

兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金  
(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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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                              | 6         |
| <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                              | 8         |
| 3.3 其他指标                                | 12        |
| 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              | 14        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 14        |
| 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             | 14        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 15        |
| 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                | 16        |
| 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 | 17        |
| 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       | 17        |
| <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                                 | 21        |
| 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 .....            | 70        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                          | 73        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                         | 74        |
| 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 .....           | 75        |
| 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 .....        | 75        |
| 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 .....        | 75        |
| 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 .....           | 75        |
| 8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                          | 75        |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....                    | 75        |
| 8.12 投资组合报告附注 .....                                | 76        |
| <b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>                         | <b>76</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                        | 76        |
| 9.2 期末上市基金前十名持有人 .....                             | 77        |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....                     | 77        |
| 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 .....             | 78        |
| 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 ..... | 78        |
| <b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>                        | <b>78</b> |
| <b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>                           | <b>78</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                             | 78        |
| 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 .....             | 78        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....                  | 79        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                               | 79        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                        | 79        |
| 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 .....                | 79        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                       | 79        |
| 11.8 其他重大事件 .....                                  | 82        |
| <b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>                   | <b>85</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 .....           | 85        |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                          | 85        |
| <b>§ 13 备查文件目录 .....</b>                           | <b>85</b> |
| 13.1 备查文件目录 .....                                  | 85        |
| 13.2 存放地点 .....                                    | 85        |
| 13.3 查阅方式 .....                                    | 85        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                     |                         |                  |
|---------------------|-------------------------|------------------|
| 基金名称                | 兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) |                  |
| 基金简称                | 兴全合宜混合 (LOF)            |                  |
| 场内简称                | 兴全合宜                    |                  |
| 基金主代码               | 163417                  |                  |
| 基金运作方式              | 上市契约型开放式 (LOF)          |                  |
| 基金合同生效日             | 2018 年 1 月 23 日         |                  |
| 基金管理人               | 兴证全球基金管理有限公司            |                  |
| 基金托管人               | 招商银行股份有限公司              |                  |
| 报告期末基金份<br>额总额      | 12,549,949,378.15 份     |                  |
| 基金合同存续期             | 不定期                     |                  |
| 基金份额上市的<br>证券交易所    | 深圳证券交易所                 |                  |
| 上市日期                | 2018 年 4 月 23 日         |                  |
| 下属分级基金的基<br>金简称     | 兴全合宜混合 A                | 兴全合宜混合 C         |
| 下属分级基金的场<br>内简称     | 兴全合宜                    | 无                |
| 下属分级基金的交<br>易代码     | 163417                  | 005491           |
| 报告期末下属分级<br>基金的份额总额 | 11,756,817,375.17 份     | 793,132,002.98 份 |

注：1、本基金 A 类份额场内扩位简称：兴全合宜 LOF。

2、经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，管理人决定自 2020 年 2 月 13 日起增设兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) C 类份额（代码：005491），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   | 本基金在有效控制投资组合风险的前提下，追求资产净值的长期稳健增值。  |
| 投资策略   | 本基金为灵活配置混合型基金，投资策略细分为资产配置策略、股票投资策略，以及股指期货、国债期货投资策略等。   |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率× 60% +恒生指数收益率×20% +中国债券总指数收益率×20%   |
| 风险收益特征 | <p>本基金是一只混合型基金，预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。</p> <p>本基金除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。</p> <p>投资者可在二级市场买卖本基金 A 类份额，受市场供需关系等各种因素的影响，投资者买卖基金份额有可能面临相应的折溢价风险。</p> |

## 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                        | 招商银行股份有限公司             |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 杨卫东                                 | 张燕                     |
|             | 联系电话 | 021-20398888                        | 0755-83199084          |
|             | 电子邮箱 | yangwd@xqfunds.com                  | yan_zhang@cmbchina.com |
| 客户服务电话      |      | 4006780099, 021-38824536            | 95555                  |
| 传真          |      | 021-20398988                        | 0755-83195201          |
| 注册地址        |      | 上海市黄浦区金陵东路 368 号                    | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦   |
| 办公地址        |      | 上海市浦东新区芳甸路 1155 号<br>嘉里城办公楼 28-29 楼 | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦   |
| 邮政编码        |      | 201204                              | 518040                 |
| 法定代表人       |      | 杨华辉                                 | 缪建民                    |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                        |
|---------------------|------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 上海证券报                  |
| 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 类份额：中国证券登记结算有限责任公司<br>C 类份额：兴证全球基金管理有限公司 | A 类份额：北京市西城区太平桥大街 17 号<br>C 类份额：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            | 2020 年 2 月 13 日(基金合同生效日)-2020 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------|----------------|-------------------|----------------|-------------------|---|
|               | 兴全合宜混合 A         | 兴全合宜混合 C       | 兴全合宜混合 A          | 兴全合宜混合 C       | 兴全合宜混合 A          | 兴全合宜混合 C                                  |
| 本期已实现收益       | 2,424,944,450.14 | 161,217,926.34 | 4,165,419,710.70  | 211,701,235.57 | 8,945,882,369.77  | 147,182,492.21                            |
| 本期利润          | 5,688,727,198.35 | 357,895,378.93 | 263,659,101.83    | 57,163,890.60  | 10,907,578,580.06 | 158,689,960.15                            |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.4567          | -0.4485        | -0.0176           | -0.0639        | 0.7101            | 0.7651                                    |
| 本期加权平均净值利润率   | -29.30%          | -29.20%        | -0.88%            | -3.23%         | 49.18%            | 43.84%                                    |
| 本期基金份额净值增长率   | -22.08%          | -22.54%        | -0.04%            | -0.64%         | 71.77%            | 60.38%                                    |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2022 年末          |                | 2021 年末           |                | 2020 年末           |   |
| 期末可供          | 6,166,889,511.70 | 395,767,188.88 | 12,031,536,505.54 | 761,875,997.50 | 9,638,777,770.45  | 331,545,089.54                            |

|              |                   |                  |                   |                  |                   |                  |
|--------------|-------------------|------------------|-------------------|------------------|-------------------|------------------|
| 分配利润         |                   |                  |                   |                  |                   |                  |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.5245            | 0.4990           | 0.9075            | 0.8852           | 0.6447            | 0.6357           |
| 期末基金资产净值     | 17,923,706,886.87 | 1,188,899,191.86 | 25,940,189,438.54 | 1,665,764,596.14 | 29,262,641,699.20 | 1,015,842,842.95 |
| 期末基金份额净值     | 1.5245            | 1.4990           | 1.9565            | 1.9353           | 1.9572            | 1.9477           |
| 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  | 52.45%            | 23.44%           | 95.65%            | 59.36%           | 95.72%            | 60.38%           |

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

兴全合宜混合 A

| 阶段 | 份额净值 | 份额净值 | 业绩比较 | 业绩比较 | ①-③ | ②-④ |
|----|------|------|------|------|-----|-----|
|----|------|------|------|------|-----|-----|



|            | 增长率①    | 增长率标准差② | 基准收益率③  | 基准收益率标准差④ |        |       |
|------------|---------|---------|---------|-----------|--------|-------|
| 过去三个月      | 10.87%  | 1.85%   | 4.04%   | 1.19%     | 6.83%  | 0.66% |
| 过去六个月      | -10.63% | 1.57%   | -9.89%  | 0.99%     | -0.74% | 0.58% |
| 过去一年       | -22.08% | 1.75%   | -15.83% | 1.11%     | -6.25% | 0.64% |
| 过去三年       | 33.80%  | 1.49%   | -7.91%  | 1.03%     | 41.71% | 0.46% |
| 自基金合同生效起至今 | 52.45%  | 1.30%   | -11.34% | 1.00%     | 63.79% | 0.30% |

## 兴全合宜混合 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      | 10.71%   | 1.85%       | 4.04%      | 1.19%         | 6.67%  | 0.66% |
| 过去六个月      | -10.90%  | 1.57%       | -9.89%     | 0.99%         | -1.01% | 0.58% |
| 过去一年       | -22.54%  | 1.75%       | -15.83%    | 1.11%         | -6.71% | 0.64% |
| 自基金合同生效起至今 | 23.44%   | 1.50%       | -6.46%     | 1.01%         | 29.90% | 0.49% |

注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数×60%+恒生指数收益率×20% +中国债券总指数收益率×20%，在业绩比较基准的选取上主要基于如下考虑：其中，沪深 300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映 A 股市场总体发展趋势。恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制，以香港股票市场中的 50 家上市股票为成份股样本，以其发行量为权数的加权平均股价指数，是反映香港股市价格趋势最有影响的一种股价指数。中国债券总指数是由中央国债登记结算有限责任公司于 2001 年 12 月 31 日推出的债券指数。它是中国债券市场趋势的表征，也是债券组合投资管理业绩评估的有效工具。中国债券总指数为掌握我国债券市场价格总水平、波动幅度和变动趋势，测算债券投资回报率水平，判断债券供求动向提供了很好的依据。

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：

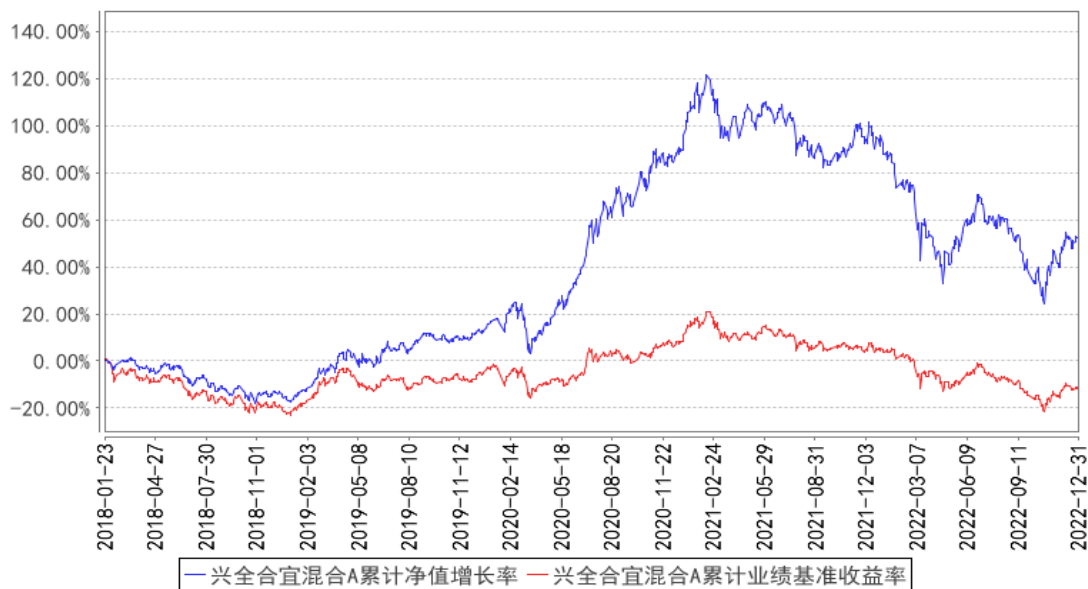
$$\text{Return}_t = 60\% \times (\text{沪深 300 指数}_t / \text{沪深 300 指数}_{t-1} - 1) + 20\% \times (\text{恒生指数收益率}_t / \text{恒生指数收益率}_{t-1} - 1) + 20\% \times (\text{中国债券总指数收益率}_t / \text{中国债券总指数收益率}_{t-1} - 1)$$

