, 969. 33
	_	-
6. 4. 7. 21	162, 395. 97	1, 059, 603. 20
	22 477 760 70	21 671 005 90
6 4 10 9 1		31, 671, 995. 89
		21, 950, 150. 76
	5, 195, 046. 27	3, 658, 358. 40
0. 4. 10. 2. 1. 1		
	-	-
6 4 7 22	_	
0. 4. 1. 22	2 602 17	2, 664. 78
6 4 7 23		6, 060, 821. 95
0. 1. 1. 20	100, 020. 40	0, 000, 021. 30
	-524, 648, 066. 54	198, 022, 056. 37
	-524 648 066 54	198, 022, 056. 37
	6. 4. 7. 20	6. 4. 7. 19 8, 161, 414. 29 - 6. 4. 7. 20 -164, 916, 031. 56 - 6. 4. 7. 21 162, 395. 97 22, 477, 760. 78 6. 4. 10. 2. 1 19, 173, 889. 89 6. 4. 10. 2. 2 3, 195, 648. 27 6. 4. 10. 2. 1 - 6. 4. 7. 22 - 6. 4. 7. 22 - 6. 4. 7. 23 105, 620. 45

号填列)		
五、其他综合收益的税后净		_
额		
六、综合收益总额	-524, 648, 0	066. 54 198, 022, 056. 37

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: 兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期: 2022年1月1日至2022年6月30日

单位:人民币元

	本期						
项目		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)	649, 496, 706. 16	I	2, 372, 595, 108. 79	3, 022, 091, 814. 95			
加:会计政策变	1	-	_	-1			
前 期差错 更正	_		_				
其 他		1	_	1			
二、本期 期初净 资产(基 金净值)	649, 496, 706. 16	-	2, 372, 595, 108. 79	3, 022, 091, 814. 95			
三、本期 增减变 动额(减 少以"-" 号填列)	18, 166, 253. 05	_	-459, 757, 388. 66	-441, 591, 135. 61			
(一)、 综合收 益总额	1	1	-524, 648, 066. 54	-524, 648, 066. 54			
(二)、 本期基 金份额	18, 166, 253. 05	-	64, 890, 677. 88	83, 056, 930. 93			

· · · ·				
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	84, 024, 985. 75	_	256, 136, 275. 69	340, 161, 261. 44
购款				
2				
. 基金赎	-65, 858, 732. 70	_	-191, 245, 597. 81	-257, 104, 330. 51
回款				
(三)、				
本期向				
基金份				
额持有				
人分配				
利润产	_	_	_	_
生的基				
金净值				
变动(净				
值减少				
以"-"				
号填列)				
(四)、				
其他综				
合收益	_	-	_	_
结转留				
存收益				
四、本期				
期末净	667, 662, 959. 21	_	1, 912, 837, 720. 13	2, 580, 500, 679. 34
资产(基	001, 002, 333. 21		1, 312, 031, 120. 13	2, 500, 500, 015. 54
金净值)				
			可比期间	
项目		2021年1月1日3	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	839, 341, 884. 31	_	2, 550, 264, 570. 90	3, 389, 606, 455. 21
资产(基	333, 311, 331. 01		_, 555, _51, 510, 50	5, 555, 556, 166, 21
金净值)				
加:会计				
政策变	_	_	_	_
更				

24.				
前				
期差错	_	_	_	_
更正				
其	_	_	_	_
他				
二、本期				
期初净	839, 341, 884. 31		2, 550, 264, 570. 90	3, 389, 606, 455. 21
资产(基	039, 341, 004. 31		2, 330, 204, 370. 30	5, 569, 000, 455. 21
金净值)				
三、本期				
增减变				
动额(减	-176, 420, 654. 23	_	-372, 501, 385. 36	-548, 922, 039. 59
少以"-"				
号填列)				
(-),				
综合收	_	_	198, 022, 056. 37	198, 022, 056. 37
益总额			100, 022, 000. 01	100, 022, 000. 01
本期基				
金份额				
交易产				
生的基	150 400 054 00		570 500 441 7 0	746 044 005 06
金净值	-176, 420, 654. 23	_	-570, 523, 441. 73	-746, 944, 095. 96
变动数				
(净值				
减少以				
"-"号				
填列)				
其中:1.				
基金申	96, 550, 510. 45	_	304, 260, 169. 33	400, 810, 679. 78
购款				
2				
. 基金赎	-272, 971, 164. 68	-	-874, 783, 611. 06	-1, 147, 754, 775. 74
回款				
(三)、				
本期向				
基金份				
额持有				
人分配				
利润产	_	_	_	-
生的基				
金净值				
变动(净				
值减少				
□ 侧 少 □ 以 "-"				
以				

号填列)				
(四)、				
其他综				
合收益	_	_	_	-
结转留				
存收益				
四、本期				
期末净	669 091 990 09		9 177 769 10E EA	2 240 624 415 62
资产(基	662, 921, 230. 08	_	2, 177, 763, 185. 54	2, 840, 684, 415. 62
金净值)				

