

兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金  
(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：中国农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。

基金托管人中国农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	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	10
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	21
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>51</b>
7.1 期末基金资产组合情况	51
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	51
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	53
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59

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 .....	60
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 .....	60
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 .....	60
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 .....	60
7.10	本基金投资股指期货的投资政策 .....	60
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	60
7.12	投资组合报告附注 .....	60
<b>§ 8</b>	<b>基金份额持有人信息 .....</b>	<b>62</b>
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	62
8.2	期末上市基金前十名持有人 .....	62
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	63
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 .....	63
<b>§ 9</b>	<b>开放式基金份额变动 .....</b>	<b>63</b>
<b>§ 10</b>	<b>重大事件揭示 .....</b>	<b>64</b>
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	64
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 .....	64
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	64
10.4	基金投资策略的改变 .....	64
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	64
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 .....	64
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	64
10.8	其他重大事件 .....	65
<b>§ 11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>66</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 .....	66
11.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	67
<b>§ 12</b>	<b>备查文件目录 .....</b>	<b>67</b>
12.1	备查文件目录 .....	67
12.2	存放地点 .....	67
12.3	查阅方式 .....	67

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)	
基金简称	兴全沪深 300 指数 (LOF)	
场内简称	兴全 300	
基金主代码	163407	
前端交易代码	163407	
后端交易代码	163408	
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)	
基金合同生效日	2010 年 11 月 2 日	
基金管理人	兴证全球基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	2,048,912,621.54 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的 证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2011 年 1 月 19 日	
下属分级基金的基 金简称	兴全沪深 300 指数 (LOF) A	兴全沪深 300 指数 C
下属分级基金的场 内简称	兴全 300	无
下属分级基金的交 易代码	163407	007230
下属分级基金的前 端交易代码	163407	-
下属分级基金的后 端交易代码	163408	-
报告期末下属分级	1,986,454,100.06 份	62,458,521.48 份

基金的份额总额	
---------	--

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

## 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数复制结合相对增强的投资策略，即通过指数复制的方法拟合、跟踪沪深 300 指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的组合管理，谋求基金资产的长期增值。本基金力争日均跟踪误差不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，日均下方跟踪误差不超过 0.3%，年下方跟踪误差不超过 4.75%。
投资策略	本基金采用指数复制结合相对增强的投资策略，即通过指数复制的方法拟合、跟踪沪深 300 指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的组合管理。
业绩比较基准	沪深 300 指数×95%+同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数增强型基金，跟踪标的指数市场表现，追求接近或超越沪深 300 指数所代表的市场平均收益，是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。投资者可在二级市场买卖基金份额，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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨卫东	秦一楠
	联系电话	021-20398888	010-66060069
	电子邮箱	yangwd@xqfunds.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4006780099, 021-38824536	95599
传真		021-20398858	010-68121816
注册地址		上海市黄浦区金陵东路 368 号	北京东城区建国门内大街 69 号
办公地址		上海市浦东新区芳甸路 1155 号嘉里城办公楼 28-29 楼	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		201204	100031
法定代表人		杨华辉	谷澍

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.xqfunds.com">http://www.xqfunds.com</a>
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	A 类份额：中国证券登记结算有限责任公司	A 类份额：北京市西城区太平桥大街 17 号

	C 类份额：兴证全球基金管理有 限公司	C 类份额：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01月01日-2022年06月30日)	
	兴全沪深 300 指数 (LOF) A	兴全沪深 300 指数 C
本期已实现收益	66,332,665.86	1,859,796.47
本期利润	-258,148,720.07	-9,795,805.67
加权平均基金份 额本期利润	-0.1415	-0.1589
本期加权平均净 值利润率	-6.15%	-6.97%
本期基金份额净 值增长率	-6.76%	-6.94%
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	2,695,186,330.61	77,600,217.61
期末可供分配基 金份额利润	1.3568	1.2424
期末基金资产净 值	4,746,080,333.86	147,742,513.14
期末基金份额净 值	2.3892	2.3655
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	138.92%	29.11%

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

兴全沪深 300 指数 (LOF) A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	9.29%	0.95%	9.12%	1.02%	0.17%	-0.07%
过去三个月	6.59%	1.31%	5.93%	1.36%	0.66%	-0.05%
过去六个月	-6.76%	1.40%	-8.72%	1.38%	1.96%	0.02%
过去一年	-10.48%	1.21%	-13.40%	1.18%	2.92%	0.03%
过去三年	22.64%	1.22%	16.71%	1.20%	5.93%	0.02%
自基金合同生效起至今	138.92%	1.34%	29.77%	1.35%	109.15%	-0.01%

兴全沪深 300 指数 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	9.25%	0.95%	9.12%	1.02%	0.13%	-0.07%
过去三个月	6.49%	1.31%	5.93%	1.36%	0.56%	-0.05%
过去六个月	-6.94%	1.40%	-8.72%	1.38%	1.78%	0.02%

过去一年	-10.83%	1.21%	-13.40%	1.18%	2.57%	0.03%
过去三年	21.44%	1.22%	16.71%	1.20%	4.73%	0.02%
自基金合同生效起至今	29.11%	1.21%	23.71%	1.20%	5.40%	0.01%

注：1、本基金为指数增强型证券投资基金，标的指数是沪深 300 指数，本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，按下列公式计算：

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

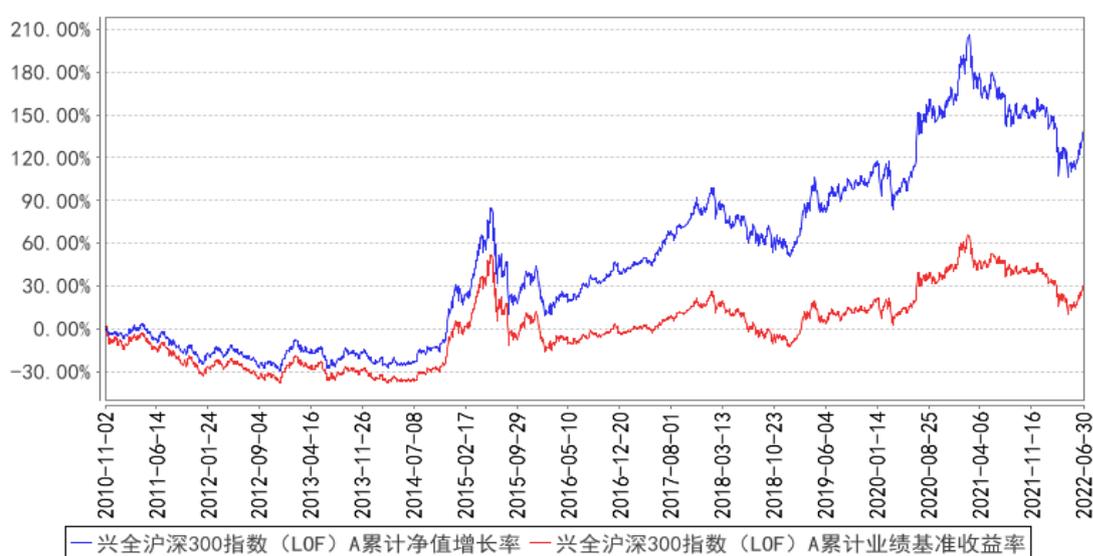
$$\text{Benchmark}_t = (1 + \text{Return}_t) \times (1 + \text{Benchmark}_{t-1}) - 1$$