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

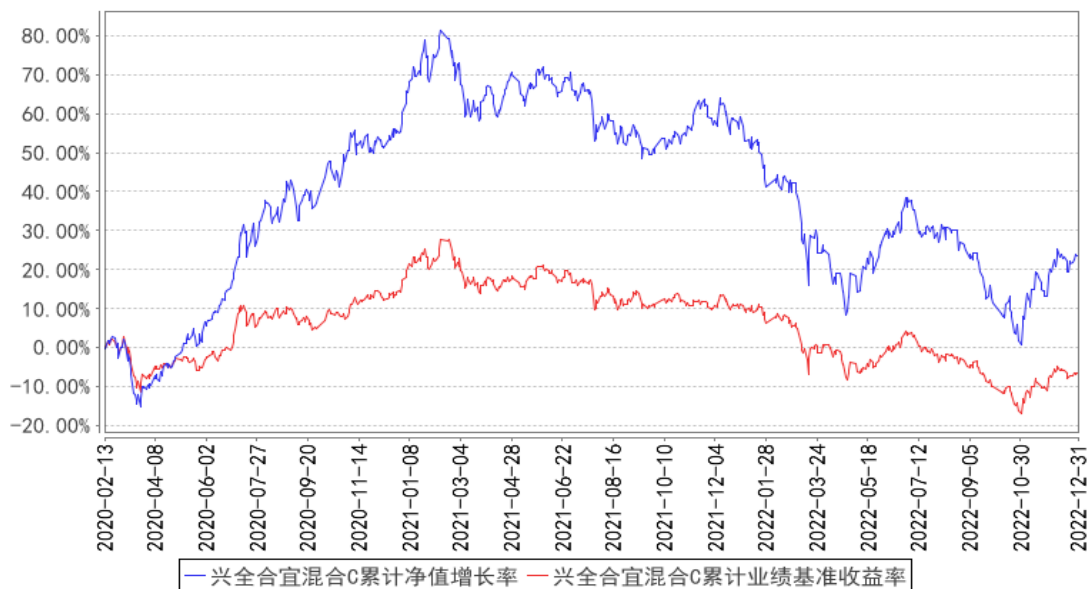
其中,  $t = 1, 2, 3, \dots, T$ ,  $T$  表示时间截至日。

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

兴全合宜混合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



兴全合宜混合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



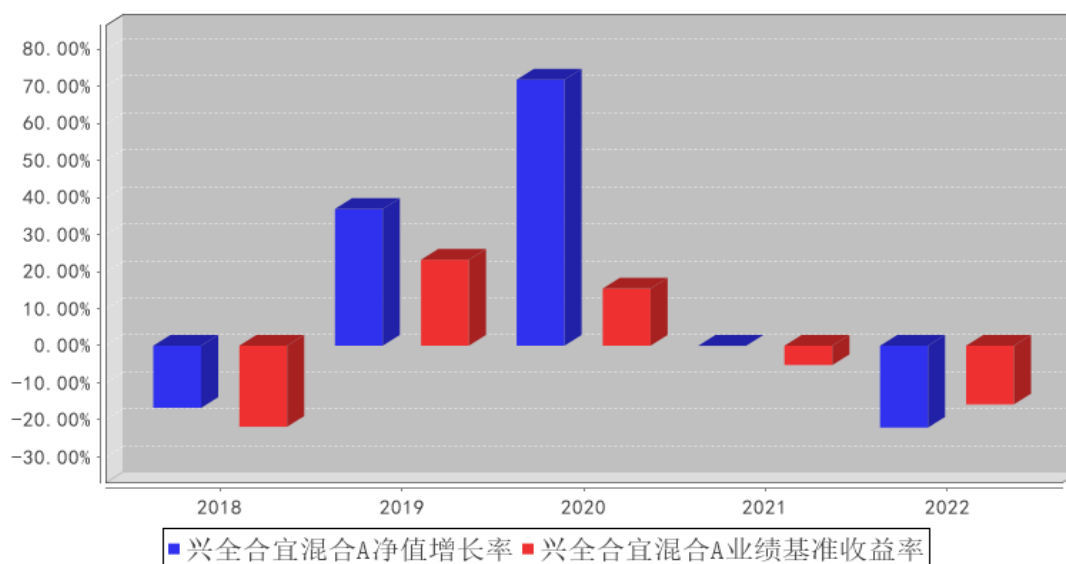
注：1、净值表现所取数据截至到 2022 年 12 月 31 日。

2、按照《兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 基金合同》的规定，本基金建仓期为

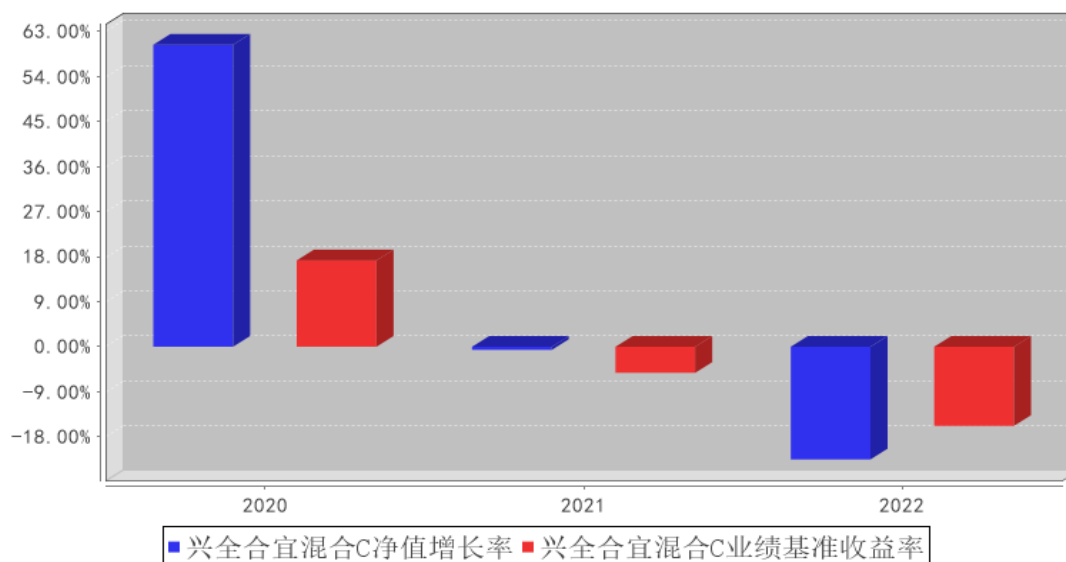
2018 年 01 月 23 日起共计六个月。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

### 3.2.3 自基金合同生效以来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

兴全合宜混合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



兴全合宜混合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：1、本基金 A 类份额的 2018 年数据统计期间为 2018 年 1 月 23 日（基金合同生效之日）至 2018 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；

2、本基金 C 类份额设立于 2020 年 2 月 13 日，2020 年数据统计期间为 2020 年 2 月 13 日（基金份额设立日）至 2020 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：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“兴证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 |        |   |
| 谢治宇 | 副总经理兼基金管理部投资总监、研究部总监、国际业务部总监、兴全合润混合型证券投资基金基 | 2018年1月23日      | -    | 15年    | 硕士，历任兴证全球基金管理有限公司研究部研究员，专户投资部投资经理，基金管理部基金经理、基金管理部投资副总监兼基金经理、基金管理部投资总监兼基金经理、公司总经理助理兼基金管理部投资总监、兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理。 |

|    |  |                 |   |      |  |
|----|--|-----------------|---|------|--|
|    | 金经理、兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理、兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金基金经理、兴全趋势投资混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理 |                 |   |      |  |
| 沈度 | 本基金基金经理助理、兴全合润混合型证券投资基金基金经理助理、兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金基金经理助理                             | 2022 年 2 月 22 日 | - | 10 年 | 硕士, 历任湖南三一重工股份有限公司部长, 兴证全球基金管理有限公司研究员。 |

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

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

3、证券从业的涵义遵从行业的相关规定，包括资管相关行业从业经历。

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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 年短期偶发风险和长周期结构性风险叠加。策略上通过持续挖掘经济中积极向好的因素，在行业政策、景气度等方面着力寻找触底或预期修复的投资机会。本基金总体维持较高的仓位，将以追求长期收益为主要目标，持续关注行业景气度、公司发展空间、商业模式、核心竞争力、企业家精神等影响公司长期投资价值的因素，平衡好短期股价波动和公司长期投资价值之间的矛盾，以较长视角继续寻找和持有具有良好投资性价比的公司，期望获取稳健的投资回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末兴全合宜混合 A 的基金份额净值为 1.5245 元,本报告期基金份额净值增长率为-22.08%,同期业绩比较基准收益率为-15.83%;截至本报告期末兴全合宜混合 C 的基金份额净值为 1.4990 元,本报告期基金份额净值增长率为-22.54%,同期业绩比较基准收益率为-15.83%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022 年国内地产周期走弱,靠基建投资托底,各种因素叠加,居民收入增长缓慢,从而制约消费回暖。俄乌冲突突发使资源品价格上涨较多,增加企业成本。海外通胀持续,美联储仍在加息周期,这些因素均对资产定价产生负面影响。在此背景下,2022 年上证指数下跌 15.13%,恒生指数下跌 15.46%。港股互联网公司市值上半年窄幅震荡,3 季度回撤较大后又出现“V”型反弹,波动率的增加需要的决策强度随之增加。