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:

 極华辉
 庄园芳
 詹鸿飞

 基金管理人负责人
 主管会计工作负责人
 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金(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")《关于核准兴业有机增长灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2008]1395号文)的核准,由兴证全球基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法规和《兴业有机增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2009年3月25日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为1,980,254,871.35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,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《兴业有机增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《兴业有机增长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括依法公开发行上市的股票、国债、金融债、企业债、公司债、回购、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。在正常市场情况下,股票投资比例为基金资产的30%-80%;债券投资比例为基金资产的0%-65%;现金或者到期日在一年以内的政府债券不小于基金资产净值的5%;其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规对该比例要求有变更的,以变更后的比例为准,本基金的投资范围会做相应调整。本基金投资组合

中突出有机增长特征的股票合计投资比例不低于股票资产的 80%。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编制财务报表。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 年上半年度的经营成果和净资产变动情况。

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业务模式 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 216,396,338.15 元、4,843,956.85 元、809,860.77 元、760,866.20 元和 2,274,447.13 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 216,422,491.58 元、4,846,136.65 元、810,225.27 元和 2,274,479.75 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 2,818,659,047.05 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 2,819,391,182.90 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 1,951,599.91 元和 182,558.61 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负债为其他负债,对

应的账面价值为人民币 2,134,158.52 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

	辛也: 人以中儿
项目	本期末
	2022年6月30日
活期存款	263, 853, 192. 85
等于: 本金	263, 837, 472. 72
加: 应计利息	15, 720. 13
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	263, 853, 192. 85

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		1, 926, 880, 263. 74	-	1, 999, 629, 230. 13	72, 748, 966. 39	
贵金属	景投资-金交			-		
所黄金	合约					
	交易所市	325, 754, 789. 95	692, 080. 23	334, 354, 112. 13	7, 907, 241. 95	
债券	场					
灰分	银行间市	_		_	_	
	场					

合计	325, 754, 789. 95	692, 080. 23	334, 354, 112. 13	7, 907, 241. 95
资产支持证券	_	ı	_	
基金	_		_	_
其他	_	_	_	_
合计	2, 252, 635, 053. 69	692, 080. 23	2, 333, 983, 342. 26	80, 656, 208. 34

- 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:本报告期末本基金无债权投资。

- 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:本报告期内本基金未发生债权投资减值准备。

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

	1 12. 7 (10)
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	12, 223. 17
应付证券出借违约金	_
应付交易费用	2, 170, 990. 58
其中:交易所市场	2, 170, 990. 58
银行间市场	_
应付利息	_
预提信息披露费	59, 507. 37
预提审计费	27, 273. 08
合计	2, 269, 994. 20

6.4.7.10 实收基金

金额单位: 人民币元

	本期	
项目	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	649, 496, 706. 16	649, 496, 706. 16
本期申购	84, 024, 985. 75	84, 024, 985. 75
本期赎回(以"-"号填列)	-65, 858, 732. 70	-65, 858, 732. 70
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	667, 662, 959. 21	667, 662, 959. 21

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	2, 218, 432, 862. 29	154, 162, 246. 50	2, 372, 595, 108. 79
本期利润	-359, 732, 034. 98	-164, 916, 031. 56	-524, 648, 066. 54
本期基金份额交易 产生的变动数	62, 547, 604. 30	2, 343, 073. 58	64, 890, 677. 88
其中:基金申购款	270, 970, 104. 60	-14, 833, 828. 91	256, 136, 275. 69
基金赎回款	-208, 422, 500. 30	17, 176, 902. 49	-191, 245, 597. 81
本期已分配利润	-		-
本期末	1, 921, 248, 431. 61	-8, 410, 711. 48	1, 912, 837, 720. 13

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	399, 914. 57
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	32, 747. 83
其他	14, 931. 82
合计	447, 594. 22

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	-336, 923, 770. 66
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	-336, 923, 770. 66

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	2, 897, 552, 068. 81

减: 卖出股票成本总额	3, 227, 075, 553. 49
减:交易费用	7, 400, 285. 98
买卖股票差价收入	-336, 923, 770. 66

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	855, 471. 77
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券 到期兑付)差价收入	-9, 957, 379. 79
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	-9, 101, 908. 02

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	172, 030, 912. 37
减:卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	181, 678, 599. 90
减: 应计利息总额	309, 187. 21
减:交易费用	505. 05
买卖债券差价收入	-9, 957, 379. 79

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		8, 161, 414. 29
其中:证券出借权益补偿收		
λ		
基金投资产生的股利收益		
合计		8, 161, 414. 29

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位: 人民币元

	E. /(t/d/l-/)
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	-164, 916, 031. 56
股票投资	-151, 233, 197. 41
债券投资	-13, 682, 834. 15
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	-164, 916, 031. 56