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

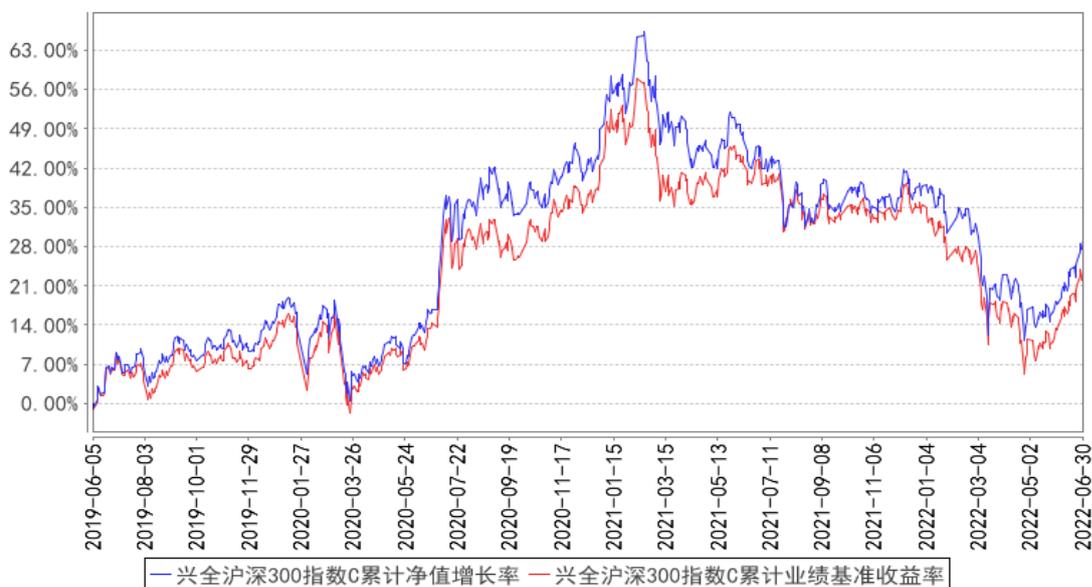
2、经与基金托管人中国农业银行协商一致，并报中国证监会备案，管理人决定自 2019 年 6 月 5 日起增设兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) C 类份额 (代码：007230)。详情请见管理人网站公告。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

兴全沪深300指数 (LOF) A 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



兴全沪深300指数C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、净值表现所取数据截至到 2022 年 6 月 30 日。

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

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

### 3.3 其他指标

注：无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金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		
申庆	兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)、兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金基金经理	2010 年 11 月 2 日	-	25 年	硕士，历任兴业证券研究发展中心研究员，兴证全球基金管理有限公司行业研究员，兴全趋势投资混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理助理、兴全全球视野股票型证券投资基金基金经理、基金管理部总监助理、兴全恒益债券型证券投资基金基金经理。

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、《兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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 A 股市场走出了以 4 月底为分水岭的 V 型走势，前后风格差异较大。年初，在长达三年的慢牛行情后，市场主流观点逐渐走向谨慎，使得某种被高度期待的季节效应并未发生。随后海外地缘事件和国内疫情反复，市场风险偏好急剧下降，成长赛道类资产回撤较大，低估值红利类资产表现出较强的防御性。不过随着疫情缓和、资金面持续宽松以及对冲性政策陆续落地，市场风险偏好重新上升，开始交易复苏逻辑。高景气赛道资产以及中小市值专精特新资产在二季度大部分时候都能跑赢低估值红利类资产。

目前看市场处于相对均衡的存量博弈状态。一方面上半年市场的剧烈波动影响居民风险偏好，使得居民资产再配置的节奏可能受到一定扰动，行为模式上可能更倾向于高抛低吸，市场更难出现正反馈式的单边行情；另一方面目前相对宽松的流动性环境和不断降低的无风险收益率有助于提升权益资产的相对吸引力，风险偏好上升。

在具体操作上，本基金配置在坚持总体行业和风格均衡前提下，更偏向于长期深度价值的组合配置特征以控制下方风险，并在此基础上通过更具性价比的方式对“赛道”类资产进行配置。在相对均衡的环境下，市场上不同投资目标的参与者（绝对收益 vs 相对收益）也很容易交易出偏离合理估值的价格，有助于指数增强策略发掘相对收益交易机会。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末兴全沪深 300 指数 (LOF) A 的基金份额净值为 2.3892 元，本报告期基金份额净值增长率为-6.76%，同期业绩比较基准收益率为-8.72%；截至本报告期末兴全沪深 300 指数

C 的基金份额净值为 2.3655 元, 本报告期基金份额净值增长率为-6.94%, 同期业绩比较基准收益率为-8.72%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年随着海内外不确定性因素不断涌现, 国内政策取向日益多元化, 投资者需要站在更高的视角, 从价值理性的角度思考问题, 而不能冒着过度简化的风险, 仅基于工具理性进行推断。

上半年疫情冲击弱于 2020 年, 体现了经济的韧性, 也为 5 月以来的复苏交易奠定良好基础。展望下半年, 复苏持续性面临不确定性。随着海外衰退预期上升, 货币政策不断收紧, 外需存在走弱的风险, 需要通过扩大内需加以对冲。考虑到地产不确定性较高, 基建有望起到更大的托底作用。

目前市场面临的问题是上市公司盈利短期下行压力和流动性宽松下市场风险偏好上升之间的矛盾。虽然从宏观数据看, 本轮疫情对经济的冲击弱于 2020 年初, 复苏也更早启动, 但从规模以上工业企业盈利看, 仍会对二季度上市公司盈利产生一定负面影响。处于转型期的传统经济引擎面临的挑战, 也将给相关产业链下半年的盈利带来不确定性。在其他因素保持平稳的假设下, 市场表现将取决于盈利预期和风险偏好之间的消长。从居民财富配置的角度看, 虽然市场波动对其入市节奏有所扰动, 但我们相信随着经济复苏, 居民资产再配置仍将是长期的趋势, 有望给市场带来长期稳定资金。

我们坚持之前的判断, 历史上任何时期的情绪化高估值品种都会向合理水平回归。从近年来的观察看, 选股范式如走马灯一般频繁更换, 有效因子经历了从价值、质量到景气度的转变。下一阶段的市场选股范式会发生何种变化, 我们无法预判, 但“变化”本身是确定的, 一旦市场出现某些简单有效的选股因子, 往往也意味着某类风格走向极致, 本身就意味着风险的集聚。

#### 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》、《兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》及其他相关法律法规的规定，本报告期内，本基金未实施利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

#### 4.8 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人——兴证全球基金管理有限公司 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，兴证全球基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（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	124,258.92	10,118,006.07
结算备付金		8,080,940.76	6,694,211.62
存出保证金		174,742.78	103,630.16
交易性金融资产	6.4.7.2	5,096,154,365.36	4,812,198,852.24
其中：股票投资		4,654,580,154.29	4,379,185,139.40
基金投资		-	-
债券投资		441,574,211.07	433,013,712.84
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		10,492,156.83	15,327,355.12
应收股利		-	-
应收申购款		6,027,568.85	6,601,872.40
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	4,585,385.93
资产总计		5,121,054,033.50	4,855,629,313.54
<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		205,874,822.89	228,093,047.42
应付清算款		-	-
应付赎回款		16,680,669.23	28,206,989.28
应付管理人报酬		3,018,811.37	3,178,636.84
应付托管费		566,027.16	595,994.40
应付销售服务费		46,466.52	50,014.24
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,556.48	2,011.25

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,042,832.85	842,132.30
负债合计		227,231,186.50	260,968,825.73
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	2,048,912,621.54	1,793,592,941.08
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	2,844,910,225.46	2,801,067,546.73
净资产合计		4,893,822,847.00	4,594,660,487.81
负债和净资产总计		5,121,054,033.50	4,855,629,313.54