2023 年年初,国家对 GDP 的增长目标定在 5%左右,明显高于 2022 年的 3%的增长。年初后地产销售呈现好转迹象,地产开工、竣工均有修复预期;基建投资仍呈现稳健增长,而制造业投资相对强劲,投资端呈现复苏迹象。新能源、半导体、军工等板块股价低位运行,消费、白酒、计算机、通信等板块年初有所反弹。

未来我们一方面在周期逻辑向上时寻找好的投资机会;另一方面在电子、半导体、消费等行业中寻找风险收益比长周期合理的品种进行组合配置,以为投资者创造合理的中长期价值为首要宗旨。

#### 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》、《兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》及其他相关法律法规的规定，本报告期内，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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。



## 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

## 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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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 P00674 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   | 兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 全体持有人   |
| 审计意见      | 我们审计了兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金 (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。<br>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，公允反映了兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金 (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。 |
| 形成审计意见的基础 | 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，我们独立于兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金 (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。  |
| 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。其他信息包括兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金(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任 | <p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金(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合宜灵活配置混合型证券投资基金(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合宜灵活配置混合型证券投资基金(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)<br/>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, 就可能对兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金 (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合宜灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 不能持续经营。</p> <p>(5)<br/>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。<br/>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通, 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |    |
| 会计师事务所的名称 | 德勤华永会计师事务所 (特殊普通合伙)   |    |
| 注册会计师的姓名  | 吴凌志   | 冯适 |
| 会计师事务所的地址 | 上海市黄浦区延安东路 222 号外滩中心 30 楼   |    |
| 审计报告日期    | 2023 年 03 月 27 日  |    |

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体: 兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金 (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<br>2022 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|-------------------------|--------------------------|
| <b>资产:</b> |         |                         |                          |
| 银行存款       | 7.4.7.1 | 783,751,443.66          | 1,827,855,436.60         |
| 结算备付金      |         | 22,197,723.40           | 11,133,877.86            |
| 存出保证金      |         | 1,106,268.30            | 3,478,251.11             |
| 交易性金融资产    | 7.4.7.2 | 18,367,693,088.72       | 25,982,413,685.46        |
| 其中: 股票投资   |         | 17,727,410,143.90       | 25,968,822,601.06        |
| 基金投资       |         | -                       | -                        |
| 债券投资       |         | 640,282,944.82          | 13,591,084.40            |
| 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         |            | 152,870.18                 | 58,943,273.57               |
| 应收股利          |            | -                          | -                           |
| 应收申购款         |            | 9,988,323.08               | -                           |
| 递延所得税资产       |            | -                          | -                           |
| 其他资产          | 7.4.7.8    | -                          | 225,886.47                  |
| 资产总计          |            | 19,184,889,717.34          | 27,884,050,411.07           |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2022年12月31日</b> | <b>上年度末<br/>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     |            | -                          | -                           |
| 应付清算款         |            | 18,545,111.08              | 227,340,704.13              |
| 应付赎回款         |            | 21,623,934.03              | 7.74                        |
| 应付管理人报酬       |            | 24,157,396.16              | 35,027,838.97               |
| 应付托管费         |            | 4,026,232.71               | 5,837,973.16                |
| 应付销售服务费       |            | 600,636.38                 | 860,819.03                  |
| 应付投资顾问费       |            | -                          | -                           |
| 应交税费          |            | 213.53                     | 117.70                      |
| 应付利润          |            | -                          | -                           |
| 递延所得税负债       |            | -                          | -                           |
| 其他负债          | 7.4.7.9    | 3,330,114.72               | 9,028,915.66                |
| 负债合计          |            | 72,283,638.61              | 278,096,376.39              |
| <b>净资产：</b>   |            |                            |                             |
| 实收基金          | 7.4.7.10   | 12,549,949,378.15          | 14,118,885,813.87           |
| 其他综合收益        | 7.4.7.11   | -                          | -                           |
| 未分配利润         | 7.4.7.12   | 6,562,656,700.58           | 13,487,068,220.81           |
| 净资产合计         |            | 19,112,606,078.73          | 27,605,954,034.68           |
| 负债和净资产总计      |            | 19,184,889,717.34          | 27,884,050,411.07           |

注：1、报告截止日 2022 年 12 月 31 日，兴全合宜混合 A 基金份额净值 1.5245 元，基金份额总额 11,756,817,375.17 份；兴全合宜混合 C 基金份额净值 1.4990 元，基金份额总额 793,132,002.98 份。兴全合宜混合（LOF）份额总额合计为 12,549,949,378.15 份。

2、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：兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金 (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<br>2022 年 1 月 1 日至 2022<br>年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年<br>12 月 31 日 |
|--------------------------------|----------|---|--|
| <b>一、营业总收入</b>                 |          | -5,676,434,524.85                         | 352,641,845.62                                 |
| 1. 利息收入                        |          | 3,954,066.99                              | 14,009,826.62                                  |
| 其中：存款利息收入                      | 7.4.7.13 | 3,954,066.99                              | 13,175,562.92                                  |
| 债券利息收入                         |          | -   | 40,589.81                                      |
| 资产支持证券<br>利息收入                 |          | -   | -  |
| 买入返售金融<br>资产收入                 |          | -   | 793,673.89                                     |
| 证券出借利息<br>收入                   |          | -   | -  |
| 其他利息收入                         |          | -   | -  |
| 2. 投资收益（损失以<br>“-”填列）          |          | -2,230,711,895.69                         | 5,000,572,820.81                               |
| 其中：股票投资收益                      | 7.4.7.14 | -2,409,358,795.98                         | 4,692,682,062.15                               |
| 基金投资收益                         |          | -   | -  |
| 债券投资收益                         | 7.4.7.15 | 17,566,433.19                             | 3,597,011.44                                   |
| 资产支持证券<br>投资收益                 | 7.4.7.16 | -   | -  |
| 贵金属投资收<br>益                    | 7.4.7.17 | -   | -  |
| 衍生工具收益                         | 7.4.7.18 | -   | -  |
| 股利收益                           | 7.4.7.19 | 161,080,467.10                            | 304,293,747.22                                 |
| 以摊余成本计<br>量的金融资产终止确<br>认产生的收益  |          | -   | -  |
| 其他投资收益                         |          | -   | -  |
| 3. 公允价值变动收益<br>（损失以“-”号填<br>列） | 7.4.7.20 | -3,460,460,200.80                         | -4,697,943,938.70                              |

|                            |            |                   |                 |
|----------------------------|------------|-------------------|-----------------|
| 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   | 10,783,504.65     | 36,003,136.89   |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 370,188,052.43    | 673,464,838.05  |
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.10.2.1 | 310,693,022.53    | 475,522,068.49  |
| 2. 托管费                     | 7.4.10.2.2 | 51,782,170.43     | 79,253,678.12   |
| 3. 销售服务费                   | 7.4.10.2.3 | 7,375,497.93      | 10,615,168.49   |
| 4. 投资顾问费                   |            | -                 | -               |
| 5. 利息支出                    |            | -                 | -               |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | -                 | -               |
| 6. 信用减值损失                  | 7.4.7.22   | -                 | -               |
| 7. 税金及附加                   |            | 111.20            | 143.55          |
| 8. 其他费用                    | 7.4.7.23   | 337,250.34        | 108,073,779.40  |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | -6,046,622,577.28 | -320,822,992.43 |
| 减：所得税费用                    |            | -                 | -               |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | -6,046,622,577.28 | -320,822,992.43 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | -                 | -               |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | -6,046,622,577.28 | -320,822,992.43 |

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：兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金 (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<br>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） | 14,118,885,813.87                      | -      | 13,487,068,220.81 | 27,605,954,034.68 |
| 加：会计政策变更        | -                                      | -      | -                 | -                 |
| 前期差错更正          | -                                      | -      | -                 | -                 |

|  |                   |   |                   |                   |
|--|-------------------|---|-------------------|-------------------|
| 其他   | -                 | - | -                 | -                 |
| 二、本<br>期<br>期<br>初<br>净<br>资<br>产<br>（<br>基<br>金<br>净<br>值<br>）  | 14,118,885,813.87 | - | 13,487,068,220.81 | 27,605,954,034.68 |
| 三、本<br>期<br>增<br>减<br>变<br>动<br>额<br>（<br>减<br>少<br>以<br>“-”<br>号<br>填<br>列<br>）   | -1,568,936,435.72 | - | -6,924,411,520.23 | -8,493,347,955.95 |
| （一）、<br>综<br>合<br>收<br>益<br>总<br>额   | -                 | - | -6,046,622,577.28 | -6,046,622,577.28 |
| （二）、本<br>期<br>基<br>金<br>份<br>额<br>交<br>易<br>产<br>生<br>的<br>基<br>金<br>净<br>值<br>变<br>动<br>数<br>（<br>净<br>值<br>减<br>少<br>以<br>“-”<br>号<br>填<br>列<br>）                          | -1,568,936,435.72 | - | -877,788,942.95   | -2,446,725,378.67 |
| 其中：1.<br>基<br>金<br>申<br>购<br>款   | 2,233,988,635.44  | - | 1,324,431,373.72  | 3,558,420,009.16  |
| 2.<br>基<br>金<br>赎<br>回<br>款  | -3,802,925,071.16 | - | -2,202,220,316.67 | -6,005,145,387.83 |
| （三）、本<br>期<br>向<br>基<br>金<br>份<br>额<br>持<br>有<br>人<br>分<br>配<br>利<br>润<br>产<br>生<br>的<br>基<br>金<br>净<br>值<br>变<br>动<br>（<br>净<br>值<br>减<br>少<br>以<br>“-”<br>号<br>填<br>列<br>） | -                 | - | -                 | -                 |
| （四）、其<br>他<br>综<br>合<br>收<br>益<br>结<br>转<br>留<br>存<br>收<br>益   | -                 | - | -                 | -                 |
| 四、本<br>期<br>期<br>末<br>净<br>资<br>产  | 12,549,949,378.15 | - | 6,562,656,700.58  | 19,112,606,078.73 |

| 产（基金净值）                             |                                  |        |                   |                   |
|-------------------------------------|----------------------------------|--------|-------------------|-------------------|
| 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）                     | 15,472,636,669.12                | -      | 14,805,847,873.03 | 30,278,484,542.15 |
| 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）                     | 15,472,636,669.12                | -      | 14,805,847,873.03 | 30,278,484,542.15 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                | -1,353,750,855.25                | -      | -1,318,779,652.22 | -2,672,530,507.47 |
| （一）、综合收益总额                          | -                                | -      | -320,822,992.43   | -320,822,992.43   |
| （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） | -1,353,750,855.25                | -      | -997,956,659.79   | -2,351,707,515.04 |
| 其中：1. 基金申购款                         | 7,877,630,643.74                 | -      | 8,109,767,896.35  | 15,987,398,540.09 |
| 2. 基金赎回款                            | -9,231,381,498.99                | -      | -9,107,724,556.14 | -                 |
| （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）              | 14,118,885,813.87 | - | 13,487,068,220.81 | 27,605,954,034.68 |