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	160, 728. 27
基金转换费收入	1, 667. 70
合计	162, 395. 97

6.4.7.22 信用减值损失

注: 本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位: 人民币元

项目	本期				
以 日	2022年1月1日至2022年6月30日				
审计费用	27, 273. 08				
信息披露费	59, 507. 37				

证券出借违约金	-
银行费用	240.00
账户维护费用	18, 000. 00
其他费用	600.00
合计	105, 620. 45

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,本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日,本基金无须做披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

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

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股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

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债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注: 本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

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

	本期	上年度可比期间		
项目	2022年1月1日至2022年6	2021年1月1日至2021年		
	月 30 日	6月30日		
当期发生的基金应支付的管理费	19, 173, 889. 89	21, 950, 150. 76		
其中:支付销售机构的客户维护费	4, 840, 002. 87	5, 641, 244. 62		

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:每日应计提的基金管理费=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

	本期	上年度可比期间		
项目	2022年1月1日至2022年6	2021年1月1日至2021年		
	月 30 日	6月30日		
当期发生的基金应支付的托管费	3, 195, 648. 27	3, 658, 358. 40		

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。

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。

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。

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

	本期	上年度可比期间		
项目	2022年1月1日至2022年6	2021年1月1日至2021		
	月 30 日	年 6 月 30 日		
基金合同生效日(2009年3月 25日)持有的基金份额	I	_		
报告期初持有的基金份额	4, 151, 718. 98	4, 151, 718. 98		
报告期间申购/买入总份额	3, 548, 463. 41	-		
报告期间因拆分变动份额	1	-		
减:报告期间赎回/卖出总份		_		
额				
报告期末持有的基金份额	7, 700, 182. 39	4, 151, 718. 98		
报告期末持有的基金份额	1. 1533%	0. 6263%		
占基金总份额比例	1. 1000 <i>n</i>	0.0203//		

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

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注:本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未持有本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

关联方名称		·期 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	263, 853, 192. 85	399, 914. 57	218, 587, 189. 19	367, 429. 75	

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期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:本报告内本基金未进行利润分配,符合基金合同的规定。

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

									金额单位:人	.民巾兀
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
301117	佳缘 科技	2022 年1月 7日	6 个月	新股 流通 受限	46. 80	54. 44	262	12, 261. 60	14, 263. 28	_
301120	新特 电气	2022 年4月 11日	6 个月	新股 流通 受限	13. 73	15. 49	1, 032	14, 169. 36	15, 985. 68	_
301153	中科 江南	2022 年5月 10日	6 个月	新股 流通 受限	33. 68	43. 98	398	13, 404. 64	17, 504. 04	_
301181	标榜 股份	2022 年2月 11日	6 个月	新股 流通 受限	40. 25	30. 59	257	10, 344. 25	7, 861. 63	-
301200	大族 数控	2022 年2月 18日	6 个月	新股 流通 受限	76. 56	51. 92	857	65, 611. 92	44, 495. 44	_
301207	华兰 疫苗	2022 年2月 10日	6 个月	新股 流通 受限	56. 88	56. 42	569	32, 364. 72	32, 102. 98	-
301212	联盛 化学	2022 年4月 7日	6 个月	新股 流通 受限	29. 67	33. 28	416	12, 342. 72	13, 844. 48	_
301215	中汽 股份	2022 年2月 28日	6 个月	新股 流通 受限	3. 80	6. 39	4, 743	18, 023. 40	30, 307. 77	_
301256	华融 化学	2022 年3月 14日	6 个月	新股 流通 受限	8. 05	10. 08	1, 831	14, 739. 55	18, 456. 48	_
301259	艾布 鲁	2022 年4月 18日	6 个月	新股 流通 受限	18. 39	24. 94	483	8, 882. 37	12, 046. 02	_
301286	侨源 股份	2022 年6月 6日	6 个月	新股 流通 受限	16. 91	19. 79	784	13, 257. 44	15, 515. 36	-
301288	清研环境	2022 年4月 14日	6 个月	新股 流通 受限	19. 09	19. 98	452	8, 628. 68	9, 030. 96	_

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	_
603713	密尔克卫	2022 年 5 月 24 日	6 个月	大交购流受宗易入通限	109. 67	129. 10	150, 000	16, 450, 500. 00	19, 365, 000. 00	-
688209	英集 芯	2022 年4月 12日	6 个月	新股 流通 受限	24. 23	27. 58	6, 822	165, 297. 06	188, 150. 76	1
688237	超卓 航科	2022 年6月 24日	1 个月 内(含)	新股 流通 受限	41. 27	41. 27	2, 891	119, 311. 57	119, 311. 57	_
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	1
688663	新风光	2022 年6月 13日	6个月	大交购流受宗易入通限	29. 82	30. 33	800, 000	23, 856, 000. 00	24, 264, 000. 00	
688663	新风光	2022 年6月 8日	6个月	大交购流受宗易入通限	29. 88	30. 36	800, 000	23, 904, 000. 00	24, 288, 000. 00	
689009	九号 公司	2022 年 6 月 28 日	6 个月	大交购流受宗易入通限	41. 27	40. 86	240, 000	9, 904, 800. 00	9, 806, 400. 00	-
689009	九号 公司	2022 年 6 月 30 日	6 个月	大交购流受宗易入通限	40. 00	40. 86	370, 000	14, 800, 000. 00	15, 118, 200. 00	-