注：1、报告截止日 2022 年 06 月 30 日，兴全沪深 300 指数 (LOF) A 基金份额净值 2.3892 元，基金份额总额 1,986,454,100.06 份；兴全沪深 300 指数 C 基金份额净值 2.3655 元，基金份额总额 62,458,521.48 份。兴全沪深 300 指数 (LOF) 份额总额合计为 2,048,912,621.54 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：兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (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>		-244,312,664.77	-81,372,615.40
1. 利息收入		89,906.45	4,158,827.73
其中：存款利息收入	6.4.7.13	88,017.28	100,984.61
债券利息收入		-	4,020,408.74
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,889.17	37,434.38
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		91,172,889.35	200,746,526.14
其中：股票投资收益	6.4.7.14	18,898,321.20	153,840,124.84
基金投资收益		-	-

债券投资收益	6.4.7.15	16,625,022.73	-6,183,401.26
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
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	55,649,545.42	53,089,802.56
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	-336,136,988.07	-289,172,881.23
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	561,527.50	2,894,911.96
<b>减：二、营业总支出</b>		23,631,860.97	30,091,830.73
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	17,206,907.42	20,961,142.51
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,226,295.21	3,930,214.27
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	278,934.97	280,419.82
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		2,455,728.53	2,632,481.40
其中：卖出回购金融资产支 出		2,455,728.53	2,632,481.40
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		1,431.27	1,852.55
8. 其他费用	6.4.7.23	462,563.57	2,285,720.18
<b>三、利润总额 (亏损总额以 “-”号填列)</b>		-267,944,525.74	-111,464,446.13
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润 (净亏损以“-” 号填列)</b>		-267,944,525.74	-111,464,446.13
<b>五、其他综合收益的税后净 额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-267,944,525.74	-111,464,446.13

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：兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (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)	1,793,592,941.08	-	2,801,067,546.73	4,594,660,487.81
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期初净资产(基金净值)	1,793,592,941.08	-	2,801,067,546.73	4,594,660,487.81
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	255,319,680.46	-	43,842,678.73	299,162,359.19
(一)、综合收益总额	-	-	-267,944,525.74	-267,944,525.74
(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)	255,319,680.46	-	311,787,204.47	567,106,884.93
其中:1.基金申购款	526,865,979.28	-	663,026,844.45	1,189,892,823.73
2.基金赎回款	-271,546,298.82	-	-351,239,639.98	-622,785,938.80

(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 资产(基 金净值)	2,048,912,621.54	-	2,844,910,225.46	4,893,822,847.00
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)	2,038,634,951.85	-	3,539,791,372.53	5,578,426,324.38
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)	2,038,634,951.85	-	3,539,791,372.53	5,578,426,324.38
三、本期 增减变 动额(减 少以“-” 号填列)	-107,615,933.37	-	-318,162,254.95	-425,778,188.32

(一)、综合收益总额	-	-	-111,464,446.13	-111,464,446.13
(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)	-107,615,933.37	-	-206,697,808.82	-314,313,742.19
其中:1.基金申购款	794,880,363.37	-	1,418,020,441.84	2,212,900,805.21
2.基金赎回款	-902,496,296.74	-	-1,624,718,250.66	-2,527,214,547.40
(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、本期期末净资产(基金净值)	1,931,019,018.48	-	3,221,629,117.58	5,152,648,136.06

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:

杨华辉

庄园芳

詹鸿飞

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) (原名兴业沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)) (以下简称“本基金”), 系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2010]1068 号《关于核准兴业沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 募集的批复》的核准, 由兴全基金管理有限公司作为管理人向社会公开发行募集, 基金合同于 2010 年 11 月 2 日正式生效, 首次设立募集规模为 2,955,476,122.49 份基金份额。本基金为契约型上市开放式, 存续期限不定。本基金的基金管理人为兴全基金管理有限公司, 注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司, 基金托管人为中国农业银行股份有限公司。本基金于 2011 年 1 月 1 日起更名为兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)。自 2019 年 6 月 5 日起增设兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) C 类份额, 仅 A 类份额上市交易。

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

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

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

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制, 同时, 在信息披露和估值方面, 也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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

证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 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

本基金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不一致。

#### 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

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(统称“新金融工具准则”)相关规定，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》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。本基金在编制本中期财务报表时已采用该准则，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初基金净值，2021 年的比较数据将不作重述。

##### 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债)，并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、其他金融负债。

##### 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，

相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

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

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负

债), 按照公允价值进行后续计量, 所有公允价值变动均计入当期损益。对于其他金融负债, 采用实际利率法, 按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满, 则对金融负债进行终止确认。

#### 收入/(损失)的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用, 计入投资收益;

债券投资和资产支持证券投资持有期间, 按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益, 在证券实际持有期内逐日计提;

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认, 并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账, 同时转出已确认的公允价值变动收益;

(3) 股利收益于除息日确认, 并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账;

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认, 并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账, 同时转出已确认的公允价值变动收益;

(5) 买入返售金融资产收入, 按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时, 也可以用合同利率), 在回购期内逐日计提;

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;

(7) 其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务, 即在客户取得服务控制权时确认收入。于首次执行日, 本基金因执行新金融工具准则调减期初基金净值人民币 0 元。

本基金执行新金融工具准则的影响如下:

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、卖出回购金融资产款、应付利息、应付交易费用和其他负债, 金额分别为人民币 10,118,006.07 元、人民币 6,694,211.62 元、人民币 103,630.16 元、人民币 4,585,385.93 元、人民币 228,093,047.42 元、人民币 93,996.12 元、人民币 361,266.03 元和人民币 386,870.15 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金、买

入返售金融资产、其他资产-应收利息、卖出回购金融资产款和其他负债-应付利息。本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、和卖出回购金融资产款等项目中，不单独列示应收利息项目或应付利息项目。新金融工具准则下，银行存款、结算备付金、存出保证金、卖出回购金融资产款和其他负债的金额分别为人民币 10,118,680.74 元、人民币 6,697,525.26 元、人民币 103,681.53 元、人民币 228,187,043.54 元和人民币 748,136.18 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产，金额为人民币 4,812,198,852.24 元，归属于交易性金融资产的应收利息金额为人民币 4,581,346.25 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产，金额为人民币 4,816,780,198.49 元。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金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

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

##### 6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券(股票)交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

##### 6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，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试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

#### 6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例(2011 年修订)》、《征收教育费附加的暂行规定(2011 年修订)》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加(除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外)及地方教育费附加。

#### 6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。对基金通过港股通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 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	124,258.92
等于：本金	123,875.94
加：应计利息	382.98
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	124,258.92

#### 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	3,968,518,361.63	-	4,654,580,154.29	686,061,792.66	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	172,508,550.59	766,600.21	197,350,942.57	24,075,791.77
	银行间市场	240,740,480.00	3,683,268.50	244,223,268.50	-200,480.00
	合计	413,249,030.59	4,449,868.71	441,574,211.07	23,875,311.77
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	4,381,767,392.22	4,449,868.71	5,096,154,365.36	709,937,104.43	

#### 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：无。

##### 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：无。

**6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况**

注：无。

**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	43,238.09
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	377,114.89

其中：交易所市场	368,885.65
银行间市场	8,229.24
应付利息	-
预提信息披露费	59,507.37
应付指数使用费	535,203.48
预提审计费	27,769.02
合计	1,042,832.85

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

##### 兴全沪深 300 指数 (LOF) A

项目	本期 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	1,735,651,859.03	1,735,651,859.03
本期申购	504,024,798.69	504,024,798.69
本期赎回 (以“-”号填列)	-253,222,557.66	-253,222,557.66
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	1,986,454,100.06	1,986,454,100.06

##### 兴全沪深 300 指数 C

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	57,941,082.05	57,941,082.05
本期申购	22,841,180.59	22,841,180.59
本期赎回 (以“-”号填列)	-18,323,741.16	-18,323,741.16
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	62,458,521.48	62,458,521.48