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

兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) (原名兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金) (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 [2017]2233 号《关于准予兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人兴证全球基金管理有限公司自 2018 年 1 月 16 日至 2018 年 1 月 16 日止期间向社会公开募集，基金合同于 2018 年 1 月 23 日正式生效，首次设立募集规模为 32,699,592,445.33 份基金份额。本基金为上市开放式基金，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，本基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司和兴证全球基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。本基金于 2020 年 1 月 23 日起转型为上市开放式基金 (LOF) 并更名为兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)。

本基金根据销售服务费及申购费收取方式、起始销售的时间等不同，将基金份额分为不同的类别。其中，不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额 (简称“合宜 A 份额”)；从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额 (简称“合宜 C 份额”)。本基金仅有合宜 A 份额上市交易，合宜 C 份额仅在场外销售而不申请上市交易；且在基金

合同生效后，封闭期为两年(含两年)，期间不销售 C 类基金份额，本基金进入开放期后开始销售 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置基金代码。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票及存托凭证(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票及存托凭证)、沪港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票、深港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、可交换债券、央行票据、中期票据、证券公司发行的短期债券、短期融资券、超短期融资券等)、债券回购、货币市场工具、银行存款、同业存单、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具但须符合中国证监会相关规定。本基金将根据法律法规的规定参与融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：本基金封闭期届满转换为开放式基金后，每个交易日日终，股票资产投资比例为基金资产的 0%-95%(其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0%-95%，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%-50%)，封闭期内每个交易日日终，股票资产投资比例为基金资产的 0%-100%(其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0%-100%，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%-50%)；权证投资比例为基金资产净值的 0%-3%；

本基金封闭期届满转换为开放式基金后，每个交易日日终，在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制；封闭期内每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率×20%+中国债券总指数收益率×20%。

#### 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。

本基金在上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，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 1.50% 的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 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 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.60% 年费率逐日计提。

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) 封闭期间，基金收益分配采用现金方式；本基金封闭期届满转换为开放式基金后，登记在登记系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，其基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资，投资人可选择获取现金红利或将现金红利按再投日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；登记在深圳证券账户的基金份额只能采取现金分红方式，不能选择红利再投资；具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

(2) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，在收益分配数额方面可能有所不同。本基金同一类别内的每份基金份额享有同等分配权；

(3) 若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(4) 基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额的基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 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 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、应付交易费用和其他负债,金额分别为人民币 1,827,855,436.60 元、人民币 11,133,877.86 元、人民币 3,478,251.11 元、人民币 225,886.47 元、人民币 8,808,915.65 元和人民币 220,000.01 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、其他负债。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、其他负债项目中,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、存出保证金和其他负债,金额分别为人民币 1,828,029,239.80 元、人民币 11,159,238.28 元、人民币 3,483,421.76 元和人民币 9,028,915.66 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 25,982,413,685.46 元,归属于交易性金融资产的应收利息金额为人民币 21,552.20 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 25,982,435,237.66 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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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,暂不缴纳企业所得税;

(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。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;

(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。对于基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票,按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税;

(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<br>2022年12月31日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|--------------|--------------------|---------------------|
| 活期存款         | 783,751,443.66     | 1,827,855,436.60    |
| 等于：本金        | 783,668,065.89     | 1,827,855,436.60    |
| 加：应计利息       | 83,377.77          | -                   |
| 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           | 783,751,443.66     | 1,827,855,436.60    |

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目                | 本期末<br>2022年12月31日 |                |                   |                       |              |
|-------------------|--------------------|----------------|-------------------|-----------------------|--------------|
|                   | 成本                 | 应计利息           | 公允价值              | 公允价值变动                |              |
| 股票                | 20,223,345,028.55  | -              | 17,727,410,143.90 | -<br>2,495,934,884.65 |              |
| 贵金属投资<br>-金交所黄金合约 | -                  | -              | -                 | -                     |              |
| 债券                | 交易所市场              | 32,095,300.00  | 17,882.52         | 37,532,479.07         | 5,419,296.55 |
|                   | 银行间市场              | 596,815,200.00 | 4,250,465.75      | 602,750,465.75        | 1,684,800.00 |
|                   | 合计                 | 628,910,500.00 | 4,268,348.27      | 640,282,944.82        | 7,104,096.55 |

|                   |                     |               |                   |                       |              |
|-------------------|---------------------|---------------|-------------------|-----------------------|--------------|
| 资产支持证券            | -                   | -             | -                 | -                     |              |
| 基金                | -                   | -             | -                 | -                     |              |
| 其他                | -                   | -             | -                 | -                     |              |
| 合计                | 20,852,255,528.55   | 4,268,348.27  | 18,367,693,088.72 | -<br>2,488,830,788.10 |              |
| 项目                | 上年度末<br>2021年12月31日 |               |                   |                       |              |
|                   | 成本                  | 应计利息          | 公允价值              | 公允价值变动                |              |
| 股票                | 25,000,400,272.76   | -             | 25,968,822,601.06 | 968,422,328.30        |              |
| 贵金属投资<br>-金交所黄金合约 | -                   | -             | -                 | -                     |              |
| 债券                | 交易所市场               | 10,384,000.00 | -                 | 13,591,084.40         | 3,207,084.40 |
|                   | 银行间市场               | -             | -                 | -                     | -            |
|                   | 合计                  | 10,384,000.00 | -                 | 13,591,084.40         | 3,207,084.40 |
| 资产支持证券            | -                   | -             | -                 | -                     |              |
| 基金                | -                   | -             | -                 | -                     |              |
| 其他                | -                   | -             | -                 | -                     |              |
| 合计                | 25,010,784,272.76   | -             | 25,982,413,685.46 | 971,629,412.70        |              |

#### 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

无。

##### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

#### 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各项买入返售金融资产余额均为零。

## 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未通过买断式逆回购交易取得债券。

## 7.4.7.4.3 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

无。

## 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

## 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<br>2022年12月31日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|-------|--------------------|---------------------|
| 应收利息  | -                  | 225,886.47          |
| 其他应收款 | -                  | -                   |
| 待摊费用  | -                  | -                   |
| 合计    | -                  | 225,886.47          |

## 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2022 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                       | -                        |
| 应付赎回费       | 16,227.24               | 0.01                     |
| 应付证券出借违约金   | -                       | -                        |
| 应付交易费用      | 3,093,887.48            | 8,808,915.65             |
| 其中：交易所市场    | 3,091,587.48            | 8,808,915.65             |
| 银行间市场       | 2,300.00                | -                        |
| 应付利息        | -                       | -                        |
| 预提信息披露费     | 120,000.00              | 120,000.00               |
| 预提审计费       | 100,000.00              | 100,000.00               |
| 合计          | 3,330,114.72            | 9,028,915.66             |

## 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 兴全合宜混合 A

| 项目             | 本期<br>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           | 13,258,180,965.54                      | 13,258,180,965.54 |
| 本期申购           | 1,862,536,845.81                       | 1,862,536,845.81  |
| 本期赎回 (以“-”号填列) | -3,363,900,436.18                      | -3,363,900,436.18 |
| 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            | 11,756,817,375.17                      | 11,756,817,375.17 |

## 兴全合宜混合 C

| 项目             | 本期<br>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           | 860,704,848.33                         | 860,704,848.33  |
| 本期申购           | 371,451,789.63                         | 371,451,789.63  |
| 本期赎回 (以“-”号填列) | -439,024,634.98                        | -439,024,634.98 |
| 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            | 793,132,002.98                         | 793,132,002.98  |

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

## 兴全合宜混合 A

| 项目             | 已实现部分             | 未实现部分             | 未分配利润合计           |
|----------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 本期期初           | 12,031,536,505.54 | 650,471,967.46    | 12,682,008,473.00 |
| 本期利润           | -2,424,944,450.14 | -3,263,782,748.21 | -5,688,727,198.35 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -1,249,342,857.98 | 422,951,095.03    | -826,391,762.95   |
| 其中：基金申购款       | 1,582,694,340.24  | -467,488,604.63   | 1,115,205,735.61  |
| 基金赎回款          | -2,832,037,198.22 | 890,439,699.66    | -1,941,597,498.56 |
| 本期已分配利润        | -                 | -                 | -                 |
| 本期末            | 8,357,249,197.42  | -2,190,359,685.72 | 6,166,889,511.70  |

## 兴全合宜混合 C

| 项目             | 已实现部分           | 未实现部分           | 未分配利润合计         |
|----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 本期期初           | 761,875,997.50  | 43,183,750.31   | 805,059,747.81  |
| 本期利润           | -161,217,926.34 | -196,677,452.59 | -357,895,378.93 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -59,649,823.61  | 8,252,643.61    | -51,397,180.00  |
| 其中：基金申购款       | 302,167,536.66  | -92,941,898.55  | 209,225,638.11  |
| 基金赎回款          | -361,817,360.27 | 101,194,542.16  | -260,622,818.11 |
| 本期已分配利润        | -               | -               | -               |
| 本期末            | 541,008,247.55  | -145,241,058.67 | 395,767,188.88  |

## 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2022年1月1日至2022年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年12月31日 |
|-----------|-----------------------------|----------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 3,401,530.75                | 11,649,801.70                    |
| 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 | 475,188.73                  | 1,320,610.14                     |
| 其他        | 77,347.51                   | 205,151.08                       |
| 合计        | 3,954,066.99                | 13,175,562.92                    |

## 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 | 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 |
|------------------|-----------------------|-----------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -2,409,358,795.98     | 4,692,682,062.15      |
| 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               | -2,409,358,795.98     | 4,692,682,062.15      |