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流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注:本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注:本基金本报告期末无参与因转融通证券出借业务而出借的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

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

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注: 本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位:人民币元

长期信用评级	本期末	上年度末
区为1日/1171 级	2022年6月30日	2021年12月31日
AAA	120, 836, 769. 00	132, 651, 129. 30
AAA 以下	213, 517, 343. 13	303, 904, 965. 30
未评级	-	-

合计 334, 354, 112. 13 436, 556, 094. 60

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

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

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

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注:本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注:无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金为开放式基金,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、权证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

30日 第六字 263,853,192 263,853,192 2,754,957.8 27,754,957.8 27,754,957.8 27,754,957.8 27,754,957.8 27,754,957.8 27,754,957.8 27,754,957.8 27,754,957.8 27,754,957.8 27,754,957.8 27,754,957.8 27,754,957.8 27,754,957.8 27,754,957.8 27,754,957.8 27,339.55 27,399.55							1 1-1-	: /\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\
銀行存款 263,853,192 855	2022年6月	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
様存存款	资产							
结算备付金 2,754,957.8 有出保证金 923,343.52 交易性金融 211,904, 122,449,6 资产 415.97 应收申购款 77,339.55 一 935,238.1 应收清算款 ————————————————————————————————————	银行存款		_	_	_	_	_	263, 853, 19
存出保证金 923, 343. 52 - - - 923, 343. 52 - - 923, 343. 52 - - - 923, 343. 32 - 993, 343. 32 - - - 993, 343. 32 - - 993, 343. 32 - - - 994, 23, 33 -<	经管 条付金			_	_	_		2. 85 2, 754, 957.
交易性金融 211,904, 122,449,6 1,999,629 2,333,9 资产 415.97 96.16 ,230.13 34 应收申购款 77,339.55 4,727.03 4,72 应收清算款 4,727.03 4,72 267,608,833 - 211,904, 122,449,6 2,000,569 2,602,9 415.97 96.16 ,195.34 14 负债 415.97 96.16 ,195.34 14 应付赎回款 513,121.6 应付管理人报酬 3,078,729		3						83
资产 415.97 96.16 ,230.13 345 应收申购款 77,339.55 - - 935,238.1 1,012,38 应收清算款 - - - 4,727.03 4,727 资产总计 267,608,833 - 211,904, 122,449,6 2,000,569 2,602,8 应债 415.97 96.16 ,195.34 14 负债 - - 4,904,959 4,904,959 应付管理人 - - - 513,121.6 应付任管费 - - - 513,121.6 应付清算款 - - - - 513,121.6 应交税费 - - - 3,307.45 3,307 应交税费 - - - - 3,307.45 3,307	存出保证金	923, 343. 52	_	_	_	_	_	923, 343. 52
应收申购款 77, 339. 55 - - 935, 238. 1 1, 012, 18 应收清算款 - - 4, 727. 03 4, 72 资产总计 267, 608, 833 - 211, 904, 122, 449, 6 2, 000, 569 2, 602, 3 负债 - 4, 904, 959 4, 904, 959 4, 904, 959 应付赎回款 - - 3, 078, 729 3, 078, 729 应付管理人 - - 513, 121. 6 513, 12 应付托管费 - - - 11, 261, 34 11, 261, 34 应付清算款 - - - 3, 307. 45 3, 30 应交税费 - - - 3, 307. 45 3, 30 2, 269, 994 2, 269, 994 2, 269, 994 2, 269, 994 2, 269, 994		_	_	_	211, 904,			
 应收 申	资产				415. 97	96. 16	, 230. 13	342. 26
应收清算款 - - 4,727.03 4,904.93 <td< td=""><td>应收电购款</td><td>77 330 55</td><td>_</td><td>_</td><td></td><td></td><td>935, 238. 1</td><td>1, 012, 577.</td></td<>	应收电购款	77 330 55	_	_			935, 238. 1	1, 012, 577.
资产总计 267, 608, 833 - - 211, 904, 122, 449, 6 2, 000, 569 2, 602, 9 96. 16 , 195. 34 14 负债 - - - 4, 904, 959 4, 904, 9 14, 904, 9 14, 904, 9 15, 151 应付赎回款 - - - 3, 078, 729 3, 078, 7 15, 121. 6 15, 12	四水中州赤	11, 555. 55					8	73
気产息け .75 - 415.97 96.16 , 195.34 14 负债 - - 4, 904, 959 4, 904, 959 4, 904, 959 4, 904, 959 4, 904, 959 4, 904, 959 3, 078, 729 3, 078, 729 3, 078, 729 3, 078, 729 3, 12 513, 121.6 513, 121.6 3 513, 12 9. 33 2, 269, 994	应收清算款	_	_	_	_	_	4, 727. 03	4, 727. 03
.75 415.97 96.16 , 195.34 14 负债 4, 904, 959 4, 904, 959 4, 904, 959 4, 904, 959 4, 904, 959 4, 904, 959 4, 904, 959 4, 904, 959 513, 078, 729 3, 078, 729 3, 078, 729 3, 078, 729 3, 12 513, 121.6 513, 121.6 513, 12 513, 12 9. 33 3 9. 33 11, 261, 34 11, 261, 34 11, 261, 34 9. 33 11, 261, 34 11, 261, 34 11, 261, 34 12, 269, 994, 2, 269,	次 立 占 计	267, 608, 833	_	_	211, 904,	122, 449, 6	2, 000, 569	2, 602, 532,
应付赎回款 - - 4,904,959 4,904,959 5,51 应付管理人报酬 - - 3,078,729 3,078,729 3,078,76 应付托管费 - - - 513,121.6 513,12 应付清算款 - - - 11,261,34 11,261,93 3,307 应交税费 - - - 3,307.45 3,307 2,269,994 2,269,994 2,269,994	贝 心口	. 75			415. 97	96. 16	, 195. 34	141. 22
 一	负债							
应付管理人 3,078,729	应付時同款	_	_	_	_	_	4, 904, 959	4, 904, 959.
报酬	四门然四城						. 51	51
应付托管费 - - - 513, 121. 6 3 513, 12 应付清算款 - - - 11, 261, 34 9. 33 11, 261 9. 33 应交税费 - - - 3, 307. 45 2, 269, 994, 2, 269	应付管理人	_	_	_			3, 078, 729	3, 078, 729.
应付托管费□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□□	报酬						. 76	76
	应付托管费	_	_	_	_	_	513, 121. 6	513, 121. 63
							11 261 34	11 261 349
应交税费 3,307.45 3,30° 2 269 994 2 269 9	应付清算款	_	_	_	_	_		
2 269 994 2 269	应交税费	_	_	_	_	_		
1月 棚 句 信	++ / /2 /=:							
. 20	其他负债	_	_	_	_	_		
负债总计 22,031,46 22,031, 1.88	负债总计	_	_	_	_	_		