注：1、申购含红利再投资、转入转换份额，赎回含转换转出份额。

2、自 2019 年 6 月 5 日起增设兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) C 类份额。

#### 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

## 兴全沪深 300 指数 (LOF) A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	2,295,630,159.69	416,097,491.07	2,711,727,650.76
本期利润	66,332,665.86	-324,481,385.93	-258,148,720.07
本期基金份额交易产生的变动数	333,223,505.06	-27,176,201.95	306,047,303.11
其中：基金申购款	669,365,125.52	-35,328,492.51	634,036,633.01
基金赎回款	-336,141,620.46	8,152,290.56	-327,989,329.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,695,186,330.61	64,439,903.19	2,759,626,233.80

## 兴全沪深 300 指数 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	70,290,837.08	19,049,058.89	89,339,895.97
本期利润	1,859,796.47	-11,655,602.14	-9,795,805.67
本期基金份额交易产生的变动数	5,449,584.06	290,317.30	5,739,901.36
其中：基金申购款	27,736,957.09	1,253,254.35	28,990,211.44
基金赎回款	-22,287,373.03	-962,937.05	-23,250,310.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	77,600,217.61	7,683,774.05	85,283,991.66

注：自 2019 年 6 月 5 日起增设兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) C 类份额。

## 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	21,602.95
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	64,128.21
其他	2,286.12
合计	88,017.28

## 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	18,898,321.20
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	18,898,321.20
----	---------------

#### 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	129,477,180.78
减：卖出股票成本总额	109,790,633.76
减：交易费用	788,225.82
买卖股票差价收入	18,898,321.20

#### 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	3,708,584.05
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	12,916,438.68
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	16,625,022.73

##### 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	210,390,611.04
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	193,430,100.05
减：应计利息总额	4,038,559.67
减：交易费用	5,512.64
买卖债券差价收入	12,916,438.68

##### 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	55,649,545.42
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	55,649,545.42

## 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	-336,136,988.07
股票投资	-322,547,740.76
债券投资	-13,589,247.31
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	-336,136,988.07

## 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	559,421.05
基金转换费收入	2,106.45
合计	561,527.50

## 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	27,769.02
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	12,548.95
账户维护费用	18,600.00
指数使用费	344,138.23
合计	462,563.57

## 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，本基金无需要在财务报表辅助中说明的重大或有事项。

## 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，本基金无需要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
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
兴证全球基金管理有限公司（“兴证全球基金”）	基金管理人、基金销售机构、本基金 C 类份额注册登记机构
兴业证券股份有限公司（“兴业证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

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	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

	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	730,721,549.28	100.00	1,087,876,555.40	100.00

#### 6.4.10.1.2 债券交易

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	占当期债券 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
兴业证券	40,771,513.94	100.00	69,043,234.37	100.00

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
兴业证券	8,388,057,000.00	100.00	9,350,091,000.00	100.00

#### 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

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	534,724.44	100.00	368,885.65	100.00
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	796,583.35	100.00	203,137.37	100.00

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

## 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	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
当期发生的基金应支付的管理费	17,206,907.42	20,961,142.51
其中：支付销售机构的客户维护费	5,642,876.69	5,917,455.60

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.8% 的年费率计提。计算方法如下：每日应支付的基金管理费=前一日的基金资产净值×0.8%/当年天数。

## 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	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
当期发生的基金应支付的托管费	3,226,295.21	3,930,214.27

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：每日应支付的基金托管费=前一日的基金资产净值×0.15%/当年天数。

## 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴全沪深 300 指数 (LOF) A	兴全沪深 300 指数 C	合计
兴业证券	-	145.84	145.84
兴证全球基金	-	19,112.41	19,112.41
合计	-	19,258.25	19,258.25
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴全沪深 300 指数 (LOF) A	兴全沪深 300 指数 C	合计
兴证全球基金	-	18,969.76	18,969.76
合计	-	18,969.76	18,969.76

注：自 2019 年 6 月 5 日起增设兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) C 类份额。基金销

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

#### 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自有资金投资本基金的情况

注：本报告期内及上年度可比期间基金管理人均未运用自有资金投资本基金。

##### 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及上年度可比期间均未持有本基金。

#### 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	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
农业银行	124,258.92	21,602.95	3,374,555.44	23,377.30

注：本基金的银行存款由基金托管人农业银行保管，按银行同业利率计息。

#### 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

本基金报告内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

## 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
002555	三七互娱	2022年1月14日	6个月	大宗交易购入流通受限	25.32	20.93	400,000	10,128,000.00	8,372,000.00	-
002730	电光科技	2022年1月18日	6个月	非公开发行流通受限	9.51	8.37	315,457	2,999,996.07	2,640,375.09	-
300353	东土科技	2022年1月14日	6个月	非公开发行流通受限	7.90	8.74	632,911	4,999,996.90	5,531,642.14	-
300383	光环新网	2021年12月29日	6个月	非公开发行流通受限	11.79	10.42	424,088	4,999,997.52	4,418,996.96	-
300506	名家汇	2021年12月28日	6个月以上	非公开发行流通受限	6.30	6.77	793,651	5,000,001.30	5,373,017.27	-
300511	雪榕生物	2022年3月18日	6个月	非公开发行流通受限	6.06	6.31	1,023,102	6,199,998.12	6,455,773.62	-
300647	超频	2022	6个月	非公	7.49	10.27	801,068	5,999,999.32	8,226,968.36	-

	三	年6月 29日		开发 行流 通受 限							
300674	宇信 科技	2022 年2月 7日	6个月	非公 开发 行流 通受 限	22.10	15.27	90,498	2,000,005.80	1,381,904.46	-	
300695	兆丰 股份	2022 年1月 24日	6个月	非公 开发 行流 通受 限	54.09	51.43	55,463	2,999,993.67	2,852,462.09	-	
300834	星辉 环材	2022 年1月 6日	6个月	新股 流通 受限	55.57	30.03	635	35,286.95	19,069.05	-	
301102	兆讯 传媒	2022 年3月 15日	6个月	新股 流通 受限	39.88	31.09	642	25,602.96	19,959.78	-	
301103	何氏 眼科	2022 年3月 14日	6个月	新股 流通 受限	42.50	32.02	390	16,575.00	12,487.80	-	
301103	何氏 眼科	2022 年6月 1日	3-4个 月	新股 流通 受限- 转增	-	32.02	117	-	3,746.34	注1	
301109	军信 股份	2022 年4月 6日	6个月	新股 流通 受限	34.81	16.14	1,225	42,642.25	19,771.50	-	
301109	军信 股份	2022 年6月 17日	3-4个 月	新股 流通 受限- 转增	-	16.14	613	-	9,893.82	注2	
301116	益客 食品	2022 年1月 10日	6个月	新股 流通 受限	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-	
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	-	
301150	中一	2022	6个月	新股	163.56	82.76	172	28,132.32	14,234.72	-	

	科技	年 4 月 14 日		流通 受限							
301150	中一 科技	2022 年 6 月 10 日	4-5 个 月	新股 流通 受限- 转增	-	82.76	86	-	7,117.36	注 3	
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		-
301163	宏德 股份	2022 年 4 月 11 日	6 个月	新股 流通 受限	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41		-
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		-
301196	唯科 科技	2022 年 1 月 4 日	6 个月	新股 流通 受限	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92		-
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		-
301233	盛帮 股份	2022 年 6 月 24 日	6 个月	新股 流通 受限	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16		-
301233	盛帮 股份	2022 年 6 月 24 日	1 个月 内(含)	新股 流通 受限	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36		-
301237	和顺 科技	2022 年 3 月 16 日	6 个月	新股 流通 受限	56.69	41.86	261	14,796.09	10,925.46		-
301238	瑞泰 新材	2022 年 6 月 10 日	6 个月	新股 流通 受限	19.18	32.07	3,497	67,072.46	112,148.79		-
301239	普瑞 眼科	2022 年 6 月	6 个月	新股 流通	33.65	33.65	575	19,348.75	19,348.75		-