#### 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<br>2022年1月1日至2022年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年12月31日 |
|------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 13,250,933,302.23           | 36,417,974,338.56                |
| 减：卖出股票成本总额 | 15,621,777,045.11           | 31,725,292,276.41                |
| 减：交易费用     | 38,515,053.10               | -                                |
| 买卖股票差价收入   | -2,409,358,795.98           | 4,692,682,062.15                 |

#### 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<br>2022年1月1日至2022年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年12月31日 |
|------------------------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 7,750,971.99                | -                                |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 9,815,461.20                | 3,597,011.44                     |
| 债券投资收益——赎回差价收入               | -                           | -                                |



|                    |               |              |
|--------------------|---------------|--------------|
| 债券投资收益——申购<br>差价收入 | -             | -            |
| 合计                 | 17,566,433.19 | 3,597,011.44 |

#### 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<br>2022年1月1日至2022年12月31<br>日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年12月31<br>日 |
|----------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券<br>到期兑付）成交总额   | 653,270,083.01                  | 23,539,234.10                        |
| 减：卖出债券（债转股及<br>债券到期兑付）成本总额 | 634,478,800.00                  | 19,932,000.00                        |
| 减：应计利息总额                   | 8,971,677.87                    | 10,222.66                            |
| 减：交易费用                     | 4,143.94                        | -                                    |
| 买卖债券差价收入                   | 9,815,461.20                    | 3,597,011.44                         |

#### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

#### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 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：本基金本报告期内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：本基金本报告期内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<br>2022年1月1日至2022年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年12<br>月31日 |
|---------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 161,080,467.10                  | 304,293,747.22                       |
| 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            | 161,080,467.10                  | 304,293,747.22                       |

#### 7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2022年1月1日至2022年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021<br>年12月31日 |
|------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -3,460,460,200.80               | -4,697,943,938.70                    |

|                        |                   |                   |
|------------------------|-------------------|-------------------|
| 股票投资                   | -3,464,357,212.95 | -4,693,901,809.10 |
| 债券投资                   | 3,897,012.15      | -4,042,129.60     |
| 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                     | -3,460,460,200.80 | -4,697,943,938.70 |

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2022年1月1日至2022年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年12月31日 |
|---------|-----------------------------|----------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 10,600,633.27               | 35,057,013.79                    |
| 基金转换费收入 | 182,871.38                  | 946,123.10                       |
| 合计      | 10,783,504.65               | 36,003,136.89                    |

#### 7.4.7.22 信用减值损失

无。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2022年1月1日至2022年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年12月31日 |
|---------|-----------------------------|----------------------------------|
| 审计费用    | 100,000.00                  | 100,000.00                       |
| 信息披露费   | 120,000.00                  | 120,000.00                       |
| 证券出借违约金 | -                           | -                                |
| 银行费用    | 80,050.34                   | 101,901.74                       |
| 账户维护费用  | 37,200.00                   | 37,200.00                        |
| 上市费     | -                           | 60,000.00                        |
| 交易费用    | -                           | 107,654,677.66                   |
| 合计      | 337,250.34                  | 108,073,779.40                   |

#### 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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

## 7.4.9 关联方关系

| 关联方名称                               | 与本基金的关系                       |
|-------------------------------------|-------------------------------|
| 兴证全球基金管理有限公司（“兴证全球基金”）              | 基金管理人、基金销售机构、本基金 C 类份额的注册登记机构 |
| 招商银行股份有限公司（“招商银行”）                  | 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：下述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<br>2022年1月1日至2022年12月31日 |                  | 上年度可比期间<br>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  | 3,075,942,771.77            | 13.29            | 11,665,295,394.59                | 16.51            |

#### 7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间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<br>2022年1月1日至2022年12月31日      |                    |              |                      |
|-------|----------------------------------|--------------------|--------------|----------------------|
|       | 当期<br>佣金                         | 占当期佣金总量<br>的比例 (%) | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例 (%) |
| 兴业证券  | 2,928,666.79                     | 18.08              | 472,742.50   | 15.29                |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年12月31日 |                    |              |                      |
|       | 当期<br>佣金                         | 占当期佣金总量<br>的比例 (%) | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例 (%) |
| 兴业证券  | 11,047,536.20                    | 21.63              | 671,383.07   | 7.62                 |

注：基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供研究成果和市场信息等证券综合服务，并不收取额外对价。

#### 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<br>2022年1月1日至2022年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021<br>年12月31日 |
|-----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 310,693,022.53                  | 475,522,068.49                       |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 87,717,563.93                   | 123,175,525.92                       |

注：A 份额的基金管理人报酬按前一日该级基金资产净值 1.50% 费率计提；C 份额的基金管理人报酬按前一日该级基金资产净值 1.50% 费率计提；各级基金份额的基金管理人报酬逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：基金管理人报酬=前一日该级基金份额的基金资产净值×R/当年天数；R 为该级基金份额的年管理费费率。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2022年1月1日至2022年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021<br>年12月31日 |
|----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 51,782,170.43                   | 79,253,678.12                        |

注：A 份额的基金托管费按前一日该级基金资产净值 0.25% 费率计提；C 份额的基金托管费按前一日该级基金资产净值 0.25% 费率计提；各级基金份额的基金托管费逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：基金托管费=前一日该级基金份额的基金资产净值×R/当年天数；R 为该级基金

份额的年托管费率。

#### 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<br>名称 | 本期<br>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                            |              |              |
|                    | 兴全合宜混合 A                                    | 兴全合宜混合 C     | 合计           |
| 兴业证券               | -   | 190,677.55   | 190,677.55   |
| 兴证全球基金             | -   | 479,785.15   | 479,785.15   |
| 招商银行               | -   | 649,306.28   | 649,306.28   |
| 合计                 | -   | 1,319,768.98 | 1,319,768.98 |
| 获得销售服务费的各关联方<br>名称 | 上年度可比期间<br>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                            |              |              |
|                    | 兴全合宜混合 A                                    | 兴全合宜混合 C     | 合计           |
| 招商银行               | -   | 380,616.58   | 380,616.58   |
| 兴证全球基金             | -   | 843,822.58   | 843,822.58   |
| 兴业证券               | -   | 277,872.48   | 277,872.48   |
| 合计                 | -   | 1,502,311.64 | 1,502,311.64 |

注：支付给销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值一定比例的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。A 级份额不收取销售服务费。C 级份额：支付的销售服务费按前一日 C 级基金资产净值 0.60% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：C 级基金销售服务费=前一日 C 级基金资产净值×0.60%÷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：本基金本报告期内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内均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内均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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                              | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月<br>31 日      | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年<br>12 月 31 日      |
|---------------------------------|--|--|
|                                 |  | 兴全合宜混合 A                                       |
| 基金合同生效日（2018 年 1 月 23 日）持有的基金份额 | -  | -  |
| 报告期初持有的基金份额                     | 51,609,891.00                                  | -  |
| 报告期间申购/买入总份额                    | 59,460,801.14                                  | -  |
| 报告期间因拆分变动份额                     | -  | -  |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额                  | 5,459,954.00                                   | -  |
| 报告期末持有的基金份额                     | 105,610,738.14                                 | -  |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例             | 0.8415%  | -%   |
| 项目                              | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月<br>31 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年<br>12 月 31 日 |
|                                 |  | 兴全合宜混合 A                                       |
| 基金合同生效日（2018 年 1 月 23 日）持有的基金份额 | -  | -  |
| 报告期初持有的基金份额                     | 46,149,937.00                                  | -  |
| 报告期间申购/买入总份额                    | 5,459,954.00                                   | -  |
| 报告期间因拆分变动份额                     | -  | -  |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额                  | -  | -  |
| 报告期末持有的基金份额                     | 51,609,891.00                                  | -  |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例             | 0.3655%  | -%   |

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

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

#### 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

份额单位：份

兴全合宜混合 A

| 关联方名称 | 本期末<br>2022年12月31日 |                              | 上年度末<br>2021年12月31日 |                              |
|-------|--------------------|------------------------------|---------------------|------------------------------|
|       | 持有的<br>基金份额        | 持有的基金份额<br>占基金总份额的比<br>例 (%) | 持有的<br>基金份额         | 持有的基金份额<br>占基金总份额的比<br>例 (%) |
| 兴业证券  | 31,365,468.00      | 0.2499                       | 2,831,617.00        | 0.0201                       |
| -     | -                  | -                            | -                   | -                            |

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

#### 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<br>2022年1月1日至2022年12月<br>31日 |              | 上年度可比期间<br>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        |
| 招商银行  | 783,751,443.66                  | 3,401,530.75 | 1,827,855,436.60                 | 11,649,801.70 |

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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内均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。

#### 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<br>认购日 | 受<br>限期 | 流<br>通<br>受<br>限<br>类 | 认<br>购<br>价<br>格 | 期<br>末<br>估<br>值<br>单<br>价 | 数<br>量<br>(<br>单<br>位：<br>股) | 期<br>末<br>成<br>本<br>总<br>额 | 期<br>末<br>估<br>值<br>总<br>额 | 备<br>注 |



|        |      |            |     |        |       |       |     |           |           |   |
|--------|------|------------|-----|--------|-------|-------|-----|-----------|-----------|---|
| 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 | - |
| 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  | - |
| 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  | - |
| 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  | - |
| 30123  | 荣    | 2022       | 6个月 | 新股流通受限 | 25.49 | 20.38 | 275 | 7,009.75  | 5,604.50  | - |

|        |      |                     |     |                            |       |       |       |           |            |   |
|--------|------|---------------------|-----|----------------------------|-------|-------|-------|-----------|------------|---|
| 1      | 信文化  | 2年<br>8月<br>31日     | 月   | 股<br>流<br>通<br>受<br>限      |       |       |       |           |            |   |
| 301233 | 盛帮股份 | 2022年<br>6月<br>24日  | 6个月 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 41.52 | 34.30 | 158   | 6,560.16  | 5,419.40   | - |
| 301239 | 普瑞眼科 | 2022年<br>6月<br>22日  | 6个月 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 33.65 | 69.68 | 575   | 19,348.75 | 40,066.00  | - |
| 301265 | 华新环保 | 2022年<br>12月<br>8日  | 6个月 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 13.28 | 11.40 | 819   | 10,876.32 | 9,336.60   | - |
| 301267 | 华夏眼科 | 2022年<br>10月<br>26日 | 6个月 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 50.88 | 66.20 | 1,006 | 51,185.28 | 66,597.20  | - |
| 301269 | 华大九天 | 2022年<br>7月<br>21日  | 6个月 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 32.69 | 87.94 | 1,168 | 38,181.92 | 102,713.92 | - |
| 301270 | 汉仪股份 | 2022年<br>8月<br>19日  | 6个月 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 25.68 | 28.37 | 210   | 5,392.80  | 5,957.70   | - |
| 301276 | 嘉曼服  | 2022年<br>9月         | 6个月 | 新<br>股<br>流                | 40.66 | 22.61 | 303   | 12,319.98 | 6,850.83   | - |