利率敏感度	267, 608, 833			211, 904,	122, 449, 6	1, 978, 537	2, 580, 500,
缺口	. 75	_	_	415. 97		, 733. 46	
上年度末							
2021年12月	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
31 日							
资产							
相写方势	216, 396, 338						216, 396, 33
银行存款	. 15				-		8. 15
结算备付金	4, 843, 956. 8	_	_			_	4, 843, 956.
和开田门立	5						85
存出保证金	809, 860. 77	_	_	_	_	_	809, 860. 77
交易性金融	_	_	_	343, 994,			2, 818, 659,
资产				139.00	5. 60	, 952. 45	047. 05
应收申购款	18, 838. 10	_	_	_	_	2, 255, 609	2, 274, 447.
/	10, 000. 10					. 03	13
其他资产	_	_	_	_	_	760, 866. 2 0	760, 866. 20
次立丛口	222, 068, 993			343, 994,	92, 561, 95	2, 385, 119	3, 043, 744,
资产总计	. 87	_	_	139.00	5. 60	, 427. 68	516. 15
负债							
应付赎回款		_				4, 776, 404	4, 776, 404.
四门烬凹冰						. 77	77
应付管理人	_	_	_			3, 785, 302	3, 785, 302.
报酬						. 31	31
应付托管费	_	_	_	_	_	630, 883. 7 1	630, 883. 71
应付证券清						10, 321, 92	10, 321, 925
算款	_	_	_	_	_	5. 23	
应交税费	_	_	_	_	_	4, 026. 66	
世 加 左 /=							2, 134, 158.
其他负债	_	_	_	_	_	. 52	52
名 建						21, 652, 70	21, 652, 701
负债总计	_	_	_	_	_	1. 20	. 20
利率敏感度	222, 068, 993			343, 994,	92, 561, 95	2, 363, 466	3, 022, 091,
缺口	. 87	_	_	139. 00	5. 60	, 726. 48	814. 95

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注: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,为交易而持有的债权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

本基金的所有资产及负债以人民币计价,因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金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

	本其	阴末	上年度末		
项目	2022年6	5月30日	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 一股票投资	1, 999, 629, 230. 13	77. 49	2, 382, 102, 952. 45	78. 82	
交易性金融资产 -基金投资		_	_	_	
交易性金融资产 一债券投资	334, 354, 112. 13	12. 96	436, 556, 094. 60	14. 45	
交易性金融资产 一贵金属投资		l	l	-	
衍生金融资产— 权证投资	_	_	_	_	
其他	_	_	_	-	
合计	2, 333, 983, 342. 26	90. 45	2, 818, 659, 047. 05	93. 27	