		22 日		受限							
301239	普瑞眼科	2022 年 6 月 22 日	1 个月内 (含)	新股流通受限	33.65	33.65	5,172	174,037.80	174,037.80		-
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		-
301268	铭利达	2022 年 3 月 29 日	6 个月	新股流通受限	28.50	34.87	641	18,268.50	22,351.67		-
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		-
600309	万华化学	2022 年 5 月 16 日	6 个月	大宗交易购入流通受限	79.20	92.12	170,000	13,464,000.00	15,660,400.00		-
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		-
603041	美思德	2022 年 4 月 29 日	6 个月	非公开发行流通受限	10.08	11.80	496,031	4,999,992.48	5,853,165.80		-
688052	纳芯微	2022 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	230.00	350.81	3,480	800,400.00	1,220,818.80		-
688173	希荻微	2022 年 1 月 13 日	6 个月	新股流通受限	33.57	31.62	4,236	142,202.52	133,942.32		-
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		-
688322	奥比中光	2022 年 6 月 30 日	1 个月内 (含)	新股流通受限	30.99	30.99	8,529	264,313.71	264,313.71		-

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	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113060	浙22转债	2022年6月15日	1个月内(含)	新债未上市	100.00	100.00	400	40,000.00	40,000.00	-

注：1、本基金持有的新股流通受限股票何氏眼科，于2022年6月1日实施2021年年度权益分配方案，向全体股东每10股派发现金股利人民币6元（含税），同时，以资本公积金向全体股东每10股转增3股。本基金新增117股。

2、本基金持有的新股流通受限股票军信股份，于2022年6月17日实施2021年年度权益分配方案，向全体股东每10股派发现金红利人民币3.80元（含税），同时，以资本公积金向全体股东每10股转增5股。本基金新增613股。

3、本基金持有的新股流通受限股票中一科技，于2022年6月10日实施2021年年度权益分配方案，向全体股东每10股派发现金红利人民币20元（含税），同时，以资本公积金向全体股东每10股转增5股。本基金新增86股。

#### 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

截止本报告期末2022年6月30日，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证余额97,154,294.10元，是如下证券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
200202	20国开02	2022年7月1日	100.29	82,000	8,224,022.63
210212	21国开12	2022年7月1日	101.77	300,000	30,531,000.00
180204	18国开04	2022年7月4日	103.19	100,000	10,319,493.15
200202	20国开02	2022年7月4日	100.29	10,000	1,002,929.59
200402	20农发02	2022年7月7日	100.66	265,000	26,674,500.69

		日			
220201	22 国开 01	2022 年 7 月 7 日	101.06	232,000	23,445,386.08
合计				989,000	100,197,332.14

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券余额 108,720,528.79 元，于 2022 年 7 月 4 日、202 年 7 月 5 日到期、202 年 7 月 6 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的证券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 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加因转融通证券业务而出借的证券。

### 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、风险管理部及合规管理部和审计部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

#### 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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	174,787,154.04	192,609,440.63
AAA 以下	11,085,664.04	6,063,516.81
未评级	-	-
合计	185,872,818.08	198,672,957.44

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。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注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

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	124,258.92	-	-	-	-	-	124,258.92
结算备付金	8,080,940.76	-	-	-	-	-	8,080,940.76
存出保证金	174,742.78	-	-	-	-	-	174,742.78
交易性金融资产	20,608,646.58	71,832,753.42	194,939,693.65	125,261,091.31	28,932,026.11	4,654,580,154.29	5,096,154,365.36
应收申购款	68,259.63	-	-	-	-	5,959,309.22	6,027,568.85
应收清算款	-	-	-	-	-	10,492,156.83	10,492,156.83
资产总计	29,056,848.67	71,832,753.42	194,939,693.65	125,261,091.31	28,932,026.11	4,671,031,620.34	5,121,054,033.50
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	16,680,666.66	16,680,666.66

						9.23	.23
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,018,811.37	3,018,811.37
应付托管费	-	-	-	-	-	566,027.16	566,027.16
卖出回购金融资产款	205,874,822.89	-	-	-	-	-	205,874,822.89
应付销售服务费	-	-	-	-	-	46,466.52	46,466.52
应交税费	-	-	-	-	-	1,556.48	1,556.48
其他负债	-	-	-	-	-	1,042,832.85	1,042,832.85
负债总计	205,874,822.89	-	-	-	-	21,356,363.61	227,231,186.50
利率敏感度缺口	-176,817,974.22	71,832,753.42	194,939,693.65	125,261,091.31	28,932,026.11	4,649,675,256.73	4,893,822,847.00
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	10,118,006.07	-	-	-	-	-	10,118,006.07
结算备付金	6,694,211.62	-	-	-	-	-	6,694,211.62
存出保证金	103,630.16	-	-	-	-	-	103,630.16
交易性金融资产	30,006,000.00	75,117,924.20	132,777,308.50	153,774,918.16	41,337,561.98	4,379,185,139.40	4,812,198,852.24
应收申购款	98,929.54	-	-	-	-	6,502,942.86	6,601,872.40
应收证券清算款	-	-	-	-	-	15,327,355.12	15,327,355.12
其他资产	-	-	-	-	-	4,585,385.93	4,585,385.93
资产总计	47,020,777.39	75,117,924.20	132,777,308.50	153,774,918.16	41,337,561.98	4,405,600,823.31	4,855,629,313.54
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	28,206,989.28	28,206,989.28
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,178,636.84	3,178,636.84
应付托管费	-	-	-	-	-	595,994.40	595,994.40
卖出回购金融资产款	228,093,047.42	-	-	-	-	-	228,093,047.42

应付销售服务费	-	-	-	-	-	50,014.24	50,014.24
应交税费	-	-	-	-	-	2,011.25	2,011.25
其他负债	-	-	-	-	-	842,132.30	842,132.30
负债总计	228,093,047.42	-	-	-	-	32,875,778.31	260,968,825.73
利率敏感度缺口	-181,072,270.03	75,117,924.20	132,777,308.50	153,774,918.16	41,337,561.98	4,372,725,045.00	4,594,660,487.81

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)。		
	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	利率+1%	-1,023,213.31	-850,020.78
	利率-1%	1,035,142.61	859,254.70

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

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

本基金投资组合中股票投资比例范围为本基金投资于股票资产占基金资产的比例为90%-95%，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于90%。现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为5%-10%，其中现金或者到

期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

#### 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	4,654,580,154.29	95.11	4,379,185,139.40	95.31
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	441,574,211.07	9.02	433,013,712.84	9.42
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	5,096,154,365.36	104.13	4,812,198,852.24	104.73

#### 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		
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)
分析	业绩比较基准+10%	482,547,116.88	470,489,213.99
	业绩比较基准-10%	-482,547,116.88	-470,489,213.99

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

公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体  
的重要性，被划分为三个层次：

第一层次输入值是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；

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 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	4,704,718,144.47	4,255,510,082.27
第二层次	321,468,401.38	337,729,080.29
第三层次	69,967,819.51	218,959,689.68
合计	5,096,154,365.36	4,812,198,852.24

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债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的  
交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会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将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的  
不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第  
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，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(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资产和负债主要包括货币资金、应收款项和其他金融负债，其公允价值与账面价值相若。