|        |      |             |     |        |       |       |       |           |           |   |
|--------|------|-------------|-----|--------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
|        | 饰    | 1日          |     | 通受限    |       |       |       |           |           |   |
| 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 | - |
| 301309 | 万得凯  | 2022年9月8日   | 6个月 | 新股流通受限 | 39.00 | 24.46 | 228   | 8,892.00  | 5,576.88  | - |
| 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  | - |

|        |      |            |     |        |        |        |     |           |           |   |
|--------|------|------------|-----|--------|--------|--------|-----|-----------|-----------|---|
|        |      |            |     | 限      |        |        |     |           |           |   |
| 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 | - |
| 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 | - |
| 301338 | 凯格精机 | 2022年8月8日  | 6个月 | 新股流通受限 | 46.33  | 48.99  | 257 | 11,906.81 | 12,590.43 | - |
| 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 | - |
| 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 | - |
| 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 | - |
| 30137  | 鼎    | 2022       | 6个月 | 新      | 22.88  | 17.63  | 770 | 17,617.60 | 13,575.10 | - |

|        |      |                     |     |  |       |       |            |                |                |   |
|--------|------|---------------------|-----|--|-------|-------|------------|----------------|----------------|---|
| 7      | 泰高科  | 2年<br>11月<br>11日    | 月   | 股<br>流<br>通<br>受<br>限                          |       |       |            |                |                |   |
| 301389 | 隆扬电子 | 2022年<br>10月<br>18日 | 6个月 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限                     | 22.50 | 17.16 | 1,269      | 28,552.50      | 21,776.04      | - |
| 301391 | 卡莱特  | 2022年<br>11月<br>24日 | 6个月 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限                     | 96.00 | 80.97 | 247        | 23,712.00      | 19,999.59      | - |
| 301396 | 宏景科技 | 2022年<br>11月<br>4日  | 6个月 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限                     | 40.13 | 31.90 | 396        | 15,891.48      | 12,632.40      | - |
| 600703 | 三安光电 | 2022年<br>12月<br>14日 | 6个月 | 非<br>公<br>开<br>发<br>行<br>流<br>通<br>受<br>限      | 15.50 | 16.04 | 16,580,645 | 256,999,997.50 | 265,953,545.80 | - |
| 603883 | 老百姓  | 2022年<br>9月<br>28日  | 6个月 | 大<br>宗<br>交<br>易<br>购<br>入<br>流<br>通<br>受<br>限 | 29.54 | 38.39 | 1,460,000  | 43,128,400.00  | 56,049,400.00  | - |
| 688041 | 海光   | 2022年               | 6个月 | 新<br>股   | 36.00 | 39.15 | 70,208     | 2,527,488.00   | 2,748,643.20   | - |

|        |      |             |     |            |        |        |         |                |                |   |
|--------|------|-------------|-----|------------|--------|--------|---------|----------------|----------------|---|
|        | 信息   | 8月5日        |     | 流通受限       |        |        |         |                |                |   |
| 688099 | 晶晨股份 | 2022年10月31日 | 6个月 | 大宗交易购入流通受限 | 52.77  | 65.59  | 630,000 | 33,245,100.00  | 41,321,700.00  | - |
| 688099 | 晶晨股份 | 2022年9月13日  | 6个月 | 大宗交易购入流通受限 | 72.23  | 66.25  | 450,000 | 32,503,500.00  | 29,812,500.00  | - |
| 688114 | 华大智造 | 2022年9月2日   | 6个月 | 新股流通受限     | 87.18  | 105.05 | 5,336   | 465,192.48     | 560,546.80     | - |
| 688132 | 邦彦技术 | 2022年9月16日  | 6个月 | 新股流通受限     | 28.88  | 22.80  | 4,844   | 139,894.72     | 110,443.20     | - |
| 688200 | 华峰测控 | 2022年10月13日 | 6个月 | 询价转让流通受限   | 215.11 | 256.79 | 594,725 | 127,931,294.75 | 152,719,432.75 | - |

|        |      |             |     |            |        |        |           |                |                |   |
|--------|------|-------------|-----|------------|--------|--------|-----------|----------------|----------------|---|
| 688200 | 华峰测控 | 2022年12月19日 | 6个月 | 询价转让流通受限   | 277.21 | 251.00 | 60,000    | 16,632,600.00  | 15,060,000.00  | - |
| 688200 | 华峰测控 | 2022年12月6日  | 6个月 | 大宗交易购入流通受限 | 260.79 | 251.44 | 118,840   | 30,992,283.60  | 29,881,129.60  | - |
| 688303 | 大全能源 | 2022年7月22日  | 6个月 | 非公开发行业流通受限 | 51.79  | 47.02  | 6,082,255 | 314,999,986.45 | 285,987,630.10 | - |
| 688432 | 有研硅  | 2022年11月3日  | 6个月 | 新股流通受限     | 9.91   | 11.24  | 20,044    | 198,636.04     | 225,294.56     | - |
| 688455 | 科捷智能 | 2022年9月7日   | 6个月 | 新股流通受限     | 21.88  | 13.12  | 5,277     | 115,460.76     | 69,234.24      | - |
| 688766 | 普冉股份 | 2022年9月16日  | 6个月 | 大宗交易购入     | 132.17 | 143.15 | 190,000   | 25,112,300.00  | 27,198,500.00  | - |

|  |  |  |  |                       |  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|-----------------------|--|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  | 入<br>流<br>通<br>受<br>限 |  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|-----------------------|--|--|--|--|--|--|

**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临时停牌等流通受限股票。

**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**

注：本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

**7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

**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、风险管理部和合规管理部以及审计部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

**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<br>2022 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| AAA    | -                       | 1,031,750.40             |
| AAA 以下 | 37,532,479.07           | 12,559,334.00            |
| 未评级    | -                       | -                        |
| 合计     | 37,532,479.07           | 13,591,084.40            |

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管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现，另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。

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人员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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制，对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限，控制基金的流动性结构；加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析，定期揭示基金的流动性风险；通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。本基金所持证券均可在证券交易所或银行间同业市场交易，除附注 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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人根据申购赎回变动情况，制定现金头寸预测表，及时采取措施满足流动性需要；分析基金持有人结构，加强与主要持有机构的沟通，及时揭示可能的赎回需求；按照有关法律法规规定应对固定赎回，并进行适当报告和批露；在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 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

本基金合同生效后两年之内(含两年)为封闭期，在此期间投资者不能申购、赎回基金份额。封闭期届满后转型为开放式基金，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<br>期<br>末<br>202<br>2<br>年<br>12<br>月<br>31<br>日 | 1<br>-<br>3<br>个<br>月 | 3<br>个<br>月-1<br>年 | 1-5<br>年     | 5<br>年<br>以<br>上 | 不<br>计<br>息       | 合<br>计            |
|--|-----------------------|--------------------|--------------|------------------|-------------------|-------------------|
| 资<br>产   |                       |                    |              |                  |                   |                   |
| 银<br>行<br>存<br>款                                   | 783,751,443.66        | -                  | -            | -                | -                 | 783,751,443.66    |
| 结<br>算<br>备<br>付<br>金                              | 22,197,723.40         | -                  | -            | -                | -                 | 22,197,723.40     |
| 存<br>出<br>保<br>证<br>金                              | 1,106,268.30          | -                  | -            | -                | -                 | 1,106,268.30      |
| 交<br>易<br>性<br>金<br>融<br>资<br>产                    | -                     | 602,750,465.75     | 6,726,181.05 | 30,806,298.02    | 17,727,410,143.90 | 18,367,693,088.72 |
| 应<br>收<br>申<br>购<br>款                              | 255,716.89            | -                  | -            | -                | 9,732,606.19      | 9,988,323.08      |

|         |                |                |              |               |                   |                   |
|---------|----------------|----------------|--------------|---------------|-------------------|-------------------|
| 应收清算款   | -              | -              | -            | -             | 152,870.18        | 152,870.18        |
| 资产总计    | 807,311,152.25 | 602,750,465.75 | 6,726,181.05 | 30,806,298.02 | 17,737,295,620.27 | 19,184,889,717.34 |
| 负债      |                |                |              |               |                   |                   |
| 应付赎回款   | -              | -              | -            | -             | 21,623,934.03     | 21,623,934.03     |
| 应付管理人报酬 | -              | -              | -            | -             | 24,157,396.16     | 24,157,396.16     |
| 应付托管费   | -              | -              | -            | -             | 4,026,232.71      | 4,026,232.71      |
| 应付清算款   | -              | -              | -            | -             | 18,545,111.08     | 18,545,111.08     |
| 应付销售服务费 | -              | -              | -            | -             | 600,636.38        | 600,636.38        |
| 应交税费    | -              | -              | -            | -             | 213.53            | 213.53            |
| 其他      | -              | -              | -            | -             | 3,330,114.72      | 3,330,114.72      |

|   |                  |                |               |               |                   |                   |
|---|------------------|----------------|---------------|---------------|-------------------|-------------------|
| 他<br>负<br>债   |                  |                |               |               |                   |                   |
| 负<br>债<br>总<br>计  | -                | -              | -             | -             | 72,283,638.61     | 72,283,638.61     |
| 利<br>率<br>敏<br>感<br>度<br>缺<br>口                         | 807,311,152.25   | 602,750,465.75 | 6,726,181.05  | 30,806,298.02 | 17,665,011,981.66 | 19,112,606,078.73 |
| 上<br>年<br>度<br>末<br>202<br>1<br>年<br>12<br>月<br>31<br>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<br>产  |                  |                |               |               |                   |                   |
| 银<br>行<br>存<br>款  | 1,827,855,436.60 | -              | -             | -             | -                 | 1,827,855,436.60  |
| 结<br>算<br>备<br>付<br>金                                   | 11,133,877.86    | -              | -             | -             | -                 | 11,133,877.86     |
| 存<br>出<br>保<br>证<br>金                                   | 3,478,251.11     | -              | -             | -             | -                 | 3,478,251.11      |
| 交<br>易<br>性<br>金  | -                | -              | 12,559,334.00 | 1,031,750.40  | 25,968,822,601.06 | 25,982,413,685.46 |