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

	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(CA描述的规律进行变动						
假设	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 对资产负债表日基金资产净值的 影响金额(单位:人民币元)						
	动	本期末 (2022年6月30日) 上年度末 (2021年12月					

			31 日)
V/ TL.	业绩比较基准+10%	452, 007, 829. 60	333, 106, 890. 39
分析	业绩比较基准-10%	-452, 007, 829. 60	-333, 106, 890. 39

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	2, 238, 983, 038. 14	2, 710, 159, 398. 34
第二层次	406, 835. 80	5, 504. 49
第三层次	94, 593, 468. 32	108, 494, 144. 22
合计	2, 333, 983, 342. 26	2, 818, 659, 047. 05

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

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位: 人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1, 999, 629, 230. 13	76. 83
	其中: 股票	1, 999, 629, 230. 13	76. 83
2	基金投资	_	_
3	固定收益投资	334, 354, 112. 13	12. 85
	其中:债券	334, 354, 112. 13	12. 85
	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	266, 608, 150. 68	10. 24
8	其他各项资产	1, 940, 648. 28	0. 07
9	合计	2, 602, 532, 141. 22	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

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	_	_
В	采矿业	193, 813, 507. 10	7. 51

С	制造业	1, 147, 702, 504. 48	44. 48
D	电力、热力、燃气及水生产和		
	供应业	38, 416. 00	0.00
Е	建筑业	32, 153, 000. 00	1. 25
F	批发和零售业	40, 024, 191. 65	1. 55
G	交通运输、仓储和邮政业	350, 078, 097. 45	13. 57
Н	住宿和餐饮业	80, 076, 040. 10	3. 10
Ι	信息传输、软件和信息技术服		
	务业	63, 019, 145. 20	2. 44
J	金融业	_	_
K	房地产业	_	-
L	租赁和商务服务业	92, 681, 974. 36	3. 59
M	科学研究和技术服务业	30, 307. 77	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	12, 046. 02	0.00
0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
Р	教育		_
Q	卫生和社会工作		
R	文化、体育和娱乐业	-	_
S	综合	-	_
	合计	1, 999, 629, 230. 13	77. 49

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

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	601111	中国国航	16, 509, 755	191, 678, 255. 55	7. 43
2	002028	思源电气	4, 892, 692	174, 473, 396. 72	6. 76
3	002960	青鸟消防	5, 153, 994	141, 167, 895. 66	5. 47
4	300316	晶盛机电	1, 560, 000	105, 440, 400. 00	4. 09
5	601012	隆基绿能	1, 399, 880	93, 274, 004. 40	3. 61
6	300662	科锐国际	1, 786, 124	92, 681, 974. 36	3. 59
7	600938	中国海油	5, 219, 890	90, 953, 514. 14	3. 52
8	300286	安科瑞	3, 206, 852	87, 066, 031. 80	3. 37
9	600096	云天化	2, 631, 897	82, 852, 117. 56	3. 21
10	600754	锦江酒店	1, 273, 069	80, 076, 040. 10	3. 10
11	688663	新风光	2, 121, 901	66, 280, 976. 97	2. 57
12	603713	密尔克卫	466, 704	62, 658, 436. 80	2. 43
13	603606	东方电缆	799, 892	61, 271, 727. 20	2. 37
14	601088	中国神华	1, 771, 790	59, 000, 607. 00	2. 29
15	002920	德赛西威	379, 903	56, 225, 644. 00	2. 18

