

# 兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：兴证全球基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2023 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 03 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 12 月 31 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	7
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</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	9
3.3 其他指标	11
3.4 过去三年基金的利润分配情况	12
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>17</b>
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>19</b>
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 净资产（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	25
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>69</b>
8.1 期末基金资产组合情况	69

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	69
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	71
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	76
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	78
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	78
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	78
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	78
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	78
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	79
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	79
8.12 投资组合报告附注 .....	错误!未定义书签。
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>81</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	81
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	81
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	81
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	82
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	82
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>82</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>82</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	82
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	83
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	83
11.4 基金投资策略的改变 .....	83
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	83
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	83
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	83
11.8 其他重大事件 .....	84
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>86</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	86
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	86
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>86</b>
13.1 备查文件目录 .....	86
13.2 存放地点 .....	87
13.3 查阅方式 .....	87

## § 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 指数增强 (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	2,198,593,539.25 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 指数增强 (LOF) A	兴全沪深 300 指数增强 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	2,101,102,660.74 份	97,490,878.51 份

基金的份额总额	
---------	--

注：1、本基金 A 类份额场内扩位简称：兴全沪深 300 LOF。

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

## 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数复制结合相对增强的投资策略，即通过指数复制的方法拟合、跟踪沪深 300 指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的组合管理，谋求基金资产的长期增值。本基金力争日均跟踪误差不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，日均下方跟踪误差不超过 0.3%，年下方跟踪误差不超过 4.75%。
投资策略	本基金采用指数复制结合相对增强的投资策略，即通过指数复制的方法拟合、跟踪沪深 300 指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的组合管理。（详见本基金基金合同及招募说明书）
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
	联系电话	021-20398888
	电子邮箱	yangwd@xqfunds.com
客户服务电话	4006780099, 021-38824536	95599
传真	021-20398988	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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.xqfunds.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022 年		2021 年		2020 年	
	兴全沪深 300 指数 (LOF) A	兴全沪深 300 指数 C	兴全沪深 300 指数 (LOF) A	兴全沪深 300 指数 C	兴全沪深 300 指数 (LOF) A	兴全沪深 300 指数 C
本期已实现收益	86,845,473.58	1,993,437.53	261,723,383.77	6,637,698.61	452,063,810.75	13,077,943.17
本期利润	610,318,024.73	19,292,437.56	301,663,743.35	9,844,042.58	-1,344,281,539.28	35,835,411.20
加权平均基金份额本期利润	-0.3179	-0.2837	-0.1638	-0.1772	0.5803	0.5335
本期加权平均净值利润率	-14.22%	-12.84%	-6.19%	-6.76%	25.57%	23.19%
本期基金份额净值增长率	-14.00%	-14.34%	-6.37%	-6.74%	28.70%	28.19%
3.1.2 期	2022 年末		2021 年末		2020 年末	

末数据和指标						
期末可供分配利润	2,528,966,603.36	114,780,357.45	2,295,630,159.69	70,290,837.08	2,356,610,993.62	50,177,502.06
期末可供分配基金份额利润	1.2036	1.1773	1.3226	1.2131	1.1828	1.0846
期末基金资产净值	4,630,069,264.10	212,271,235.96	4,447,379,509.79	147,280,978.02	5,452,329,114.84	126,097,209.54
期末基金份额净值	2.2036	2.1773	2.5624	2.5419	2.7366	2.7256
3.1.3 累计期末指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
基金份额累计净值增长率	120.36%	18.84%	156.24%	38.73%	173.66%	48.76%

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

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

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



## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴全沪深 300 指数 (LOF) A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.07%	1.26%	1.69%	1.23%	2.38%	0.03%
过去六个月	-7.77%	1.08%	-13.00%	1.05%	5.23%	0.03%
过去一年	-14.00%	1.24%	-20.58%	1.22%	6.58%	0.02%
过去三年	3.64%	1.26%	-4.89%	1.24%	8.53%	0.02%
过去五年	19.83%	1.24%	-3.15%	1.23%	22.98%	0.01%
自基金合同生效起至今	120.36%	1.33%	12.90%	1.34%	107.46%	-0.01%

兴全沪深 300 指数 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.97%	1.26%	1.69%	1.23%	2.28%	0.03%
过去六个月	-7.96%	1.08%	-13.00%	1.05%	5.04%	0.03%
过去一年	-14.34%	1.24%	-20.58%	1.22%	6.24%	0.02%
过去三年	2.40%	1.26%	-4.89%	1.24%	7.29%	0.02%
自基金合同生效起至今	18.84%	1.20%	7.63%	1.18%	11.21%	0.02%

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：

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

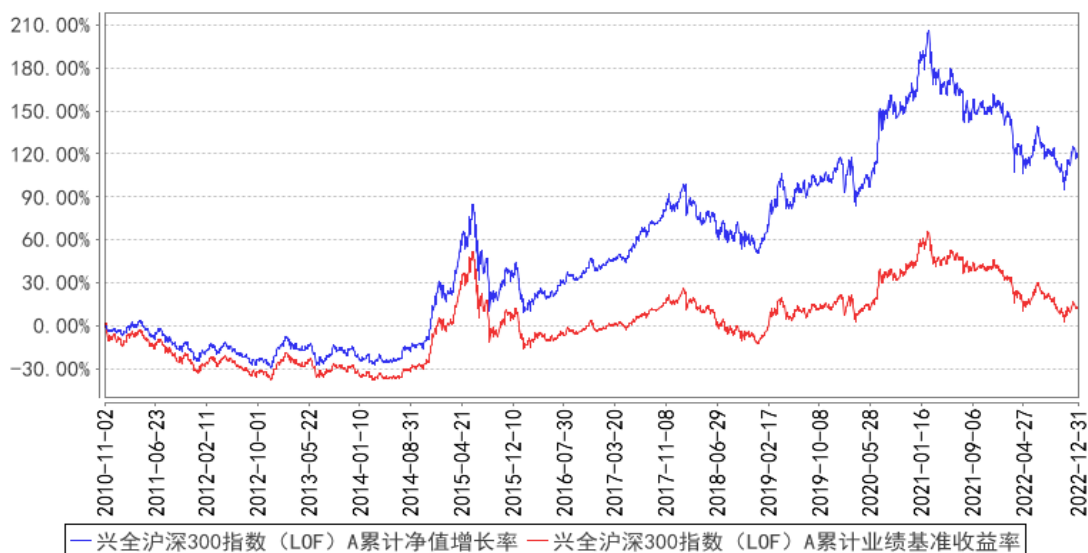
$$\text{Benchmark}_t = (1 + \text{Return}_t) \times (1 + \text{Benchmark}_{t-1}) - 1$$

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

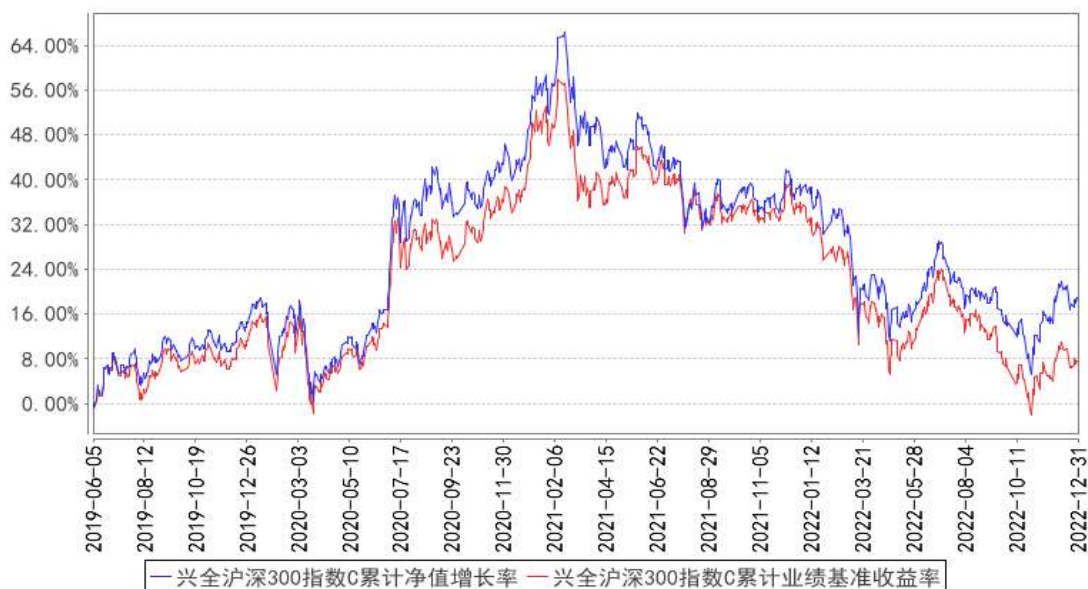
2、自 2019 年 6 月 5 日起增设兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 C 类份额，详情请见管理人网站公告