#### 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	4,654,580,154.29	90.89
	其中：股票	4,654,580,154.29	90.89
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	441,574,211.07	8.62
	其中：债券	441,574,211.07	8.62
	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	8,205,199.68	0.16
8	其他各项资产	16,694,468.46	0.33
9	合计	5,121,054,033.50	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,475,175.40	0.05
B	采矿业	201,344,116.86	4.11
C	制造业	2,195,612,813.70	44.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	91,741,896.86	1.87
E	建筑业	44,843,244.00	0.92
F	批发和零售业	6,725,923.72	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	102,397,332.61	2.09
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	127,397,955.30	2.60
J	金融业	1,114,833,327.98	22.78
K	房地产业	128,061,146.21	2.62
L	租赁和商务服务业	333,853,863.13	6.82
M	科学研究和技术服务业	1,679,542.49	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	37,635,000.00	0.77
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	9,279,017.28	0.19
S	综合	-	-
	合计	4,397,880,355.54	89.87

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	6,455,773.62	0.13
B	采矿业	25,105,183.44	0.51
C	制造业	133,909,672.13	2.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,928,432.00	0.26
E	建筑业	5,373,017.27	0.11
F	批发和零售业	7,846,957.69	0.16
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,652,990.46	0.42
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	19,959.78	0.00
M	科学研究和技术服务业	162,737.67	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	41,711.34	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	44,203,363.35	0.90
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	256,699,798.75	5.25

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

### 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

#### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	601888	中国中免	1,415,705	329,760,165.65	6.74
2	600519	贵州茅台	151,500	309,817,500.00	6.33
3	000895	双汇发展	7,008,809	205,358,103.70	4.20
4	601601	中国太保	7,668,839	180,447,781.67	3.69
5	601318	中国平安	3,728,863	174,100,613.47	3.56
6	600036	招商银行	3,938,870	166,220,314.00	3.40
7	000100	TCL 科技	33,118,800	158,639,052.00	3.24
8	601009	南京银行	14,318,845	149,202,364.90	3.05
9	600741	华域汽车	5,663,800	130,267,400.00	2.66
10	000858	五粮液	526,829	106,382,579.97	2.17
11	600690	海尔智家	3,523,800	96,763,548.00	1.98
12	000938	紫光股份	4,688,838	90,963,457.20	1.86
13	603799	华友钴业	895,150	85,594,243.00	1.75
14	601225	陕西煤业	4,036,807	85,499,572.26	1.75
15	600309	万华化学	883,959	84,907,283.41	1.73
16	601336	新华保险	2,618,880	84,301,747.20	1.72
17	300124	汇川技术	1,228,200	80,901,534.00	1.65
18	601166	兴业银行	3,798,118	75,582,548.20	1.54
19	002555	三七互娱	2,668,182	56,525,503.86	1.16
20	600161	天坛生物	2,310,700	56,103,796.00	1.15
21	000001	平安银行	3,718,780	55,707,324.40	1.14
22	601088	中国神华	1,488,808	49,577,306.40	1.01
23	001979	招商蛇口	3,638,883	48,870,198.69	1.00
24	000568	泸州老窖	196,900	48,543,726.00	0.99
25	601838	成都银行	2,797,100	46,375,918.00	0.95
26	000333	美的集团	709,491	42,846,161.49	0.88
27	601628	中国人寿	1,368,878	42,544,728.24	0.87
28	600900	长江电力	1,819,998	42,078,353.76	0.86

29	002607	中公教育	6,500,000	37,635,000.00	0.77
30	600406	国电南瑞	1,377,139	37,182,753.00	0.76
31	000069	华侨城 A	5,688,800	36,920,312.00	0.75
32	300450	先导智能	555,716	35,110,136.88	0.72
33	002821	凯莱英	120,826	34,918,714.00	0.71
34	601899	紫金矿业	3,707,180	34,587,989.40	0.71
35	002841	视源股份	438,823	33,052,148.36	0.68
36	000651	格力电器	908,891	30,647,804.52	0.63
37	600019	宝钢股份	5,038,936	30,334,394.72	0.62
38	002142	宁波银行	834,600	29,887,026.00	0.61
39	601360	三六零	3,500,869	29,827,403.88	0.61
40	600760	中航沈飞	470,500	28,441,725.00	0.58
41	002352	顺丰控股	500,036	27,907,009.16	0.57
42	601012	隆基绿能	415,026	27,653,182.38	0.57
43	000066	中国长城	2,388,800	25,846,816.00	0.53
44	002938	鹏鼎控股	831,826	25,129,463.46	0.51
45	600276	恒瑞医药	673,119	24,965,983.71	0.51
46	601985	中国核电	3,388,835	23,247,408.10	0.48
47	600048	保利发展	1,328,800	23,200,848.00	0.47
48	600196	复星医药	503,200	22,186,088.00	0.45
49	600436	片仔癀	61,813	22,050,551.49	0.45
50	601006	大秦铁路	3,288,800	21,673,192.00	0.44
51	601138	工业富联	2,083,804	20,504,631.36	0.42
52	600009	上海机场	358,800	20,343,960.00	0.42
53	601816	京沪高铁	3,988,800	20,023,776.00	0.41
54	600028	中国石化	4,888,885	19,946,650.80	0.41
55	000063	中兴通讯	778,800	19,882,764.00	0.41
56	000538	云南白药	318,812	19,253,056.68	0.39
57	600383	金地集团	1,418,883	19,069,787.52	0.39
58	600585	海螺水泥	538,973	19,014,967.44	0.39
59	601668	中国建筑	3,367,100	17,912,972.00	0.37
60	000338	潍柴动力	1,413,600	17,627,592.00	0.36
61	600584	长电科技	638,835	17,248,545.00	0.35
62	600795	国电电力	4,388,800	17,160,208.00	0.35
63	601398	工商银行	3,588,820	17,118,671.40	0.35
64	600016	民生银行	4,281,133	15,925,814.76	0.33
65	600332	白云山	458,700	14,490,333.00	0.30
66	601818	光大银行	4,799,800	14,447,398.00	0.30
67	600000	浦发银行	1,758,000	14,081,580.00	0.29
68	601390	中国中铁	2,288,800	14,053,232.00	0.29
69	002050	三花智控	501,800	13,789,464.00	0.28
70	000157	中联重科	2,237,616	13,783,714.56	0.28

71	600660	福耀玻璃	316,300	13,224,503.00	0.27
72	600893	航发动力	254,302	11,573,284.02	0.24
73	601600	中国铝业	2,387,800	11,342,050.00	0.23
74	601633	长城汽车	296,900	10,997,176.00	0.22
75	000768	中航西飞	336,400	10,189,556.00	0.21
76	601877	正泰电器	280,024	10,019,258.72	0.20
77	300413	芒果超媒	278,148	9,279,017.28	0.19
78	600926	杭州银行	618,800	9,269,624.00	0.19
79	002594	比亚迪	27,448	9,153,633.52	0.19
80	601169	北京银行	1,998,800	9,074,552.00	0.19
81	601939	建设银行	1,488,800	9,022,128.00	0.18
82	601229	上海银行	1,319,836	8,644,925.80	0.18
83	600745	闻泰科技	100,000	8,511,000.00	0.17
84	600352	浙江龙盛	788,800	8,029,984.00	0.16
85	600085	同仁堂	148,700	7,863,256.00	0.16
86	601898	中煤能源	688,800	7,149,744.00	0.15
87	002008	大族激光	215,771	7,148,493.23	0.15
88	002271	东方雨虹	136,150	7,007,640.50	0.14
89	601989	中国重工	1,888,800	7,007,448.00	0.14
90	002601	龙佰集团	328,852	6,593,482.60	0.13
91	601186	中国铁建	812,000	6,414,800.00	0.13
92	688036	传音控股	70,000	6,246,100.00	0.13
93	002007	华兰生物	272,441	6,211,654.80	0.13
94	002241	歌尔股份	183,799	6,175,646.40	0.13
95	600362	江西铜业	338,813	6,041,035.79	0.12
96	603833	欧派家居	36,274	5,465,766.32	0.11
97	600104	上汽集团	300,000	5,343,000.00	0.11
98	600606	绿地控股	1,338,800	5,301,648.00	0.11
99	000425	徐工机械	886,000	4,775,540.00	0.10
100	600025	华能水电	682,300	4,769,277.00	0.10
101	601021	春秋航空	80,487	4,696,416.45	0.10
102	600655	豫园股份	486,668	4,594,145.92	0.09
103	603993	洛阳钼业	799,800	4,582,854.00	0.09
104	000725	京东方 A	1,146,870	4,518,667.80	0.09
105	600886	国投电力	427,300	4,486,650.00	0.09
106	601111	中国国航	373,900	4,340,979.00	0.09
107	002027	分众传媒	608,276	4,093,697.48	0.08
108	601688	华泰证券	281,500	3,997,300.00	0.08
109	600989	宝丰能源	267,900	3,924,735.00	0.08
110	002202	金风科技	250,000	3,700,000.00	0.08
111	002252	上海莱士	619,100	3,671,263.00	0.08
112	002120	韵达股份	200,000	3,412,000.00	0.07