|         |                  |  |               |              |                   |                   |
|---------|------------------|--|---------------|--------------|-------------------|-------------------|
| 融资产     |                  |  |               |              |                   |                   |
| 应收证券清算款 |                  |  |               |              | 58,943,273.57     | 58,943,273.57     |
| 其他资产    |                  |  |               |              | 225,886.47        | 225,886.47        |
| 资产总计    | 1,842,467,565.57 |  | 12,559,334.00 | 1,031,750.40 | 26,027,991,761.10 | 27,884,050,411.07 |
| 负债      |                  |  |               |              |                   |                   |
| 应付赎回款   |                  |  |               |              | 7.74              | 7.74              |
| 应付管理人报酬 |                  |  |               |              | 35,027,838.97     | 35,027,838.97     |
| 应付托管费   |                  |  |               |              | 5,837,973.16      | 5,837,973.16      |
| 应付证券清算款 |                  |  |               |              | 227,340,704.13    | 227,340,704.13    |
| 应       |                  |  |               |              | 860,819.03        | 860,819.03        |

|         |                  |  |               |              |                   |                   |
|---------|------------------|--|---------------|--------------|-------------------|-------------------|
| 付销售服务费  |                  |  |               |              |                   |                   |
| 应交税费    |                  |  |               |              | 117.70            | 117.70            |
| 其他负债    |                  |  |               |              | 9,028,915.66      | 9,028,915.66      |
| 负债总计    |                  |  |               |              | 278,096,376.39    | 278,096,376.39    |
| 利率敏感度缺口 | 1,842,467,565.57 |  | 12,559,334.00 | 1,031,750.40 | 25,749,895,384.71 | 27,605,954,034.68 |

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        | 1. 市场利率+1%                      | -3,444,068.25     | - |
|           | 2. 市场利率-1%                      | 3,484,167.75      | - |

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。

#### 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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目                | 本期末<br>2022年12月31日  |              |                |                  |
|-------------------|---------------------|--------------|----------------|------------------|
|                   | 美元<br>折合人民币<br>元    | 港币<br>折合人民币元 | 其他币种<br>折合人民币元 | 合计               |
| 以外币计价的资产          |                     |              |                |                  |
| 交易性金融资产           | -7,259,297,406.45   |              | -              | 7,259,297,406.45 |
| 资产合计              | -7,259,297,406.45   |              | -              | 7,259,297,406.45 |
| 以外币计价的负债          |                     |              |                |                  |
| 负债合计              | -                   | -            | -              | -                |
| 资产负债表外汇<br>风险敞口净额 | -7,259,297,406.45   |              | -              | 7,259,297,406.45 |
| 项目                | 上年度末<br>2021年12月31日 |              |                |                  |
|                   | 美元<br>折合人民币<br>元    | 港币<br>折合人民币元 | 其他币种<br>折合人民币元 | 合计               |
| 以外币计价的资产          |                     |              |                |                  |
| 交易性金融资产           | -5,969,473,725.56   |              | -              | 5,969,473,725.56 |
| 资产合计              | -5,969,473,725.56   |              | -              | 5,969,473,725.56 |
| 以外币计价的负债          |                     |              |                |                  |
| 负债合计              | -                   | -            | -              | -                |
| 资产负债表外汇<br>风险敞口净额 | -5,969,473,725.56   |              | -              | 5,969,473,725.56 |

##### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

| 假设 | 除汇率以外的其他市场变量保持不变 |                             |
|----|------------------|-----------------------------|
|    | 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 | 所有外币相对人民币升值 5% | 362,964,870.32         | 298,473,686.28          |
|    | 所有外币相对人民币贬值 5% | -362,964,870.32        | -298,473,686.28         |

#### 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。

本基金投资组合比例为：本基金封闭期届满转换为开放式基金后，每个交易日日终，股票资产投资比例为基金资产的 0%—95%(其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-95%，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%)，封闭期内每个交易日日终，股票资产投资比例为基金资产的 0%—100%(其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-100%，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%)；权证投资比例为基金资产净值的 0%-3%；本基金封闭期届满转换为开放式基金后，每个交易日日终，在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制；封闭期内每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；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<br>2022 年 12 月 31 日 |                   | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |                   |
|--------------|-------------------------|-------------------|--------------------------|-------------------|
|              | 公允价值                    | 占基金资产净值<br>比例 (%) | 公允价值                     | 占基金资产净值<br>比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | 17,727,410,143.90       | 92.75             | 25,968,822,601.06        | 94.07             |
| 交易性金融资产—基金投资 | -                       | -                 | -                        | -                 |

|               |                   |       |                   |       |
|---------------|-------------------|-------|-------------------|-------|
| 交易性金融资产—债券投资  | 640,282,944.82    | 3.35  | 13,591,084.40     | 0.05  |
| 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            | 18,367,693,088.72 | 96.10 | 25,982,413,685.46 | 94.12 |

#### 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%  | 3,140,970,435.63        | 3,366,010,691.29  |
|           | 业绩比较基准-10%  | -3,140,970,435.63       | -3,366,010,691.29 |

注: 1、本基金管理人运用 CAPM 模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析, 反映了在其他变量不变的假设下, 证券投资价格发生合理、可能的变动时, 将对基金净值产生的影响。

#### 7.4.14 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<br>2022年12月31日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|---------------|--------------------|---------------------|
| 第一层次          | 16,856,585,252.06  | 24,855,578,750.41   |
| 第二层次          | 602,750,465.75     | 5,504.49            |
| 第三层次          | 908,357,370.91     | 1,126,829,430.56    |
| 合计            | 18,367,693,088.72  | 25,982,413,685.46   |

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<br>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          | -                           | 1,126,829,430.56 | 1,126,829,430.56 |
| 当期购买          | -                           | 1,501,859,113.60 | 1,501,859,113.60 |
| 当期出售/结算       | -                           | -                | -                |
| 转入第三层次        | -                           | -                | -                |
| 转出第三层次        | -                           | 1,506,448,013.95 | 1,506,448,013.95 |
| 当期利得或损失总额     | -                           | -213,883,159.30  | -213,883,159.30  |
| 其中：计入损益的利得或损失 | -                           | -213,883,159.30  | -213,883,159.30  |
| 计入其他综合收益      | -                           | -                | -                |

|  |                                  |                  |                  |
|--|----------------------------------|------------------|------------------|
| 的利得或损失                                     |                                  |                  |                  |
| 期末余额                                       | -                                | 908,357,370.91   | 908,357,370.91   |
| 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 | -                                | 22,764,152.69    | 22,764,152.69    |
| 项目   | 上年度可比同期<br>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                                       | -                                | 2,984,093,415.74 | 2,984,093,415.74 |
| 当期购买                                       | -                                | 2,675,286,689.28 | 2,675,286,689.28 |
| 当期出售/结算                                    | -                                | -                | -                |
| 转入第三层次                                     | -                                | -                | -                |
| 转出第三层次                                     | -                                | 4,787,389,684.11 | 4,787,389,684.11 |
| 当期利得或损失总额                                  | -                                | 254,839,009.65   | 254,839,009.65   |
| 其中：计入损益的利得或损失                              | -                                | 254,839,009.65   | 254,839,009.65   |
| 计入其他综合收益的利得或损失                             | -                                | -                | -                |
| 期末余额                                       | -                                | 1,126,829,430.56 | 1,126,829,430.56 |
| 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 | -                                | 43,677,656.88    | 43,677,656.88    |

#### 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 | 908,357,370.91   | 平均价格<br>亚式期权<br>模型 | 股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率 | 0.2063-<br>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 | 1,126,829,430.56 | 平均价格<br>亚式期权       | 股票在剩余限售期内的股价         | 0.1717-<br>2.7417 | 负相关        |

|  |  |    |          |  |  |
|--|--|----|----------|--|--|
|  |  | 模型 | 的预期年化波动率 |  |  |
|--|--|----|----------|--|--|

#### 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              | 17,727,410,143.90 | 92.40         |
|    | 其中：股票             | 17,727,410,143.90 | 92.40         |
| 2  | 基金投资              | -                 | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 640,282,944.82    | 3.34          |
|    | 其中：债券             | 640,282,944.82    | 3.34          |
|    | 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      | 805,949,167.06    | 4.20          |
| 8  | 其他各项资产            | 11,247,461.56     | 0.06          |
| 9  | 合计                | 19,184,889,717.34 | 100.00        |

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 7,259,297,406.45 元，占净值比例 37.98%。

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------|---------|---------------|
|----|------|---------|---------------|

|   |                  |                   |       |
|---|------------------|-------------------|-------|
| A | 农、林、牧、渔业         | -                 | -     |
| B | 采矿业              | -                 | -     |
| C | 制造业              | 7,621,969,755.90  | 39.88 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -                 | -     |
| E | 建筑业              | -                 | -     |
| F | 批发和零售业           | 56,049,400.00     | 0.29  |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | 718,133,214.80    | 3.76  |
| H | 住宿和餐饮业           | 186,269,012.85    | 0.97  |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 1,090,774,291.51  | 5.71  |
| 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       | 272,223,028.95    | 1.42  |
| 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          | 106,663.20        | 0.00  |
| R | 文化、体育和娱乐业        | 522,587,370.24    | 2.73  |
| S | 综合               | -                 | -     |
|   | 合计               | 10,468,112,737.45 | 54.77 |

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别     | 公允价值（人民币）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----------|------------------|--------------|
| 原材料      | -                | -            |
| 非日常生活消费品 | 612,255,432.76   | 3.20         |
| 日常消费品    | 1,159,629,664.30 | 6.07         |
| 能源       | -                | -            |
| 金融       | 35,909.45        | 0.00         |
| 医疗保健     | 1,494,649,511.87 | 7.82         |
| 工业       | -                | -            |
| 信息技术     | 1,416,380,029.46 | 7.41         |
| 通信服务     | 2,264,806,190.21 | 11.85        |
| 公用事业     | -                | -            |
| 房地产      | 311,540,668.40   | 1.63         |
| 合计       | 7,259,297,406.45 | 37.98        |