### 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 12 月 31 日。

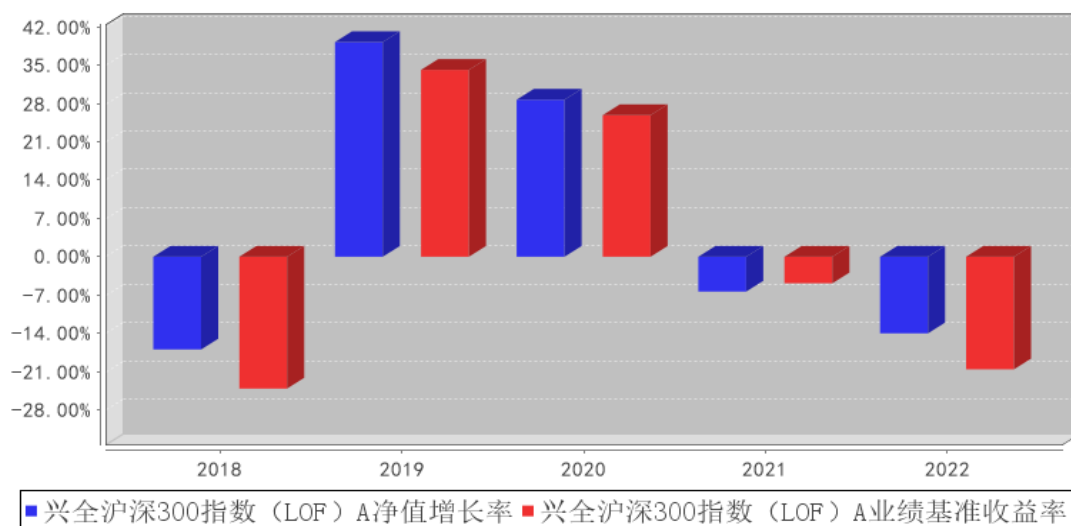
2、按照《兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金合同》的规定，本基金建仓期为 2010 年 11 月 2 日至 2011 年 5 月 1 日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

3、经与基金托管人中国农业银行协商一致，并报中国证监会备案，管理人决定自 2019 年 6

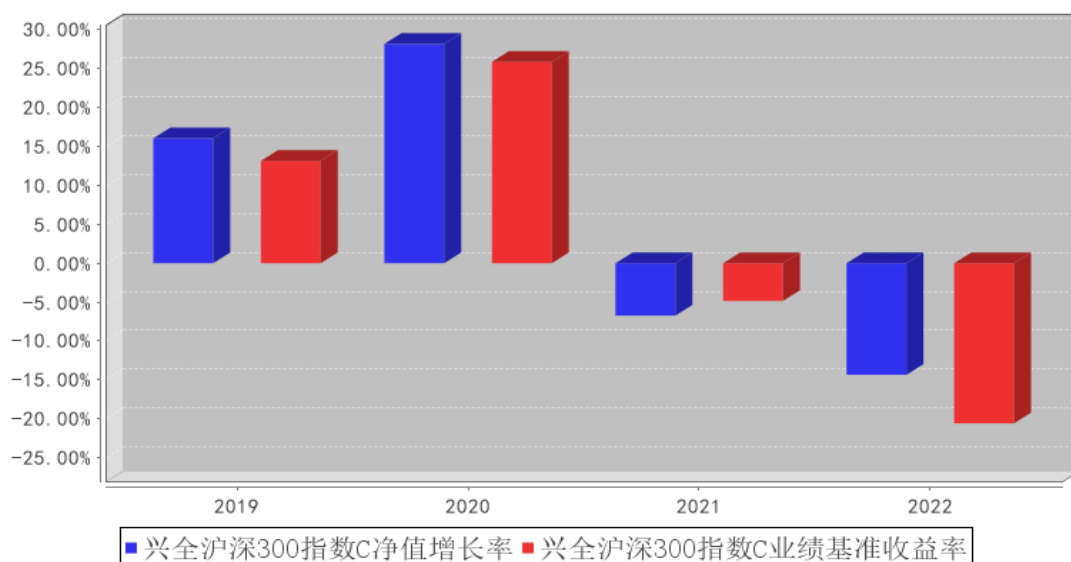
月 5 日起增设兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) C 类份额 (代码: 007230)。详情请见管理人网站公告。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴全沪深300指数 (LOF) A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



兴全沪深300指数C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注: 自 2019 年 6 月 5 日起增设兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 C 类份额, 2019 年度数据统计区间为 2019 年 6 月 5 日至 2019 年 12 月 31 日, 数据按实际存续期计算, 不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 其他指标

注: 无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过去三年未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

兴证全球基金管理有限公司（成立时名为“兴业基金管理有限公司”，以下简称“公司”）经证监基金字[2003]100号文批准于2003年9月30日成立。2008年1月，中国证监会批复（证监许可[2008]6号），同意全球人寿保险国际公司（AEGON International B.V）受让公司股权并成为公司股东。2008年4月9日，公司完成股权转让、变更注册资本等相关手续后，公司注册资本由9800万元变更为人民币1.2亿元，其中兴业证券股份有限公司的出资占注册资本的51%，全球人寿保险国际公司的出资占注册资本的49%。2008年7月，经中国证监会批准（证监许可[2008]888号），公司于2008年8月25日完成变更公司名称、注册资本等相关手续后，公司名称变更为“兴业全球基金管理有限公司”，注册资本增加为1.5亿元人民币，其中两股东出资比例不变。2016年12月28日，因公司发展需要，公司名称变更为“兴全基金管理有限公司”。2020年3月18日，公司名称变更为“兴证全球基金管理有限公司”。

截至2022年12月31日，公司旗下已管理兴全可转债混合型证券投资基金等共55只基金，包括股票型、混合型、债券型、货币型、指数型、FOF等类型。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
申庆	兴全沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)、兴全中证800六个月持有期指数增强型证券投资基金基金经理	2010年11月2日	-	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, 本基金基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理, 故本项不适用。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本报告期末, 本基金基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理, 故本项不适用。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人制定了《兴证全球基金管理有限公司公平交易管理办法》, 并将不时进行修订。本基金管理人主要从研究的公平、决策的公平、交易的公平、公平交易的监控评估、公平交易的报告和信息披露等方面对公平交易行为进行规范, 从而达到保证本基金管理人管理的不同投资组合得到公平对待、保护投资者合法权益的目的。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内, 本基金管理人严格按照《证券投资基金法》《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定, 从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关, 确保各投资组合之间得到公平对待, 保护投资者的合法权益。

##### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本报告期末, 本基金基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理, 故本项不适用。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内, 所有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不存在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

2022 全年在各种超预期事件影响下, 市场呈现 W 型走势。年初刚好处于三年慢牛行情的尾声,

叠加海外地缘事件和国内疫情反复，市场风险偏好下降，低估值红利资产表现出较强的防御性。随着二季度疫情缓和、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，成长、小盘风格相对较强。进入三季度，各方面因素导致风险偏好重新受到压制，价值板块相对抗跌，直到四季度疫情拐点确立，不确定性消除后的市场又重新开始交易经济复苏相关逻辑。

在具体操作上，我们依然坚持在保持总体行业和风格均衡前提下的行业内相对综合价值比较的选股策略，并积极把握各种具备相对确定性的超额收益。一方面，整体上偏价值的投资风格，在 2022 年偏弱的市场下体现出防御力。另一方面，通过对一些市场关注度不高的投资机会的发掘，也给组合带来了独立于市场主流风格的超额收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末兴全沪深 300 指数（LOF）A 的基金份额净值为 2.2036 元，本报告期基金份额净值增长率为-14.00%，同期业绩比较基准收益率为-20.58%；截至本报告期末兴全沪深 300 指数 C 的基金份额净值为 2.1773 元，本报告期基金份额净值增长率为-14.34%，同期业绩比较基准收益率为-20.58%。

#### 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 2023 年，无论是从长期目标（赢得国际竞争）还是短期现实（修复疫情期间受损的资产负债表）而言，经济增长的诉求均较强，但并非一帆风顺，面临诸多挑战。随着海外衰退预期上升，外需走弱风险较大，通过扩大内需加以对冲成为必然选择。考虑到人口结构以及居民长期观念的变化，地产需求面临的不确定性较高，而基建也面临地方债务杠杆率问题，因此消费需要起到更大的托底作用。总体看，我们更倾向于认为 2023 年可能呈现温和复苏的局面，经济大起大落的可能性不大。

目前看市场处于强预期、弱现实的状态。一方面随着线下经济活动的限制减少，有理由对经济复苏抱有较强预期，一些配置型资金（比如北向资金）入场可能也与此有关。另一方面作为传统经济引擎的地产金融链面临和过去完全不同的宏观和政策环境，可能很难大规模拉动总需求，外需也面临更大的不确定性。从基金投资者行为上看，投资者也更加理性，从而使市场相对均衡，均值回归特征较强。对于市场整体和行业风格而言，面临的主要问题是强预期能否成为强现实，需要密切关注真空期后宏观数据的变化，预判其对估值中枢与市场风格的影响。此外，不容忽视经历 2022 年储蓄大幅增长之后，居民超额储蓄作为潜在增量资金的影响。随着信心的恢复，超额储蓄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，当然情绪

化低估值的品种在基本面显著改善时也会向上回归。强预期带来的估值波动最终需要落实到基本面的现实。我们的愿景是在严格遵守投资组合约束条件下力争获得最好的结果。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人通过以下工作的开展，有力地保证了本基金整体运作的合法合规，从而最大程度地保护了基金份额持有人和其他相关当事人的合法权益：

1、实时风险监控：通过风控系统对本基金的运作进行实时监控，每日撰写监控日志，在此基础上每周撰写信息周报，对本基金遵守风控指标的情况进行汇总、分析和提示。

2、加强事后人工分析，并定期撰写风险管理报告。除系统控制外，公司风险管理部还对一些无法嵌入系统的风控指标进行了事后人工计算分析和复核，并同样反映在监控日志和信息周报中。此外，在每个季度结束之后，公司风险管理部会对基金的流动性进行压力测试并出具书面报告，对旗下每只基金进行全面的风险评价并形成风险分析报告，并提交公司领导和基金经理审阅。