113	002415	海康威视	90,000	3,258,000.00	0.07
114	601658	邮储银行	498,384	2,686,289.76	0.05
115	300498	温氏股份	116,260	2,475,175.40	0.05
116	000776	广发证券	132,300	2,474,010.00	0.05
117	000792	盐湖股份	81,000	2,426,760.00	0.05
118	002179	中航光电	38,094	2,412,112.08	0.05
119	000963	华东医药	47,205	2,131,777.80	0.04
120	002001	新和成	84,000	1,916,040.00	0.04
121	600111	北方稀土	49,600	1,743,936.00	0.04
122	603259	药明康德	16,151	1,679,542.49	0.03
123	300122	智飞生物	14,000	1,554,140.00	0.03
124	300760	迈瑞医疗	4,800	1,503,360.00	0.03
125	601728	中国电信	394,011	1,469,661.03	0.03
126	600999	招商证券	96,242	1,386,847.22	0.03
127	600570	恒生电子	30,000	1,306,200.00	0.03
128	600588	用友网络	50,043	1,086,433.53	0.02
129	600030	中信证券	50,000	1,083,000.00	0.02
130	601328	交通银行	200,000	996,000.00	0.02
131	300408	三环集团	29,585	890,508.50	0.02
132	601669	中国电建	111,600	878,292.00	0.02
133	002236	大华股份	51,416	844,250.72	0.02
134	600031	三一重工	29,241	557,333.46	0.01
135	600438	通威股份	9,039	541,074.54	0.01
136	601117	中国化学	30,000	282,300.00	0.01
137	601878	浙商证券	22,392	254,820.96	0.01
138	688599	天合光能	3,154	205,798.50	0.00
139	300433	蓝思科技	287	3,177.09	0.00
140	002916	深南电路	18	1,686.78	0.00

### 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	002773	康弘药业	3,138,000	46,881,720.00	0.96
2	002044	美年健康	7,898,338	43,993,742.66	0.90
3	600195	中牧股份	1,930,700	23,670,382.00	0.48
4	000983	山西焦煤	1,188,000	15,907,320.00	0.33
5	002728	特一药业	915,751	13,543,957.29	0.28
6	600674	川投能源	1,084,600	12,928,432.00	0.26
7	300507	苏奥传感	1,500,000	11,685,000.00	0.24
8	300647	超频三	1,001,068	10,474,968.36	0.21
9	002624	完美世界	569,600	8,185,152.00	0.17
10	601699	潞安环能	538,000	7,865,560.00	0.16

11	300511	雪榕生物	1,023,102	6,455,773.62	0.13
12	601607	上海医药	350,000	6,328,000.00	0.13
13	603041	美思德	496,031	5,853,165.80	0.12
14	300353	东土科技	632,911	5,531,642.14	0.11
15	300506	名家汇	793,651	5,373,017.27	0.11
16	603496	恒为科技	417,014	4,970,806.88	0.10
17	300383	光环新网	424,088	4,418,996.96	0.09
18	300292	吴通控股	1,218,885	4,327,041.75	0.09
19	002792	通宇通讯	300,632	3,625,621.92	0.07
20	300695	兆丰股份	55,463	2,852,462.09	0.06
21	002730	电光科技	315,457	2,640,375.09	0.05
22	300674	宇信科技	90,498	1,381,904.46	0.03
23	600938	中国海油	84,004	1,332,303.44	0.03
24	688052	纳芯微	3,480	1,220,818.80	0.02
25	601933	永辉超市	200,762	859,261.36	0.02
26	300293	蓝英装备	68,906	716,622.40	0.01
27	002024	ST易购	288,077	659,696.33	0.01
28	600718	东软集团	47,475	546,437.25	0.01
29	688279	峰昭科技	5,505	406,929.60	0.01
30	688400	凌云光	13,111	287,524.23	0.01
31	688322	奥比中光	8,529	264,313.71	0.01
32	301150	中一科技	2,569	233,478.77	0.00
33	301239	普瑞眼科	5,747	193,386.55	0.00
34	688173	希荻微	4,236	133,942.32	0.00
35	300676	华大基因	1,847	132,429.90	0.00
36	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.00
37	301238	瑞泰新材	3,497	112,148.79	0.00
38	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.00
39	688511	天微电子	1,490	55,785.60	0.00
40	301200	大族数控	857	44,495.44	0.00
41	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
42	301207	华兰疫苗	569	32,102.98	0.00
43	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.00
44	301109	军信股份	1,838	29,665.32	0.00
45	301268	铭利达	641	22,351.67	0.00
46	301102	兆讯传媒	642	19,959.78	0.00
47	300834	星辉环材	635	19,069.05	0.00
48	603607	京华激光	1,439	18,966.02	0.00
49	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
50	301153	中科江南	398	17,504.04	0.00
51	002899	英派斯	1,408	17,262.08	0.00
52	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00

53	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.00
54	301286	侨源股份	784	15,515.36	0.00
55	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
56	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
57	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
58	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
59	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
60	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
61	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
62	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
63	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
64	301181	标榜股份	257	7,861.63	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	600900	长江电力	56,137,135.00	1.22
2	000895	双汇发展	43,981,143.00	0.96
3	601601	中国太保	34,740,726.00	0.76
4	000066	中国长城	30,748,518.00	0.67
5	600519	贵州茅台	25,609,786.00	0.56
6	600036	招商银行	24,350,231.00	0.53
7	601318	中国平安	24,210,500.00	0.53
8	601166	兴业银行	22,246,699.00	0.48
9	601006	大秦铁路	21,679,287.60	0.47
10	600741	华域汽车	20,705,700.00	0.45
11	601009	南京银行	19,199,605.38	0.42
12	601888	中国中免	18,941,991.00	0.41
13	002555	三七互娱	18,370,690.00	0.40
14	002841	视源股份	17,787,159.00	0.39
15	000938	紫光股份	16,899,885.00	0.37
16	601138	工业富联	16,684,880.00	0.36
17	600309	万华化学	15,396,179.00	0.34
18	000001	平安银行	14,429,282.40	0.31
19	600019	宝钢股份	14,040,204.88	0.31
20	600674	川投能源	12,356,750.00	0.27