16	601021	春秋航空	929, 906	54, 260, 015. 10	2. 10
17	002851	麦格米特	1, 874, 669	49, 228, 807. 94	1.91
18	301162	国能日新	756, 112	46, 304, 298. 88	1.79
19	601699	潞安环能	2, 999, 958	43, 859, 385. 96	1.70
20	000683	远兴能源	4, 163, 518	43, 758, 574. 18	1.70
21	002182	云海金属	1, 700, 000	42, 636, 000. 00	1.65
22	300223	北京君正	400,000	42, 500, 000. 00	1. 65
23	002120	韵达股份	2, 431, 500	41, 481, 390. 00	1.61
24	300892	品渥食品	1, 336, 367	40, 024, 191. 65	1. 55
25	002060	粤水电	3, 700, 000	32, 153, 000. 00	1. 25
26	600690	海尔智家	1, 074, 381	29, 502, 502. 26	1. 14
27	689009	九号公司	610,000	24, 924, 600. 00	0. 97
28	002384	东山精密	1,000,000	22, 930, 000. 00	0.89
29	300769	德方纳米	50, 183	20, 508, 788. 44	0. 79
30	688099	晶晨股份	165, 179	16, 683, 079. 00	0. 65
31	300395	菲利华	35, 550	1, 599, 750. 00	0.06
32	002036	联创电子	78, 690	1, 208, 678. 40	0.05
33	688400	凌云光	13, 111	287, 524. 23	0.01
34	688209	英集芯	6, 822	188, 150. 76	0. 01
35	688237	超卓航科	2, 891	119, 311. 57	0.00
36	300888	稳健医疗	1,000	66, 500. 00	0.00
37	301200	大族数控	857	44, 495. 44	0.00
38	601985	中国核电	5, 600	38, 416. 00	0.00
39	301207	华兰疫苗	569	32, 102. 98	0.00
40	301215	中汽股份	4, 743	30, 307. 77	0.00
41	001323	慕思股份	573	28, 111. 38	0.00
42	301256	华融化学	1,831	18, 456. 48	0.00
43	301153	中科江南	398	17, 504. 04	0.00
44	301120	新特电气	1,032	15, 985. 68	0.00
45	301286	侨源股份	784	15, 515. 36	0.00
46	301117	佳缘科技	262	14, 263. 28	0.00
47	301212	联盛化学	416	13, 844. 48	0.00
48	301259	艾布鲁	483	12, 046. 02	0.00
49	301288	清研环境	452	9, 030. 96	0.00
50	301181	标榜股份	257	7, 861. 63	0.00
51	600031	三一重工	300	5, 718. 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

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	601111	中国国航	265, 062, 968. 27	8. 77

2	688663	新风光	152, 960, 160. 72	5. 06
3	300861	美畅股份	140, 911, 042. 98	4. 66
4	600096	云天化	139, 486, 421. 85	4. 62
5	601088	中国神华	115, 531, 716. 20	3. 82
6	600938	中国海油	115, 320, 529. 51	3. 82
7	000683	远兴能源	115, 084, 691. 66	3. 81
8	002475	立讯精密	110, 034, 977. 11	3.64
9	300316	晶盛机电	97, 204, 609. 06	3. 22
10	600048	保利发展	96, 276, 854. 40	3. 19
11	601012	隆基绿能	90, 245, 789. 86	2. 99
12	002120	韵达股份	89, 460, 485. 23	2. 96
13	300769	德方纳米	87, 305, 651. 24	2.89
14	000002	万科 A	86, 192, 251. 71	2.85
15	601600	中国铝业	85, 102, 592. 68	2.82
16	002182	云海金属	81, 113, 295. 51	2. 68
17	603713	密尔克卫	75, 466, 810. 71	2. 50
18	002960	青鸟消防	64, 991, 616. 80	2. 15
19	002028	思源电气	61, 734, 147. 14	2. 04
20	600754	锦江酒店	61, 249, 042. 00	2. 03

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

\. H	N			亚欧干区: 八八市八
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	601111	中国国航	190, 991, 478. 68	6. 32
2	300861	美畅股份	164, 305, 227. 28	5. 44
3	600406	国电南瑞	108, 546, 625. 96	3. 59
4	002960	青鸟消防	91, 844, 260. 49	3. 04
5	688663	新风光	91, 785, 298. 98	3. 04
6	002475	立讯精密	84, 595, 917. 94	2.80
7	002920	德赛西威	84, 305, 837. 71	2. 79
8	601088	中国神华	83, 648, 280. 56	2.77
9	600048	保利发展	82, 978, 350. 18	2.75
10	601985	中国核电	81, 852, 013. 68	2.71
11	300769	德方纳米	79, 190, 413. 14	2.62
12	000683	远兴能源	78, 709, 449. 00	2.60
13	300253	卫宁健康	77, 802, 934. 70	2. 57
14	000002	万科 A	72, 957, 781. 40	2.41
15	601600	中国铝业	67, 815, 224. 46	2. 24
16	600096	云天化	66, 780, 974. 95	2. 21
17	002182	云海金属	65, 535, 487. 96	2. 17
18	600703	三安光电	60, 297, 404. 20	2.00

19	600754	锦江酒店	59, 888, 937. 00	1. 98
20	601877	正泰电器	54, 505, 041. 48	1.80

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	2, 995, 835, 028. 58
卖出股票收入(成交)总额	2, 897, 552, 068. 81

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位: 人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	_	_
2	央行票据	_	_
3	金融债券	_	_
	其中: 政策性金融债	_	_
4	企业债券	_	_
5	企业短期融资券	_	_
6	中期票据	_	_
7	可转债(可交换债)	334, 354, 112. 13	12. 96
8	同业存单	_	_
9	其他	_	_
10	合计	334, 354, 112. 13	12. 96

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	110075	南航转债	650, 250	90, 929, 053. 79	3. 52
2	110085	通 22 转债	520, 000	81, 798, 949. 04	3. 17
3	110045	海澜转债	506, 660	55, 308, 879. 55	2. 14
4	110081	闻泰转债	330, 000	40, 650, 747. 12	1.58
5	113579	健友转债	189, 020	23, 939, 616. 04	0. 93