3、进一步加强对公平交易的监控。根据监管部门的要求以及公司公平交易相关工作的不断深入开展，公司进一步明确了公平交易执行和分析中的具体标准，将公平交易问题分为交易的公平和投资策略的公平，主要包括：（1）明确交易部的分单规则及其识别异常下单行为的职责，保证交易的公平；（2）通过 T 检验、模拟利益输送金额、具体可疑交易分析等方法，对以往的下单及交易记录进行分析，保证投资策略的公平。

4、季度监察稽核和专项稽核：根据中国证监会《关于基金管理公司报送监察稽核报告的通知》以及《证券投资基金管理有限公司监察稽核报告内容与格式指引（试行）》等规定，认真做好公司各季度监察稽核工作。对照中国证监会的季度监察稽核项目表，对本基金的守法合规情况进行逐条检视。此外，在公司审计部对投研部门展开的专项稽核中，也会对本基金的业务进行全面检查。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

统估值模型及估值结果进行检查，确保估值委员会决议的有效执行，负责基金估值业务的定期和临时信息披露。

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

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

本基金本报告期内未发生基金份额持有人数不满两百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人——兴证全球基金管理有限公司 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

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

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



## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(23)第 P00666 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 全体持有人
审计意见	<p>我们审计了兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 的财务报表, 包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表, 2022 年度的利润表、净资产 (基金净值) 变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为, 后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制, 公允反映了兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则, 我们独立于兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF), 并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	<p>兴证全球基金管理有限公司 (以下简称“基金管理人”) 管理层对其他信息负责。其他信息包括兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 年度报告中涵盖的信息, 但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息, 我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计, 我们的责任是阅读其他信息, 在此过程中, 考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作, 如果我们确定其他信息存在重大错报, 我们应当报告该事实。在这方面, 我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责	基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督

任	<p>管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金(LOF)的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金(LOF)、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金(LOF)的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金(LOF)持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金(LOF)不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出</p>

	的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	吴凌志	冯适
会计师事务所的地址	上海市黄浦区延安东路 222 号外滩中心 30 楼	
审计报告日期	2023 年 3 月 27 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	1,379,850.38	10,118,006.07
结算备付金		5,549,263.85	6,694,211.62
存出保证金		149,966.40	103,630.16
交易性金融资产	7.4.7.2	5,002,916,985.86	4,812,198,852.24
其中：股票投资		4,599,039,198.17	4,379,185,139.40
基金投资		-	-
债券投资		403,877,787.69	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		2,838,028.73	15,327,355.12
应收股利		-	-
应收申购款		8,562,012.17	6,601,872.40
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	4,585,385.93
资产总计		5,021,396,107.39	4,855,629,313.54
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		165,388,535.24	228,093,047.42
应付清算款		4,143,749.04	-
应付赎回款		4,603,259.68	28,206,989.28
应付管理人报酬		3,271,718.40	3,178,636.84
应付托管费		613,447.19	595,994.40
应付销售服务费		68,620.59	50,014.24
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,393.67	2,011.25
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	964,883.52	842,132.30
负债合计		179,055,607.33	260,968,825.73
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	2,198,593,539.25	1,793,592,941.08
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	2,643,746,960.81	2,801,067,546.73
净资产合计		4,842,340,500.06	4,594,660,487.81
负债和净资产总计		5,021,396,107.39	4,855,629,313.54

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，兴全沪深 300 指数 (LOF) A 基金份额净值 2.2036 元，基金份额总额 2,101,102,660.74 份；兴全沪深 300 指数 C 基金份额净值 2.1773 元，基金份额总额 97,490,878.51 份。兴全沪深 300 指数 (LOF) 份额总额合计为 2,198,593,539.25 份。以上比较数据已根据《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。

## 7.2 利润表

会计主体：兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-581,490,085.75	-253,442,648.17
1. 利息收入		159,960.69	8,388,891.58
其中：存款利息收入	7.4.7.13	157,042.66	178,669.91
债券利息收入		-	8,164,786.94

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,918.03	45,434.73
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益 (损失以“-”填列)		135,843,926.76	313,722,967.11
其中: 股票投资收益	7.4.7.14	-22,696,051.33	199,367,935.58
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	29,883,056.80	14,543,956.81
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	128,656,921.29	99,811,074.72
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)	7.4.7.20	-718,449,373.40	-579,868,868.31
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	7.4.7.21	955,400.20	4,314,361.45
<b>减: 二、营业总支出</b>		48,120,376.54	58,065,137.76
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	35,501,684.50	40,241,731.59
2. 托管费	7.4.10.2.2	6,656,565.92	7,545,324.72
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	598,435.06	582,035.94
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		4,412,686.36	5,525,867.44
其中: 卖出回购金融资产支出		4,412,686.36	5,525,867.44
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		2,511.97	3,394.92
8. 其他费用	7.4.7.23	948,492.73	4,166,783.15
<b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b>		-629,610,462.29	-311,507,785.93
减: 所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-629,610,462.29	-311,507,785.93
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-629,610,462.29	-311,507,785.93

注：以上比较数据已根据《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的“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。

### 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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、本年期初净资产（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）	405,000,598.17	-	-157,320,585.92	247,680,012.25
（一）、综合收益总额	-	-	-629,610,462.29	-629,610,462.29
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动	405,000,598.17	-	472,289,876.37	877,290,474.54

数 (净值减少以“-”号填列)				
其中: 1. 基金申购款	951,919,552.20	-	1,157,792,583.22	2,109,712,135.42
2. 基金赎回款	-546,918,954.03	-	-685,502,706.85	-1,232,421,660.88
(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)	2,198,593,539.25	-	2,643,746,960.81	4,842,340,500.06
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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）	-245,042,010.77	-	-738,723,825.80	-983,765,836.57
（一）、综合收益总额	-	-	-311,507,785.93	-311,507,785.93
（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）	-245,042,010.77	-	-427,216,039.87	-672,258,050.64
其中：1. 基金申购款	1,295,191,338.88	-	2,183,069,481.67	3,478,260,820.55
2. 基金赎回款	-	-	-	-4,150,518,871.19
	1,540,233,349.65		2,610,285,521.54	
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产（基金净值）	1,793,592,941.08	-	2,801,067,546.73	4,594,660,487.81

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：



杨华辉

庄园芳

詹鸿飞

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

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

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

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

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

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制, 同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和基金净值变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

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

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时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以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产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。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

##### (2) 金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无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。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金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。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期

损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，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的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在前一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然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，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若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风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债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，将其公允价值划分为三个层次。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。本基金主要金融工具的估值原则如下：

(1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

(3) 经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### (1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

##### (2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

#### (3) 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

#### (4) 信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

#### (5) 其他收入

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。

### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15% 的年费率逐日计提；

(3) 本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.40% 的年费率逐日计提。

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

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

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

### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金的每份基金份额享有同等分配权；

(2) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 60%；若基金合同生效不满 3 个月，可不进行收益分配；基金的收益分配比例应当以收益分配基准日可供分配利润为基准

计算。收益分配基准日可供分配利润指收益分配基准日本基金资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数；

(3) 基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，基金投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；（本基金场内份额的分红方式只能是现金分红。）基金实施收益分配的，基金红利发放日距离收益分配基准日，即收益分配基准日可供分配利润计算截止日，不得超过 15 个工作日；

(5) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。在不影响投资者利益的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介和基金管理人网站公告。

#### 7.4.4.12 外币交易

本基金本报告期内无外币交易。

#### 7.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

(2) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国

证监会公告[2017]13号)及《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13号)相关规定,本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值;

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

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

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》(以下合称“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 2022 年度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。

本基金自 2022 年 7 月 1 日起施行《资产管理产品相关会计处理规定》,并按相关衔接规定进行了处理。

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 0.00 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。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

#### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 税项

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《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，主要税项列示如下：

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

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

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期

限超过 1 年的, 股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税;

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

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

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	1,379,850.38	10,118,006.07
等于: 本金	1,378,183.60	10,118,006.07
加: 应计利息	1,666.78	-
减: 坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于: 本金	-	-
加: 应计利息	-	-
减: 坏账准备	-	-
其中: 存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于: 本金	-	-
加: 应计利息	-	-
减: 坏账准备	-	-
合计	1,379,850.38	10,118,006.07

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	4,281,202,419.17	-	4,599,039,198.17	317,836,779.00
贵金属投资- 金交所黄金 合约	-	-	-	-
债券 交易所 市场	148,801,124.07	478,255.03	159,794,519.20	10,515,140.10

	银行间市场	241,085,200.00	3,725,268.49	244,083,268.49	-727,200.00
	合计	389,886,324.07	4,203,523.52	403,877,787.69	9,787,940.10
	资产支持证券	-	-	-	-
	基金	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	4,671,088,743.24	4,203,523.52	5,002,916,985.86	327,624,719.10
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日				
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
	股票	3,370,575,605.98	-	4,379,185,139.40	1,008,609,533.42
	贵金属投资- 金交所黄金 合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	214,954,413.76	-	252,674,712.84	37,720,299.08
	银行间市场	180,594,740.00	-	180,339,000.00	-255,740.00
	合计	395,549,153.76	-	433,013,712.84	37,464,559.08
	资产支持证券	-	-	-	-
	基金	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	3,766,124,759.74	-	4,812,198,852.24	1,046,074,092.50

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

##### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有期货合约。

##### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有黄金衍生品。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末无各项买入返售金融资产期末余额。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未通过买断式逆回购交易取得债券。

## 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

## 7.4.7.5 债权投资

## 7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本报告期末及上年度末本基金均无债权投资。

## 7.4.7.5.2 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。

## 7.4.7.6 其他债权投资

## 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

## 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

## 7.4.7.7 其他权益工具投资

## 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

## 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应收利息	-	4,585,385.93
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	4,585,385.93