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	600900	长江电力	15,579,005.00	0.34
2	600690	海尔智家	9,778,665.00	0.21
3	002915	中欣氟材	7,803,725.05	0.17
4	002627	三峡旅游	7,029,087.11	0.15
5	601360	三六零	6,538,000.73	0.14
6	601607	上海医药	6,238,584.82	0.14
7	002947	恒铭达	5,895,788.57	0.13
8	002452	长高电新	5,370,725.72	0.12
9	600152	维科技术	5,203,061.20	0.11
10	600030	中信证券	4,677,157.00	0.10
11	600487	亨通光电	4,172,844.92	0.09
12	002739	万达电影	3,685,449.00	0.08
13	603042	华脉科技	3,525,777.34	0.08
14	300507	苏奥传感	3,381,582.74	0.07
15	601818	光大银行	2,720,000.00	0.06
16	688223	晶科能源	2,236,500.00	0.05
17	688187	时代电气	2,205,085.10	0.05
18	300292	吴通控股	2,043,696.00	0.04
19	601318	中国平安	2,040,000.00	0.04
20	601009	南京银行	1,991,400.00	0.04

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	707,733,389.41
卖出股票收入（成交）总额	129,477,180.78

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	11,478,124.49	0.23
2	央行票据	-	-
3	金融债券	244,223,268.50	4.99
	其中：政策性金融债	244,223,268.50	4.99
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）	185,872,818.08	3.80
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	441,574,211.07	9.02
----	----	----------------	------

## 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	200312	20 进出 12	500,000	51,383,356.16	1.05
2	113050	南银转债	272,230	33,398,272.78	0.68
3	210212	21 国开 12	300,000	30,531,000.00	0.62
4	220201	22 国开 01	300,000	30,317,309.59	0.62
5	200402	20 农发 02	300,000	30,197,547.95	0.62

## 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	174,742.78

2	应收清算款	10,492,156.83
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	6,027,568.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,694,468.46

## 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113050	南银转债	33,398,272.78	0.68
2	132020	19 蓝星 EB	22,891,716.41	0.47
3	110059	浦发转债	21,461,570.38	0.44
4	132014	18 中化 EB	16,017,010.18	0.33
5	113052	兴业转债	14,517,299.45	0.30
6	132015	18 中油 EB	13,327,227.04	0.27
7	132018	G 三峡 EB1	11,338,237.28	0.23
8	110061	川投转债	8,455,801.12	0.17
9	113044	大秦转债	6,282,836.11	0.13
10	113042	上银转债	5,538,518.41	0.11
11	110079	杭银转债	2,376,607.34	0.05
12	110045	海澜转债	2,183,273.97	0.04
13	113021	中信转债	1,676,793.72	0.03
14	110053	苏银转债	1,326,563.92	0.03
15	110062	烽火转债	1,300,667.47	0.03
16	132021	19 中电 EB	1,222,842.92	0.02
17	128022	众信转债	1,140,695.89	0.02
18	113011	光大转债	1,111,197.17	0.02
19	127012	招路转债	953,796.25	0.02
20	123107	温氏转债	892,267.32	0.02
21	127005	长证转债	717,575.09	0.01
22	110057	现代转债	576,641.38	0.01
23	127015	希望转债	564,818.10	0.01
24	127020	中金转债	432,081.10	0.01
25	128081	海亮转债	288,955.86	0.01
26	127006	敖东转债	276,174.98	0.01
27	113024	核建转债	238,334.67	0.00
28	110060	天路转债	213,525.48	0.00
29	110052	贵广转债	203,331.92	0.00
30	128075	远东转债	159,816.66	0.00
31	123023	迪森转债	141,158.81	0.00

32	113530	大丰转债	136,873.17	0.00
33	128100	搜特转债	85,908.23	0.00
34	113594	淳中转债	3,557.68	0.00
35	110043	无锡转债	3,537.39	0.00
36	110038	济川转债	1,423.35	0.00
37	113505	杭电转债	1,182.42	0.00

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本报告期末本基金指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

### 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

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
兴全沪深 300 指数 (LOF) A	622,045	3,193.43	193,142,177.90	9.72	1,793,311,922.16	90.28
兴全沪深 300 指数 C	28,477	2,193.30	955,587.75	1.53	61,502,933.73	98.47
合计	650,522	3,149.64	194,097,765.65	9.47	1,854,814,855.89	90.53

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

兴全沪深 300 指数 (LOF) A

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	钱春香	1,901,301.00	4.94
2	陈周阳	1,783,000.00	4.63
3	浙江德源智能科技股份有限公司	914,447.00	2.38
4	钟贵洋	581,528.00	1.51

5	刘继红	468,000.00	1.22
6	李广涛	436,875.00	1.14
7	吴林萍	412,429.00	1.07
8	王义华	400,000.00	1.04
9	王磊	391,459.00	1.02
10	查晟	339,070.00	0.88

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	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	兴全沪深 300 指数 (LOF) A	3,892,990.85	0.1960
	兴全沪深 300 指数 C	13,024.27	0.0209
	合计	3,906,015.12	0.1906

注：对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总数）。

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

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	兴全沪深 300 指数 (LOF) A	兴全沪深 300 指数 C
基金合同生效日 (2010 年 11 月 2 日) 基金份额总额	2,955,476,122.49	-
本报告期期初基金份额总额	1,735,651,859.03	57,941,082.05
本报告期基金总申购份额	504,024,798.69	22,841,180.59

减：本报告期基金总赎回份额	253,222,557.66	18,323,741.16
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,986,454,100.06	62,458,521.48

注：1、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。

2、自 2019 年 6 月 5 日起增设兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) C 类份额。

## § 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) 2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部总裁。

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王洪滨任托管业务部高级专家。

### 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

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

	数量	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
兴业证券	3	730,721,549.28	100.00	534,724.44	100.00	-

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 (%)
兴业证券	40,771,513.94	100.00	8,388,057,000.00	100.00	-	-

### 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	证券时报及规定互联网网站	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	证券时报及规定互联网网站	2022-01-06
3	关于旗下部分基金投资东土科技(300353)非公开发行股票的公告	证券时报及规定互联网网站	2022-01-18
4	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	证券时报及规定互联网网站	2022-01-19
5	关于旗下部分基金投资电光科技(002730)非公开发行股票的公告	证券时报及规定互联网网站	2022-01-20
6	关于副总经理离任的公告	证券时报及规定互联网网站	2022-01-21
7	关于旗下部分基金投资兆丰股份(300695)非公开发行股票的公告	证券时报及规定互联网网站	2022-01-26
8	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	证券时报及规定互联网网站	2022-01-26
9	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	证券时报及规定互联网网站	2022-01-27
10	关于公司副总经理任职的公告	证券时报及规定互联网网站	2022-01-28
11	关于兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金(LOF)暂停接受大额申购(含定投)、大额转换转入申请的公告	证券时报及规定互联网网站	2022-01-28
12	关于旗下部分基金投资宇信科技(300674)非公开发行股票的公告	证券时报及规定互联网网站	2022-02-09
13	关于增加德邦证券为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报及规定互联网网站	2022-03-15

14	关于旗下部分基金投资雪榕生物(300511)非公开发行股票的公告	证券时报及规定互联网网站	2022-03-22
15	关于增加财达证券为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报及规定互联网网站	2022-04-11
16	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	证券时报及规定互联网网站	2022-04-18
17	关于增加兴业银行为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报及规定互联网网站	2022-05-06
18	兴证全球基金管理有限公司关于旗下部分基金投资美思德(603041)非公开发行股票的公告	证券时报及规定互联网网站	2022-05-06
19	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	证券时报及规定互联网网站	2022-05-20
20	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	证券时报及规定互联网网站	2022-05-27
21	关于增加招商银行为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报及规定互联网网站	2022-05-27
22	关于调整网上直销基金转换、赎回转购、汇款交易优惠费率的公告	证券时报及规定互联网网站	2022-06-17
23	关于公司副总经理变更的公告	证券时报及规定互联网网站	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

1、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。

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

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准本基金募集的文件
- 2、《兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》
- 3、《兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 6、中国证监会规定的其他文件

### 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