- 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	923, 343. 52
2	应收清算款	4, 727. 03
3	应收股利	_
4	应收利息	-
5	应收申购款	1, 012, 577. 73
6	其他应收款	_
7	待摊费用	_
8	其他	_
9	合计	1, 940, 648. 28

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110075	南航转债	90, 929, 053. 79	3. 52
2	110045	海澜转债	55, 308, 879. 55	2. 14
3	110081	闻泰转债	40, 650, 747. 12	1.58
4	113579	健友转债	23, 939, 616. 04	0. 93
5	110079	杭银转债	20, 275, 705. 39	0.79
6	113563	柳药转债	11, 819, 151. 38	0.46
7	113044	大秦转债	9, 632, 009. 82	0.37

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	600938	中国海油	1, 332, 303. 44	0.05	新股流通受限

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

			持有人结构				
持有人户数	户均持有的	机构投	资者	个人投	资者		
(户)	基金份额	持有份额	占总份额比 例(%)	持有份额	占总份额比例 (%)		
240, 901	2, 771. 52	84, 285, 684. 58	12.62	583, 377, 274. 63	87. 38		

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	1, 019, 745. 09	0. 1527

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部 门负责人持有本开放式基金	10 [~] 50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2009年3月25日)	1 000 254 971 25
基金份额总额	1, 980, 254, 871. 35
本报告期期初基金份额总额	649, 496, 706. 16
本报告期基金总申购份额	84, 024, 985. 75
减:本报告期基金总赎回份额	65, 858, 732. 70
本报告期基金拆分变动份额	_
本报告期期末基金份额总额	667, 662, 959. 21

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

		股票	股票交易		应支付该券商的佣金	
券商名称	交易单元 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 (%)	备注
东方财富	2	1, 242, 884, 44 5. 94	21. 14	536, 900. 74	13. 59	_
国信证券	2	1, 121, 277, 63 9. 57	19. 07	708, 555. 19	17. 93	-
华融证券	2	735, 127, 710. 27	12. 51	684, 638. 05	17. 33	-
长江证券	1	539, 352, 642. 81	9. 18	394, 430. 94	9. 98	_

东吴证券	1	515, 445, 923. 35	8.77	325, 402. 05	8. 24	_
海通证券	1	333, 339, 297. 42	5. 67	243, 768. 52	6. 17	_
招商证券	1	326, 749, 459. 51	5. 56	304, 302. 98	7. 70	_
申万宏源 证券	1	289, 457, 737. 21	4. 92	211, 681. 72	5. 36	_
安信证券	2	258, 586, 295. 55	4. 40	163, 246. 64	4. 13	_
中泰证券	1	184, 989, 059. 41	3. 15	135, 277. 46	3. 42	_
华泰证券	1	181, 017, 771. 05	3. 08	132, 617. 82	3. 36	_
东方证券	1	150, 230, 165. 44	2. 56	109, 863. 52	2.78	
渤海证券	1	_	-	-		_
长城证券	1	_	_	_	_	_
德邦证券	1	_	-	-	_	_
第一创业 证券	1	-	-	-	-	_
湘财证券	2	_	-	-	_	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	_	_	_	_	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。

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

	债券交易		债券回购交易		权证交易	
券商名称		占当期债券		占当期债券回		占当期权证
25 HJ 111/15	成交金额	成交总额的	成交金额	购成交总额的	成交金额	成交总额的
		比例(%)		比例(%)		比例(%)
东方财富	112, 246, 416.	42. 65	_	_	_	_
小刀网田	60	42.00				
国信证券	65, 943, 780. 9	25. 06	_	_	_	_
四旧ய分	0	20.00				
华融证券	13, 215, 538. 1	5. 02	_	_	_	_
一四7 (正分).	7	0.02				
长江证券	_	_	_	_	_	_
东吴证券	_	_	_	_	-	_
海通证券	32, 163, 834. 6	12. 22	_	_	_	_

	0					
招商证券	1, 661, 255. 70	0.63		_	_	_
申万宏源 证券	_	_	_	_	_	_
安信证券	37, 929, 026. 8 0	14. 41	_	_	_	_
中泰证券	_	_	_	_	_	_
华泰证券	_	_	_	-	_	_
东方证券	_	_	_	_	_	_
渤海证券	_	_	_	_	_	-
长城证券	_	_	_	_	_	_
德邦证券	_	_	_	-	_	_
第一创业 证券	_	_	_	-	-	_
湘财证券	_	_	_	_	_	_
信达证券	_	_	-	-	-	_
兴业证券	_	_	_			

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	关于使用固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	2022-06-30

	→ 、 	
	Y"1 24	

§ 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

		报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情 况	
投资 者类 别	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	ı	_		-	_	_	_
个人	_	_		_	_	_	_
			ī	^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、《兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书》
- 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