## 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	12,615.19	19,804.90
应付证券出借违约金	-	-

应付交易费用	410,372.77	361,266.03
其中：交易所市场	402,461.30	353,145.02
银行间市场	7,911.47	8,121.01
应付利息	-	93,996.12
预提信息披露费	120,000.00	120,000.00
应付指数使用费	365,895.56	191,065.25
预提审计费	56,000.00	56,000.00
合计	964,883.52	842,132.30

## 7.4.7.10 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 12 月 31 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	876,682,882.96	876,682,882.96
本期赎回 (以“-”号填列)	-511,232,081.25	-511,232,081.25
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	2,101,102,660.74	2,101,102,660.74

## 兴全沪深 300 指数 C

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	75,236,669.24	75,236,669.24
本期赎回 (以“-”号填列)	-35,686,872.78	-35,686,872.78
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	97,490,878.51	97,490,878.51

注：申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

## 7.4.7.11 其他综合收益

无。

## 7.4.7.12 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	86,845,473.58	-697,163,498.31	-610,318,024.73
本期基金份额交易产生的变动数	491,098,535.54	-63,541,558.21	427,556,977.33
其中：基金申购款	1,181,642,403.33	-112,053,637.52	1,069,588,765.81
基金赎回款	-690,543,867.79	48,512,079.31	-642,031,788.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,873,574,168.81	-344,607,565.45	2,528,966,603.36

## 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	1,993,437.53	-21,285,875.09	-19,292,437.56
本期基金份额交易产生的变动数	49,470,113.10	-4,737,214.06	44,732,899.04
其中：基金申购款	93,545,261.19	-5,341,443.78	88,203,817.41
基金赎回款	-44,075,148.09	604,229.72	-43,470,918.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	121,754,387.71	-6,974,030.26	114,780,357.45

## 7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
活期存款利息收入	39,144.95	41,138.72
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	113,835.50	128,952.50
其他	4,062.21	8,578.69
合计	157,042.66	178,669.91

## 7.4.7.14 股票投资收益

## 7.4.7.14.1 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资收益——买卖 股票差价收入	-22,696,051.33	199,367,935.58
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	-22,696,051.33	199,367,935.58

## 7.4.7.14.2 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12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
卖出股票成交总额	495,865,482.25	1,407,546,419.27
减：卖出股票成本 总额	516,523,689.64	1,208,178,483.69
减：交易费用	2,037,843.94	-
买卖股票差价收 入	-22,696,051.33	199,367,935.58

## 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

## 7.4.7.15 债券投资收益

## 7.4.7.15.1 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12月31 日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
债券投资收益——利息 收入	7,299,394.56	-
债券投资收益——买卖 债券（债转股及债券到 期兑付）差价收入	22,583,662.24	14,543,956.81
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	29,883,056.80	14,543,956.81

## 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	422,321,664.64	516,535,702.57
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	391,933,272.59	492,826,476.96
减：应计利息总额	7,794,474.11	9,165,268.80
减：交易费用	10,255.70	-
买卖债券差价收入	22,583,662.24	14,543,956.81

#### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债权投资收益赎回差价收入。

#### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债权投资收益申购差价收入。

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

##### 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.17 贵金属投资收益

##### 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

##### 7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。



## 7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.18 衍生工具收益

## 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未投资衍生工具。

## 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12 月31日
股票投资产生的股利收益	128,656,921.29	99,811,074.72
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	128,656,921.29	99,811,074.72

## 7.4.7.20 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 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
1. 交易性金融资产	-718,449,373.40	-579,868,868.31
股票投资	-690,772,754.42	-603,964,126.31
债券投资	-27,676,618.98	24,095,258.00
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	-718,449,373.40	-579,868,868.31

## 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	950,624.89	4,193,273.70
基金转换费收入	4,775.31	121,087.75
合计	955,400.20	4,314,361.45

## 7.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内无信用减值损失。

## 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
审计费用	56,000.00	56,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	25,258.94	30,316.27
账户维护费用	37,200.00	36,600.00
上市费用	-	60,000.00
指数使用费	710,033.79	804,834.61
其他费用	-	600.00
交易费用	-	3,058,432.27
合计	948,492.73	4,166,783.15

## 7.4.7.24 分部报告

无。

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

## 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

## 7.4.9 关联方关系

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

全球人寿保险国际公司 (AEGON International B.V)	基金管理人的股东
兴证全球资本管理(上海)有限公司(“兴证全球资本”)	基金管理人控制的公司

注：以下关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
兴业证券	1,708,364,861.11	100.00	1,906,711,411.79	100.00

##### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
兴业证券	164,572,422.54	100.00	141,284,366.84	100.00

##### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)
兴业证券	15,086,246,000.00	100.00	17,266,948,000.00	100.00

##### 7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
兴业证券	1,250,616.80	100.00	402,461.30	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
兴业证券	1,395,946.85	100.00	353,145.02	100.00

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

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	35,501,684.50
其中：支付销售机构的客户维护 费	12,038,023.83	11,837,648.99

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

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
	当期发生的基金应支付的托管费	6,656,565.92

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

##### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方 名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	兴全沪深 300 指数 (LOF) A	兴全沪深 300 指数 C	合计
兴业证券	-	796.63	796.63
兴证全球基金	-	40,199.75	40,199.75
合计	-	40,996.38	40,996.38
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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴全沪深 300 指数 (LOF) A	兴全沪深 300 指数 C	合计
兴证全球基金	-	38,895.29	38,895.29
合计	-	38,895.29	38,895.29

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 类基金份额前一日基金资产净值×年销售服务费率/当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

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

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

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

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

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

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

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

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

**7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
农业银行	1,379,850.38	39,144.95	10,118,006.07	41,138.72

注：本基金的银行存款由基金托管人农业银行保管，按银行同业利率计息。

**7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

**7.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项的说明。

**7.4.11 利润分配情况**

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

**7.4.12 期末（2022年12月31日）本基金持有的流通受限证券****7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	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
002044	美年健康	2022年11月1日	6个月	大宗交易购入流通受限	3.93	5.75	3,000,000	11,790,000.00	17,250,000.00	-
002044	美年健康	2022年11月	6个月	大宗交	4.75	5.75	1,000,000	4,750,000.00	5,750,000.00	-

	康	月 29 日		易 购 入 流 通 受 限						
002044	美 年 健 康	2022 年 12 月 7 日	6 个 月	大 宗 交 易 购 入 流 通 受 限	5.02	5.74	1,400,000	7,028,000.00	8,036,000.00	-
002044	美 年 健 康	2022 年 9 月 30 日	6 个 月	大 宗 交 易 购 入 流 通 受 限	3.82	5.77	1,100,000	4,202,000.00	6,347,000.00	-
002607	中 公 教 育	2022 年 11 月 3 日	6 个 月	大 宗 交 易 购 入 流 通 受 限	4.33	4.28	3,530,000	15,284,900.00	15,108,400.00	-
002607	中 公 教 育	2022 年 11 月 4 日	6 个 月	大 宗 交 易 购 入 流	4.50	4.28	500,000	2,250,000.00	2,140,000.00	-

				通受限						
002841	视源股份	2022年8月10日	6个月	非公开发 行流通 受限	67.72	58.32	823,981	55,799,993.32	48,054,571.92	-
002841	视源股份	2022年9月14日	6个月	大宗交易 购入流 通受限	59.11	57.78	120,000	7,093,200.00	6,933,600.00	-
002841	视源股份	2022年9月15日	6个月	大宗交易 购入流 通受限	58.24	57.33	90,000	5,241,600.00	5,159,700.00	-
002841	视源股份	2022年9月19日	6个月	大宗交易 购入流 通受限	57.38	57.27	120,000	6,885,600.00	6,872,400.00	-
300045	华力	2022年7月	6个月	非公	6.81	6.43	558,002	3,799,993.62	3,587,952.86	-



	创通	月 26 日		开发 行流 通受 限						
300131	英唐智控	2022 年8 月9 日	6个 月	非公 开发 行流 通受 限	4.53	4.73	1,147,903	5,200,000.59	5,429,581.19	-
301095	广立微	2022 年7 月28 日	6个 月	新股 流通 受限	58.00	86.49	740	42,920.00	64,002.60	-
301121	紫建电子	2022 年8 月1 日	6个 月	新股 流通 受限	61.07	49.77	290	17,710.30	14,433.30	-
301132	满坤科技	2022 年8 月3 日	6个 月	新股 流通 受限	26.80	24.48	468	12,542.40	11,456.64	-
301152	天力锂能	2022 年8 月19 日	6个 月	新股 流通 受限	57.00	46.64	433	24,681.00	20,195.12	-
301161	唯万密封	2022 年9 月6 日	6个 月	新股 流通 受限	18.66	21.73	346	6,456.36	7,518.58	-

				受限						
301171	易点天下	2022年8月10日	6个月	新股流通受限	18.18	17.72	985	17,907.30	17,454.20	-
301176	逸豪新材	2022年9月21日	6个月	新股流通受限	23.88	16.89	544	12,990.72	9,188.16	-
301195	北路智控	2022年7月25日	6个月	新股流通受限	71.17	73.04	330	23,486.10	24,103.20	-
301197	工大科雅	2022年7月29日	6个月	新股流通受限	25.50	20.08	380	9,690.00	7,630.40	-
301223	中荣股份	2022年10月13日	6个月	新股流通受限	26.28	18.13	815	21,418.20	14,775.95	-
301227	森鹰窗业	2022年9月16日	6个月	新股流通受限	38.25	29.49	284	10,863.00	8,375.16	-
301230	泓博医药	2022年10月21日	6个月	新股流通受限	40.00	48.32	269	10,760.00	12,998.08	-

301231	荣信文化	2022年8月31日	6个月	新股流通受限	25.49	20.38	275	7,009.75	5,604.50	-
301233	盛帮股份	2022年6月24日	6个月	新股流通受限	41.52	34.30	158	6,560.16	5,419.40	-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	6个月	新股流通受限	33.65	69.68	575	19,348.75	40,066.00	-
301265	华新环保	2022年12月8日	6个月	新股流通受限	13.28	11.40	819	10,876.32	9,336.60	-
301267	华夏眼科	2022年10月26日	6个月	新股流通受限	50.88	66.20	1,006	51,185.28	66,597.20	-
301269	华大九天	2022年7月21日	6个月	新股流通受限	32.69	87.94	1,168	38,181.92	102,713.92	-
301270	汉仪股份	2022年8月19日	6个月	新股流通受限	25.68	28.37	210	5,392.80	5,957.70	-
301276	嘉曼	2022年9月	6个月	新股	40.66	22.61	303	12,319.98	6,850.83	-

	服饰	月 1 日		流通受限						
301277	新天地	2022 年 11 月 9 日	6 个月	新股流通受限	27.00	25.78	439	11,853.00	11,317.42	-
301280	珠城科技	2022 年 12 月 19 日	6 个月	新股流通受限	67.40	44.80	279	18,804.60	12,499.20	-
301283	聚胶股份	2022 年 8 月 26 日	6 个月	新股流通受限	52.69	51.41	235	12,382.15	12,081.35	-
301296	新巨丰	2022 年 8 月 26 日	6 个月	新股流通受限	18.19	14.90	1,042	18,953.98	15,525.80	-
301301	川宁生物	2022 年 12 月 20 日	6 个月	新股流通受限	5.00	7.53	3,574	17,870.00	26,912.22	-
301306	西测测试	2022 年 7 月 19 日	6 个月	新股流通受限	43.23	42.29	255	11,023.65	10,783.95	-
301308	江波龙	2022 年 7 月 27 日	6 个月	新股流通	55.67	56.72	819	45,593.73	46,453.68	-

		日		受限						
301313	凡拓数创	2022年9月22日	6个月	新股流通受限	25.25	29.14	247	6,236.75	7,197.58	-
301316	慧博云通	2022年9月29日	6个月	新股流通受限	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88	-
301318	维海德	2022年8月3日	6个月	新股流通受限	64.68	41.74	206	13,324.08	8,598.44	-
301319	唯特偶	2022年9月22日	6个月	新股流通受限	47.75	53.27	115	5,491.25	6,126.05	-
301327	华宝新能	2022年9月8日	6个月	新股流通受限	237.50	176.97	242	57,475.00	42,826.74	-
301328	维峰电子	2022年8月30日	6个月	新股流通受限	78.80	76.96	191	15,050.80	14,699.36	-
301330	熵基科技	2022年8月10日	6个月	新股流通受限	43.32	31.31	694	30,064.08	21,729.14	-

301339	通行宝	2022年9月2日	6个月	新股流通受限	18.78	15.59	913	17,146.14	14,233.67	-
301349	信德新材	2022年8月30日	6个月	新股流通受限	138.88	103.52	180	24,998.40	18,633.60	-
301359	东南电子	2022年11月2日	6个月	新股流通受限	20.84	19.90	328	6,835.52	6,527.20	-
301361	众智科技	2022年11月8日	6个月	新股流通受限	26.44	20.96	517	13,669.48	10,836.32	-
301363	美好医疗	2022年9月28日	6个月	新股流通受限	30.66	37.85	445	13,643.70	16,843.25	-
301365	矩阵股份	2022年11月14日	6个月	新股流通受限	34.72	23.87	516	17,915.52	12,316.92	-
301366	一博科技	2022年9月19日	6个月	新股流通受限	65.35	45.09	268	17,513.80	12,084.12	-
301377	鼎泰	2022年	6个月	新股	22.88	17.63	770	17,617.60	13,575.10	-

	高科	11月11日		流通受限						
301389	隆扬电子	2022年10月18日	6个月	新股流通受限	22.50	17.16	1,269	28,552.50	21,776.04	-
301391	卡莱特	2022年11月24日	6个月	新股流通受限	96.00	80.97	247	23,712.00	19,999.59	-
688031	星环科技	2022年10月11日	6个月	新股流通受限	47.34	78.80	12,047	570,304.98	949,303.60	-
688143	长盈通	2022年12月1日	6个月	新股流通受限	35.67	42.66	1,938	69,128.46	82,675.08	-
688271	联影医疗	2022年8月12日	6个月	新股流通受限	109.88	171.68	7,365	809,266.20	1,264,423.20	-
688303	大全能源	2022年7月22日	6个月	非公开发行流通受限	51.79	47.02	154,470	8,000,001.30	7,263,179.40	-
688353	华	2022	6个	新	98.35	63.86	4,358	428,609.30	278,301.88	-

	盛锂电	年 7 月 6 日	月	股流通受限						
688370	从麟科技	2022 年 8 月 17 日	6 个月	新股流通受限	59.76	34.87	3,254	194,459.04	113,466.98	-
688373	盟科药业	2022 年 7 月 29 日	6 个月	新股流通受限	8.16	8.54	31,886	260,189.76	272,306.44	-
688391	钜泉科技	2022 年 9 月 5 日	6 个月	新股流通受限	115.00	95.83	1,397	160,655.00	133,874.51	-
688439	振华风光	2022 年 8 月 19 日	6 个月	新股流通受限	66.99	114.86	7,096	475,361.04	815,046.56	-
688489	三未信安	2022 年 11 月 25 日	6 个月	新股流通受限	78.89	90.62	1,995	157,385.55	180,786.90	-

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌的流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末 2022 年 12 月 31 日，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额 68,878,897.15 元，是以如下证券作为抵押：



金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量 (张)	期末估值总额
200009	20 付息国债 09	2023 年 1 月 5 日	101.30	300,000	30,390,969.86
220408	22 农发 08	2023 年 1 月 5 日	100.18	20,000	2,003,668.49
200202	20 国开 02	2023 年 1 月 9 日	101.31	110,000	11,144,166.30
210212	21 国开 12	2023 年 1 月 9 日	102.86	300,000	30,858,698.63
合计				730,000	74,397,503.28

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末 2022 年 12 月 31 日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 96,509,638.09 元,于 2023 年 1 月 3 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算标准券后,不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注:本基金本报告期末未持有因参与转融通证券出借业务的证券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

#### 7.4.13.2 信用风险

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

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

**7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

**7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

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

**7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

**7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	140,699,870.09	192,609,440.63
AAA 以下	8,965,325.82	6,063,516.81
未评级	-	-
合计	149,665,195.91	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。

**7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

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

**7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

**7.4.13.3 流动性风险**

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

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

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

**7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析**

注：无。

### 7.4.13.3.2 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。

### 7.4.13.4 市场风险

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

#### 7.4.13.4.1 利率风险

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 202 2 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	1,379,850.38	-	-	-	-	-	1,379,850.38
结算备付金	5,549,263.85	-	-	-	-	-	5,549,263.85
存出保证金	149,966.40	-	-	-	-	-	149,966.40
交易性金融资产	30,606,386.30	41,281,619.18	195,136,138.48	131,479,807.65	5,373,836.08	4,599,039,198.17	5,002,916,985.86
应收申购款	173,324.55	-	-	-	-	8,388,687.62	8,562,012.17
应收清算款	-	-	-	-	-	2,838,028.73	2,838,028.73
资产总计	37,858,791.48	41,281,619.18	195,136,138.48	131,479,807.65	5,373,836.08	4,610,265,914.52	5,021,396,107.39
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,603,259.68	4,603,259.68
应付	-	-	-	-	-	3,271,718.40	3,271,718.40

管理人报酬							
应付托管费	-	-	-	-	-	613,447.19	613,447.19
应付清算款	-	-	-	-	-	4,143,749.04	4,143,749.04
卖出回购金融资产款	165,388,535.24	-	-	-	-	-	165,388,535.24
应付销售服务费	-	-	-	-	-	68,620.59	68,620.59
应交税费	-	-	-	-	-	1,393.67	1,393.67
其他负债	-	-	-	-	-	964,883.52	964,883.52
负债总计	165,388,535.24	-	-	-	-	13,667,072.09	179,055,607.33
利率	127,529,743.18	41,281,619.18	195,136,138.48	131,479,807.65	5,373,836.08	4,596,598,842.43	4,842,340,500.06

敏感度缺口	.76						
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	-	-	-	-	-	15,327,355.1	15,327,355.1

收证券清算款						2	2
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	-	-	-	-	-	50,014.24	50,014.24

售服务费							
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了分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他影响债券公允价值的变量保持不变，仅利率发生变动；		
	假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化(即平移收益率曲线)。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末(2022年12月31日)	上年度末(2021年12月31日)
分析	利率+1%	-969,621.00	-850,020.78
	利率-1%	979,918.88	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，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基



金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 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	4,599,039,198.17	94.98	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	403,877,787.69	8.34	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	5,002,916,985.86	103.32	4,812,198,852.24	104.73

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假设单个证券的公允价值和市场组合的公允价值依照资本-资产定价模型 (CAPM) 描述的规律进行变动
----	---

	使用本基金业绩比较基准所对应的市场组合进行分析		
	在业绩基准变化 10%时, 对单个证券相应的公允价值变化进行加总得到基金净值的变化		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 (2022 年 12 月 31 日)	上年度末 (2021 年 12 月 31 日)
分析	业绩比较基准+10%	486, 180, 684. 27	470, 489, 213. 99
	业绩比较基准-10%	-486, 180, 684. 27	-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。

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注: 无。

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	4, 553, 274, 383. 01	4, 255, 510, 082. 27
第二层次	306, 776, 637. 17	337, 729, 080. 29
第三层次	142, 865, 965. 68	218, 959, 689. 68
合计	5, 002, 916, 985. 86	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。

#### 7.4.14.2.2 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。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	218,959,689.68	218,959,689.68
当期购买	-	197,406,860.16	197,406,860.16
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	241,681,904.72	241,681,904.72
当期利得或损失总额	-	-31,818,679.44	-31,818,679.44
其中：计入损益的利得或损失	-	-31,818,679.44	-31,818,679.44
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	142,865,965.68	142,865,965.68
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	1,604,561.05	1,604,561.05
项目	上年度可比同期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	281,134,895.07	281,134,895.07

当期购买	-	463,790,658.54	463,790,658.54
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	574,373,414.77	574,373,414.77
当期利得或损失总额	-	48,407,550.84	48,407,550.84
其中：计入损益的利得或损失	-	48,407,550.84	48,407,550.84
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	218,959,689.68	218,959,689.68
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	31,900,006.53	31,900,006.53

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	142,865,965.68	平均价格亚式期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.1444-2.4756	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	218,959,689.68	平均价格亚式期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.1253-2.7417	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 12 月 31 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)。

#### 7.4.14.4 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银行存款、应收款项、买入返售金融资产和其他金融负债等，其账面价值与公允价值相若。

#### 7.4.15 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，分项和合计项之间可能存在尾差。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	4,599,039,198.17	91.59
	其中：股票	4,599,039,198.17	91.59
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	403,877,787.69	8.04
	其中：债券	403,877,787.69	8.04
	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	6,929,114.23	0.14
8	其他各项资产	11,550,007.30	0.23
9	合计	5,021,396,107.39	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	3,059,963.66	0.06
B	采矿业	203,701,945.62	4.21
C	制造业	2,085,462,342.01	43.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	112,114,529.00	2.32
E	建筑业	63,120,201.40	1.30
F	批发和零售业	2,209,194.00	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	135,038,169.11	2.79
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	115,497,624.46	2.39
J	金融业	1,158,247,872.30	23.92
K	房地产业	127,724,836.38	2.64
L	租赁和商务服务业	315,103,277.68	6.51

M	科学研究和技术服务业	1,462,131.00	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	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	8,821,316.96	0.18
S	综合	-	-
	合计	4,331,563,403.58	89.45

### 8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	25,125,180.80	0.52
C	制造业	144,750,499.38	2.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	115,491.12	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	6,815,163.85	0.14
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	5,813,506.76	0.12
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	153,406.39	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	113,466.98	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	27,846,224.61	0.58
Q	卫生和社会工作	56,737,250.20	1.17
R	文化、体育和娱乐业	5,604.50	0.00

S	综合	-	-
	合计	267,475,794.59	5.52

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	601888	中国中免	1,439,800	311,039,994.00	6.42
2	600519	贵州茅台	172,600	298,080,200.00	6.16
3	601601	中国太保	8,688,839	213,050,332.28	4.40
4	000895	双汇发展	8,059,300	208,977,649.00	4.32
5	601318	中国平安	4,038,863	189,826,561.00	3.92
6	601009	南京银行	14,288,845	148,889,764.90	3.07
7	600036	招商银行	3,948,870	147,134,896.20	3.04
8	600741	华域汽车	7,348,816	127,354,981.28	2.63
9	000100	TCL 科技	33,988,800	126,438,336.00	2.61
10	000938	紫光股份	6,298,829	122,890,153.79	2.54
11	002841	视源股份	1,695,881	99,014,047.92	2.04
12	000858	五粮液	527,329	95,283,077.01	1.97
13	300124	汇川技术	1,228,200	85,359,900.00	1.76
14	600690	海尔智家	3,478,800	85,091,448.00	1.76
15	600309	万华化学	883,959	81,898,801.35	1.69
16	601336	新华保险	2,655,880	79,888,870.40	1.65
17	601225	陕西煤业	4,258,807	79,128,634.06	1.63
18	601166	兴业银行	4,398,818	77,375,208.62	1.60
19	000001	平安银行	4,718,880	62,100,460.80	1.28
20	001979	招商蛇口	4,398,883	55,557,892.29	1.15
21	603799	华友钴业	895,150	49,797,194.50	1.03
22	601628	中国人寿	1,330,978	49,405,903.36	1.02
23	002555	三七互娱	2,618,882	47,401,764.20	0.98
24	601088	中国神华	1,708,808	47,197,276.96	0.97
25	000568	泸州老窖	199,800	44,811,144.00	0.93
26	601838	成都银行	2,762,200	42,261,660.00	0.87
27	002352	顺丰控股	668,836	38,631,967.36	0.80
28	600406	国电南瑞	1,488,839	36,327,671.60	0.75
29	000069	华侨城 A	6,698,800	35,704,604.00	0.74
30	000333	美的集团	688,891	35,684,553.80	0.74
31	601899	紫金矿业	3,561,580	35,615,800.00	0.74
32	600900	长江电力	1,626,080	34,147,680.00	0.71

33	000538	云南白药	570,772	31,027,165.92	0.64
34	600019	宝钢股份	5,488,836	30,682,593.24	0.63
35	000651	格力电器	928,891	30,021,757.12	0.62
36	002142	宁波银行	918,800	29,815,060.00	0.62
37	601138	工业富联	3,238,304	29,727,630.72	0.61
38	601668	中国建筑	5,388,900	29,261,727.00	0.60
39	600760	中航沈飞	478,800	28,072,044.00	0.58
40	601816	京沪高铁	5,668,800	27,890,496.00	0.58
41	002821	凯莱英	184,896	27,364,608.00	0.57
42	601360	三六零	4,178,869	27,329,803.26	0.56
43	601006	大秦铁路	3,918,800	26,177,584.00	0.54
44	600276	恒瑞医药	673,119	25,935,275.07	0.54
45	600674	川投能源	2,018,800	24,689,924.00	0.51
46	300450	先导智能	578,816	23,297,344.00	0.48
47	600795	国电电力	5,188,800	22,156,176.00	0.46
48	600028	中国石化	5,058,885	22,056,738.60	0.46
49	002938	鹏鼎控股	799,226	21,930,761.44	0.45
50	600009	上海机场	378,800	21,860,548.00	0.45
51	600436	片仔癀	71,813	20,715,177.98	0.43
52	601985	中国核电	3,448,835	20,693,010.00	0.43
53	600048	保利发展	1,328,800	20,104,744.00	0.42
54	000063	中兴通讯	748,100	19,345,866.00	0.40
55	600584	长电科技	798,735	18,410,841.75	0.38
56	601012	隆基绿能	415,026	17,538,998.76	0.36
57	600196	复星医药	483,400	17,035,016.00	0.35
58	600383	金地集团	1,598,983	16,357,596.09	0.34
59	601398	工商银行	3,588,820	15,575,478.80	0.32
60	000338	潍柴动力	1,480,800	15,074,544.00	0.31
61	600016	民生银行	4,281,133	14,769,908.85	0.31
62	601818	光大银行	4,799,800	14,735,386.00	0.30
63	000157	中联重科	2,688,898	14,627,605.12	0.30
64	600585	海螺水泥	530,873	14,535,302.74	0.30
65	600000	浦发银行	1,918,800	13,968,864.00	0.29
66	601169	北京银行	3,228,839	13,916,296.09	0.29
67	600660	福耀玻璃	381,800	13,389,726.00	0.28
68	600332	白云山	440,900	13,134,411.00	0.27
69	601390	中国中铁	2,288,800	12,725,728.00	0.26
70	002120	韵达股份	788,800	11,342,944.00	0.23
71	002050	三花智控	528,800	11,221,136.00	0.23
72	601898	中煤能源	1,288,800	11,109,456.00	0.23
73	600893	航发动力	254,302	10,751,888.56	0.22
74	601600	中国铝业	2,388,800	10,677,936.00	0.22
75	300142	沃森生物	263,800	10,602,122.00	0.22



76	600926	杭州银行	758,800	9,925,104.00	0.20
77	601117	中国化学	1,218,800	9,677,272.00	0.20
78	300601	康泰生物	300,000	9,459,000.00	0.20
79	000768	中航西飞	370,000	9,416,500.00	0.19
80	601939	建设银行	1,658,800	9,339,044.00	0.19
81	002601	龙佰集团	478,852	9,059,879.84	0.19
82	300413	芒果超媒	293,848	8,821,316.96	0.18
83	603993	洛阳钼业	1,888,800	8,594,040.00	0.18
84	601633	长城汽车	288,800	8,554,256.00	0.18
85	601229	上海银行	1,399,836	8,273,030.76	0.17
86	601877	正泰电器	281,824	7,806,524.80	0.16
87	601989	中国重工	2,188,800	7,638,912.00	0.16
88	688303	大全能源	154,470	7,263,179.40	0.15
89	002594	比亚迪	27,448	7,053,312.56	0.15
90	600104	上汽集团	488,800	7,043,608.00	0.15
91	600085	同仁堂	155,800	6,961,144.00	0.14
92	000425	徐工机械	1,338,800	6,787,716.00	0.14
93	601328	交通银行	1,400,000	6,636,000.00	0.14
94	600989	宝丰能源	528,900	6,383,823.00	0.13
95	601186	中国铁建	812,000	6,276,760.00	0.13
96	002007	华兰生物	261,741	5,923,198.83	0.12
97	600025	华能水电	878,800	5,800,080.00	0.12
98	600362	江西铜业	325,613	5,675,434.59	0.12
99	603019	中科曙光	248,800	5,508,432.00	0.11
100	688036	传音控股	67,269	5,349,230.88	0.11
101	601021	春秋航空	80,487	5,171,289.75	0.11
102	600745	闻泰科技	96,100	5,052,938.00	0.10
103	600886	国投电力	427,300	4,627,659.00	0.10
104	002252	上海莱士	718,800	4,557,192.00	0.09
105	002271	东方雨虹	132,450	4,446,346.50	0.09
106	002008	大族激光	173,071	4,439,271.15	0.09
107	600606	绿地控股	1,472,680	4,388,586.40	0.09
108	603833	欧派家居	34,974	4,250,390.22	0.09
109	002027	分众传媒	608,276	4,063,283.68	0.08
110	601111	中国国航	373,900	3,963,340.00	0.08
111	300408	三环集团	128,885	3,958,058.35	0.08
112	000725	京东方 A	1,146,870	3,876,420.60	0.08
113	601688	华泰证券	281,500	3,586,310.00	0.07
114	002415	海康威视	100,000	3,468,000.00	0.07
115	601658	邮储银行	698,384	3,226,534.08	0.07
116	002241	歌尔股份	183,799	3,093,337.17	0.06
117	300498	温氏股份	155,882	3,059,963.66	0.06
118	002202	金风科技	250,000	2,750,000.00	0.06

119	000963	华东医药	47,205	2,209,194.00	0.05
120	002179	中航光电	38,094	2,200,309.44	0.05
121	000776	广发证券	132,300	2,049,327.00	0.04
122	000792	盐湖股份	81,000	1,837,890.00	0.04
123	601728	中国电信	394,011	1,650,906.09	0.03
124	000723	美锦能源	180,000	1,623,600.00	0.03
125	600570	恒生电子	39,000	1,577,940.00	0.03
126	002001	新和成	84,000	1,575,000.00	0.03
127	300760	迈瑞医疗	4,800	1,516,656.00	0.03
128	603259	药明康德	18,051	1,462,131.00	0.03
129	600999	招商证券	96,242	1,280,018.60	0.03
130	600111	北方稀土	49,600	1,242,480.00	0.03
131	300122	智飞生物	14,000	1,229,620.00	0.03
132	600588	用友网络	50,043	1,209,539.31	0.02
133	603986	兆易创新	10,000	1,024,700.00	0.02
134	600030	中信证券	50,000	995,500.00	0.02
135	601669	中国电建	111,600	790,128.00	0.02
136	002236	大华股份	51,416	581,514.96	0.01
137	600031	三一重工	29,241	462,007.80	0.01
138	600438	通威股份	10,000	385,800.00	0.01
139	601878	浙商证券	22,392	222,352.56	0.00
140	688599	天合光能	3,154	201,099.04	0.00
141	300433	蓝思科技	287	3,022.11	0.00
142	002916	深南电路	18	1,298.70	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	002044	美年健康	9,639,900	56,630,587.00	1.17
2	002773	康弘药业	2,598,000	40,762,620.00	0.84
3	002607	中公教育	6,318,947	27,846,224.61	0.58
4	600161	天坛生物	1,080,099	25,630,749.27	0.53
5	000983	山西焦煤	2,028,800	23,635,520.00	0.49
6	600195	中牧股份	1,618,800	18,810,456.00	0.39
7	000066	中国长城	1,639,800	16,725,960.00	0.35
8	002728	特一药业	465,100	10,488,005.00	0.22
9	300647	超频三	801,068	6,464,618.76	0.13
10	300131	英唐智控	1,147,903	5,429,581.19	0.11
11	300353	东土科技	500,000	4,460,000.00	0.09
12	300507	苏奥传感	777,300	4,321,788.00	0.09
13	300045	华力创通	558,002	3,587,952.86	0.07
14	603041	美思德	288,975	3,242,299.50	0.07
15	300383	光环新网	268,988	2,194,942.08	0.05

16	300695	兆丰股份	34,800	1,504,056.00	0.03
17	603496	恒为科技	98,000	1,490,580.00	0.03
18	600938	中国海油	98,004	1,489,660.80	0.03
19	688271	联影医疗	7,365	1,264,423.20	0.03
20	600536	中国软件	17,450	1,017,858.50	0.02
21	688031	星环科技	12,047	949,303.60	0.02
22	688439	振华风光	7,096	815,046.56	0.02
23	688275	万润新能	4,399	770,484.85	0.02
24	601933	永辉超市	200,762	732,781.30	0.02
25	300674	宇信科技	50,498	709,496.90	0.01
26	002024	ST 易购	288,077	651,054.02	0.01
27	688114	华大智造	5,336	592,882.96	0.01
28	688475	萤石网络	20,526	532,239.18	0.01
29	688382	益方生物	36,208	480,842.24	0.01
30	600718	东软集团	47,475	472,376.25	0.01
31	688061	灿瑞科技	3,972	370,786.20	0.01
32	688353	华盛锂电	4,358	278,301.88	0.01
33	688373	盟科药业	31,886	272,306.44	0.01
34	301391	卡莱特	2,470	210,066.09	0.00
35	688489	三未信安	1,995	180,786.90	0.00
36	688184	帕瓦股份	4,358	151,353.34	0.00
37	688391	钜泉科技	1,397	133,874.51	0.00
38	301280	珠城科技	2,783	132,065.20	0.00
39	301365	矩阵股份	5,160	129,624.36	0.00
40	301366	一博科技	2,672	124,831.72	0.00
41	688410	山外山	4,853	122,635.31	0.00
42	688132	邦彦技术	4,844	118,193.60	0.00
43	300335	迪森股份	25,327	115,491.12	0.00
44	688370	丛麟科技	3,254	113,466.98	0.00
45	301269	华大九天	1,168	102,713.92	0.00
46	301176	逸豪新材	5,431	94,661.79	0.00
47	688252	天德钰	5,201	87,220.77	0.00
48	688143	长盈通	1,938	82,675.08	0.00
49	688416	恒烁股份	2,147	81,607.47	0.00
50	301238	瑞泰新材	3,497	78,647.53	0.00
51	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.00
52	301267	华夏眼科	1,006	66,597.20	0.00
53	301095	广立微	740	64,002.60	0.00
54	301308	江波龙	819	46,453.68	0.00
55	301327	华宝新能	242	42,826.74	0.00
56	301239	普瑞眼科	575	40,066.00	0.00
57	301301	川宁生物	3,574	26,912.22	0.00
58	301195	北路智控	330	24,103.20	0.00

59	301389	隆扬电子	1,269	21,776.04	0.00
60	301330	熵基科技	694	21,729.14	0.00
61	301152	天力锂能	433	20,195.12	0.00
62	301349	信德新材	180	18,633.60	0.00
63	002899	英派斯	1,408	17,628.16	0.00
64	301171	易点天下	985	17,454.20	0.00
65	301363	美好医疗	445	16,843.25	0.00
66	301150	中一科技	258	16,643.58	0.00
67	301296	新巨丰	1,042	15,525.80	0.00
68	301223	中荣股份	815	14,775.95	0.00
69	301328	维峰电子	191	14,699.36	0.00
70	301121	紫建电子	290	14,433.30	0.00
71	301339	通行宝	913	14,233.67	0.00
72	301377	鼎泰高科	770	13,575.10	0.00
73	301230	泓博医药	269	12,998.08	0.00
74	301283	聚胶股份	235	12,081.35	0.00
75	301132	满坤科技	468	11,456.64	0.00
76	301277	新天地	439	11,317.42	0.00
77	301361	众智科技	517	10,836.32	0.00
78	301306	西测测试	255	10,783.95	0.00
79	001222	源飞宠物	434	10,758.86	0.00
80	301265	华新环保	819	9,336.60	0.00
81	301318	维海德	206	8,598.44	0.00
82	301227	森鹰窗业	284	8,375.16	0.00
83	301197	工大科雅	380	7,630.40	0.00
84	301161	唯万密封	346	7,518.58	0.00
85	301313	凡拓数创	247	7,197.58	0.00
86	301276	嘉曼服饰	303	6,850.83	0.00
87	301359	东南电子	328	6,527.20	0.00
88	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
89	301270	汉仪股份	210	5,957.70	0.00
90	301231	荣信文化	275	5,604.50	0.00
91	301233	盛帮股份	158	5,419.40	0.00
92	301316	慧博云通	359	5,140.88	0.00
93	601607	上海医药	98	1,747.34	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002841	视源股份	99,998,995.32	2.18
2	000895	双汇发展	75,467,522.00	1.64
3	600519	贵州茅台	67,574,112.68	1.47

4	600900	长江电力	66,110,672.00	1.44
5	601601	中国太保	63,666,033.00	1.39
6	600741	华域汽车	51,460,807.16	1.12
7	000938	紫光股份	47,121,901.02	1.03
8	601318	中国平安	45,261,113.00	0.99
9	600674	川投能源	37,496,110.00	0.82
10	601166	兴业银行	36,841,342.00	0.80
11	600036	招商银行	34,897,981.00	0.76
12	601888	中国中免	31,385,860.00	0.68
13	000066	中国长城	30,748,518.00	0.67
14	002607	中公教育	29,646,761.00	0.65
15	002044	美年健康	29,109,664.00	0.63
16	601138	工业富联	27,738,050.70	0.60
17	000001	平安银行	27,047,494.40	0.59
18	601006	大秦铁路	26,430,987.60	0.58
19	000538	云南白药	25,268,652.12	0.55
20	601009	南京银行	22,043,905.38	0.48

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600161	天坛生物	37,879,230.33	0.82
2	600900	长江电力	31,951,183.90	0.70
3	002607	中公教育	26,523,985.95	0.58
4	002044	美年健康	22,611,528.72	0.49
5	600674	川投能源	14,449,150.14	0.31
6	600690	海尔智家	13,271,861.00	0.29
7	601607	上海医药	12,629,310.56	0.27
8	002728	特一药业	10,908,716.64	0.24
9	600036	招商银行	10,831,581.00	0.24
10	601888	中国中免	10,591,278.85	0.23
11	601318	中国平安	10,107,391.00	0.22
12	601699	潞安环能	9,734,103.00	0.21
13	601601	中国太保	8,821,492.00	0.19
14	002773	康弘药业	8,672,258.00	0.19
15	300507	苏奥传感	8,093,984.94	0.18
16	600352	浙江龙盛	8,048,511.00	0.18
17	002624	完美世界	7,810,828.00	0.17
18	002915	中欣氟材	7,803,725.05	0.17
19	000066	中国长城	7,690,969.00	0.17
20	601360	三六零	7,568,443.73	0.16

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,427,150,502.83
卖出股票收入（成交）总额	495,865,482.25

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	50,591,854.79	1.04
2	央行票据	-	-
3	金融债券	203,620,736.99	4.21
	其中：政策性金融债	203,620,736.99	4.21
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）	149,665,195.91	3.09
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	403,877,787.69	8.34

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113050	南银转债	272,230	31,977,590.18	0.66
2	210212	21 国开 12	300,000	30,858,698.63	0.64
3	220201	22 国开 01	300,000	30,606,386.30	0.63
4	200313	20 进出 13	300,000	30,563,679.45	0.63
5	200402	20 农发 02	300,000	30,506,260.27	0.63

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

## 8.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司具有在报告编制日前一年内受到监管部门处罚的情况；本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

前十名证券的发行主体中，未见其他发行主体有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	149,966.40
2	应收清算款	2,838,028.73
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	8,562,012.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,550,007.30

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113050	南银转债	31,977,590.18	0.66
2	132020	19 蓝星 EB	22,489,427.03	0.46
3	110059	浦发转债	21,245,010.69	0.44

4	132018	G 三峡 EB1	17,263,066.18	0.36
5	113052	兴业转债	13,235,869.86	0.27
6	132014	18 中化 EB	12,811,552.18	0.26
7	113044	大秦转债	6,326,122.53	0.13
8	113042	上银转债	5,534,440.25	0.11
9	113641	华友转债	4,742,480.69	0.10
10	110079	杭银转债	2,204,384.68	0.05
11	110045	海澜转债	2,188,601.64	0.05
12	113021	中信转债	1,683,348.24	0.03
13	110053	苏银转债	1,302,740.44	0.03
14	110062	烽火转债	1,244,456.63	0.03
15	127012	招路转债	935,197.71	0.02
16	127005	长证转债	674,769.78	0.01
17	110057	现代转债	536,644.60	0.01
18	127015	希望转债	518,943.81	0.01
19	113053	隆 22 转债	437,800.58	0.01
20	127020	中金转债	414,798.51	0.01
21	110052	贵广转债	329,271.71	0.01
22	127006	敖东转债	290,405.99	0.01
23	128081	海亮转债	273,809.84	0.01
24	113024	核建转债	230,185.48	0.00
25	110060	天路转债	208,853.34	0.00
26	128075	远东转债	148,718.40	0.00
27	113530	大丰转债	135,451.54	0.00
28	128100	搜特转债	79,805.05	0.00
29	113060	浙 22 转债	48,319.24	0.00
30	113594	淳中转债	3,455.74	0.00
31	110043	无锡转债	3,329.32	0.00
32	113505	杭电转债	1,108.48	0.00
33	127061	美锦转债	1,064.88	0.00

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002044	美年健康	37,383,000.00	0.77	大宗交易购入流通受限
2	002607	中公教育	17,248,400.00	0.36	大宗交易购入流通受限



## 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
兴全沪深 300 指数 (LOF) A	625,926	3,356.79	119,163,833.86	5.67	1,981,938,826.88	94.33
兴全沪深 300 指数 C	50,315	1,937.61	1,521,026.68	1.56	95,969,851.83	98.44
合计	676,241	3,251.20	120,684,860.54	5.49	2,077,908,678.71	94.51

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

兴全沪深 300 指数 (LOF) A

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	陈周阳	2,023,860.00	5.03
2	钱春香	1,901,301.00	4.73
3	浙江德源智能科技股份有限公司	914,447.00	2.27
4	李广涛	777,144.00	1.93
5	钟贵洋	581,528.00	1.45
6	吴林萍	412,429.00	1.03
7	王磊	391,459.00	0.97
8	查晟	339,070.00	0.84
9	俞海荣	300,000.00	0.75
10	杨水华	285,200.00	0.71

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	兴全沪深 300 指数 (LOF) A	3,899,902.31	0.1856
	兴全沪深 300 指数 C	14,085.00	0.0144

	合计	3,913,987.31	0.1780
--	----	--------------	--------

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

#### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和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

#### 9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

注：本报告期末，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	兴全沪深 300 指数 (LOF) A	兴全沪深 300 指数 C
基金合同生效日 (2010 年 11 月 2 日) 基金份额总额	2,955,476,122.49	-
本报告期期初基金份额总额	1,735,651,859.03	57,941,082.05
本报告期基金总申购份额	876,682,882.96	75,236,669.24
减：本报告期基金总赎回份额	511,232,081.25	35,686,872.78
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,101,102,660.74	97,490,878.51

注：总申购份额含红利再投资、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

## 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 报告期内本基金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) 报告期内托管人的专门基金托管部门重大人事变动。

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。

## 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自 2015 年起连续 8 年聘请德勤华永会计师事务所 (特殊普通合伙) 为本基金提供审计服务。本年度应支付给所聘任的会计师事务所 5.6 万元人民币。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注: 本报告期内管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注: 本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位: 人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
兴业证券	3	1,708,364,861.11	100.00	1,250,616.80	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。

## 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
兴业证券	164,572,422.54	100.00	15,086,246,000.00	100.00	-	-

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于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、规定互联网站	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、规定互联网站	2022-01-06
3	关于旗下部分基金投资东土科技(300353)非公开发行的公告	证券时报、规定互联网站	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、规定互联网站	2022-01-19
5	关于旗下部分基金投资电光科技(002730)非公开发行的公告	证券时报、规定互联网站	2022-01-20
6	关于副总经理离任的公告	证券时报、规定互联网站	2022-01-21
7	关于旗下部分基金投资兆丰股份(300695)非公开发行的公告	证券时报、规定互联网站	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、规定互联网站	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、规定互联网站	2022-01-27
10	关于公司副总经理任职的公告	证券时报、规定互联网站	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、规定互联网站	2022-01-28
12	关于旗下部分基金投资宇信科技(300674)非公开发行的公告	证券时报、规定互联网站	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、规定互联网站	2022-03-15
14	关于旗下部分基金投资雪榕生物(300511)非公开发行的公告	证券时报、规定互联网站	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、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、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、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、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、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、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、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、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、规定互联网网站	2022-06-30
24	关于旗下部分基金投资超频三 (300647) 非公开发行股票的公告	证券时报、规定互联网网站	2022-07-01
25	关于调整旗下部分基金在华融证券股份有限公司费率优惠活动的公告	证券时报、规定互联网网站	2022-07-11
26	关于旗下部分基金投资华力创通 (300045) 非公开发行股票的公告	证券时报、规定互联网网站	2022-07-28
27	关于旗下部分基金投资英唐智控 (300131) 非公开发行股票的公告	证券时报、规定互联网网站	2022-08-11
28	关于旗下部分基金投资视源股份 (002841) 非公开发行股票的公告	证券时报、规定互联网网站	2022-08-12
29	关于增加国新证券为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、规定互联网网站	2022-09-13
30	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、规定互联网网站	2022-09-16
31	关于增加华宝证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、规定互联网网站	2022-09-27
32	关于增加玄元保险代理有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、规定互联网网站	2022-09-28
33	关于使用自有资金自购旗下权益类公募基金五千万的公告	证券时报、规定互联网网站	2022-10-18
34	关于关闭网上直销汇款交易的公告	证券时报、规定互联网网站	2022-10-24
35	关于增加渤海证券股份有限公司为	证券时报、规定互联网	2022-11-09

	旗下部分基金销售机构的公告	网站	
36	关于增加上海利得基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、规定互联网网站	2022-11-09
37	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、规定互联网网站	2022-11-17
38	关于我司网上直销平台汇通宝相关业务停止办理的通知	证券时报、规定互联网网站	2022-11-30
39	关于调整网上直销部分基金转换赎回回购优惠费率的公告	证券时报、规定互联网网站	2022-12-06
40	关于增加中银国际证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、规定互联网网站	2022-12-16
41	关于我司网上交易系统暂停服务的通知	证券时报、规定互联网网站	2022-12-16

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，故不涉及本项特有风险。							

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

2、“赎回份额”包含份额赎回、转换转出等导致投资者持有份额减少的情形。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

### 13.3 查阅方式

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

基金管理人客户服务中心电话: 400-678-0099, 021-38824536

兴证全球基金管理有限公司

2023 年 3 月 31 日