注：以上分类采用财汇大智慧提供的国际通用行业分类标准。

### 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

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  | 01024  | 快手-W   | 29,191,504 | 1,852,692,323.98 | 9.69 |
| 2  | 00291  | 华润啤酒   | 19,515,526 | 950,950,179.79   | 4.98 |
| 3  | 600690 | 海尔智家   | 38,484,165 | 941,322,675.90   | 4.93 |
| 4  | 02382  | 舜宇光学科技 | 9,090,258  | 753,947,084.81   | 3.94 |
| 5  | 600703 | 三安光电   | 41,749,160 | 697,845,263.20   | 3.65 |
| 6  | 01347  | 华虹半导体  | 27,214,018 | 662,432,944.65   | 3.47 |
| 7  | 603707 | 健友股份   | 33,677,646 | 607,544,733.84   | 3.18 |
| 8  | 002120 | 韵达股份   | 40,300,232 | 579,517,336.16   | 3.03 |
| 9  | 06078  | 海吉亚医疗  | 10,839,400 | 542,220,606.93   | 2.84 |
| 10 | 600873 | 梅花生物   | 52,311,436 | 532,530,418.48   | 2.79 |
| 11 | 300413 | 芒果超媒   | 17,407,787 | 522,581,765.74   | 2.73 |
| 12 | 688099 | 晶晨股份   | 6,923,229  | 483,140,276.79   | 2.53 |
| 13 | 002938 | 鹏鼎控股   | 17,601,914 | 482,996,520.16   | 2.53 |
| 14 | 000739 | 普洛药业   | 22,130,773 | 476,696,850.42   | 2.49 |
| 15 | 300454 | 深信服    | 3,742,191  | 421,183,597.05   | 2.20 |
| 16 | 600309 | 万华化学   | 4,519,676  | 418,747,981.40   | 2.19 |
| 17 | 00700  | 腾讯控股   | 1,381,300  | 412,113,866.23   | 2.16 |
| 18 | 603195 | 公牛集团   | 2,600,615  | 372,564,104.90   | 1.95 |
| 19 | 00780  | 同程旅行   | 21,070,800 | 353,475,535.83   | 1.85 |
| 20 | 002250 | 联化科技   | 20,922,242 | 324,294,751.00   | 1.70 |
| 21 | 06049  | 保利物业   | 7,573,600  | 311,540,668.40   | 1.63 |
| 22 | 688200 | 华峰测控   | 1,163,039  | 305,338,439.13   | 1.60 |
| 23 | 688303 | 大全能源   | 6,082,264  | 285,988,059.22   | 1.50 |
| 24 | 06699  | 时代天使   | 2,601,400  | 285,821,567.09   | 1.50 |
| 25 | 02269  | 药明生物   | 5,340,000  | 285,488,198.73   | 1.49 |
| 26 | 002851 | 麦格米特   | 10,826,157 | 281,047,035.72   | 1.47 |
| 27 | 603259 | 药明康德   | 3,360,645  | 272,212,245.00   | 1.42 |
| 28 | 09992  | 泡泡玛特   | 14,616,200 | 258,774,141.14   | 1.35 |
| 29 | 600745 | 闻泰科技   | 4,595,130  | 241,611,935.40   | 1.26 |
| 30 | 01801  | 信达生物   | 7,773,000  | 232,603,488.29   | 1.22 |
| 31 | 603816 | 顾家家居   | 5,186,942  | 221,534,292.82   | 1.16 |
| 32 | 600426 | 华鲁恒升   | 6,529,953  | 216,467,941.95   | 1.13 |
| 33 | 002318 | 久立特材   | 12,892,944 | 214,538,588.16   | 1.12 |
| 34 | 00168  | 青岛啤酒股份 | 3,030,000  | 208,679,484.51   | 1.09 |
| 35 | 603899 | 晨光股份   | 3,778,865  | 207,761,997.70   | 1.09 |
| 36 | 600754 | 锦江酒店   | 3,192,271  | 186,269,012.85   | 0.97 |
| 37 | 002371 | 北方华创   | 784,298    | 176,702,339.40   | 0.92 |
| 38 | 600315 | 上海家化   | 4,758,452  | 151,556,696.20   | 0.79 |
| 39 | 02171  | 科济药业-B | 10,865,000 | 145,386,570.68   | 0.76 |
| 40 | 603713 | 密尔克卫   | 1,188,204  | 138,615,878.64   | 0.73 |
| 41 | 688083 | 中望软件   | 594,056    | 115,591,416.48   | 0.60 |
| 42 | 601966 | 玲珑轮胎   | 4,683,185  | 95,911,628.80    | 0.50 |
| 43 | 689009 | 九号公司   | 2,395,891  | 73,050,716.59    | 0.38 |

|    |        |        |           |               |      |
|----|--------|--------|-----------|---------------|------|
| 44 | 688777 | 中控技术   | 776,497   | 70,529,222.51 | 0.37 |
| 45 | 605376 | 博迁新材   | 1,405,576 | 65,260,893.68 | 0.34 |
| 46 | 603883 | 老百姓    | 1,460,000 | 56,049,400.00 | 0.29 |
| 47 | 603712 | 七一二    | 1,529,113 | 53,396,625.96 | 0.28 |
| 48 | 002317 | 众生药业   | 1,434,300 | 38,711,757.00 | 0.20 |
| 49 | 688766 | 普冉股份   | 208,355   | 29,987,542.25 | 0.16 |
| 50 | 000683 | 远兴能源   | 3,608,100 | 28,287,504.00 | 0.15 |
| 51 | 688798 | 艾为电子   | 287,422   | 27,457,423.66 | 0.14 |
| 52 | 603338 | 浙江鼎力   | 570,317   | 27,289,668.45 | 0.14 |
| 53 | 000810 | 创维数字   | 1,003,400 | 13,987,396.00 | 0.07 |
| 54 | 002821 | 凯莱英    | 31,276    | 4,628,848.00  | 0.02 |
| 55 | 09995  | 荣昌生物-B | 60,500    | 3,129,080.15  | 0.02 |
| 56 | 688041 | 海光信息   | 70,208    | 2,748,643.20  | 0.01 |
| 57 | 300123 | 亚光科技   | 243,200   | 1,437,312.00  | 0.01 |
| 58 | 688114 | 华大智造   | 5,336     | 560,546.80    | 0.00 |
| 59 | 300999 | 金龙鱼    | 12,114    | 527,685.84    | 0.00 |
| 60 | 301301 | 川宁生物   | 35,740    | 314,797.92    | 0.00 |
| 61 | 688432 | 有研硅    | 20,044    | 225,294.56    | 0.00 |
| 62 | 688498 | 源杰科技   | 1,582     | 189,096.46    | 0.00 |
| 63 | 688199 | 久日新材   | 4,494     | 141,740.76    | 0.00 |
| 64 | 688132 | 邦彦技术   | 4,844     | 110,443.20    | 0.00 |
| 65 | 688496 | 清越科技   | 12,000    | 108,960.00    | 0.00 |
| 66 | 301269 | 华大九天   | 1,168     | 102,713.92    | 0.00 |
| 67 | 301265 | 华新环保   | 8,181     | 99,226.62     | 0.00 |
| 68 | 688058 | 宝兰德    | 2,030     | 82,945.80     | 0.00 |
| 69 | 688455 | 科捷智能   | 5,277     | 69,234.24     | 0.00 |
| 70 | 001301 | 尚太科技   | 1,164     | 68,722.56     | 0.00 |
| 71 | 301267 | 华夏眼科   | 1,006     | 66,597.20     | 0.00 |
| 72 | 301095 | 广立微    | 740       | 64,002.60     | 0.00 |
| 73 | 001269 | 欧晶科技   | 546       | 54,185.04     | 0.00 |
| 74 | 301327 | 华宝新能   | 242       | 42,826.74     | 0.00 |
| 75 | 301239 | 普瑞眼科   | 575       | 40,066.00     | 0.00 |
| 76 | 01398  | 工商银行   | 10,000    | 35,909.45     | 0.00 |
| 77 | 301195 | 北路智控   | 330       | 24,103.20     | 0.00 |
| 78 | 301389 | 隆扬电子   | 1,269     | 21,776.04     | 0.00 |
| 79 | 301330 | 熵基科技   | 694       | 21,729.14     | 0.00 |
| 80 | 301391 | 卡莱特    | 247       | 19,999.59     | 0.00 |
| 81 | 301349 | 信德新材   | 180       | 18,633.60     | 0.00 |
| 82 | 301171 | 易点天下   | 985       | 17,454.20     | 0.00 |
| 83 | 301363 | 美好医疗   | 445       | 16,843.25     | 0.00 |
| 84 | 301296 | 新巨丰    | 1,042     | 15,525.80     | 0.00 |
| 85 | 301377 | 鼎泰高科   | 770       | 13,575.10     | 0.00 |
| 86 | 301396 | 宏景科技   | 396       | 12,632.40     | 0.00 |



|     |        |      |       |           |      |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 87  | 301338 | 凯格精机 | 257   | 12,590.43 | 0.00 |
| 88  | 301366 | 一博科技 | 268   | 12,084.12 | 0.00 |
| 89  | 301306 | 西测测试 | 255   | 10,783.95 | 0.00 |
| 90  | 301176 | 逸豪新材 | 544   | 9,188.16  | 0.00 |
| 91  | 301318 | 维海德  | 206   | 8,598.44  | 0.00 |
| 92  | 301227 | 森鹰窗业 | 284   | 8,375.16  | 0.00 |
| 93  | 301197 | 工大科雅 | 380   | 7,630.40  | 0.00 |
| 94  | 301161 | 唯万密封 | 346   | 7,518.58  | 0.00 |
| 95  | 301313 | 凡拓数创 | 247   | 7,197.58  | 0.00 |
| 96  | 301276 | 嘉曼服饰 | 303   | 6,850.83  | 0.00 |
| 97  | 301319 | 唯特偶  | 115   | 6,126.05  | 0.00 |
| 98  | 301270 | 汉仪股份 | 210   | 5,957.70  | 0.00 |
| 99  | 02238  | 广汽集团 | 1,225 | 5,755.79  | 0.00 |
| 100 | 301231 | 荣信文化 | 275   | 5,604.50  | 0.00 |
| 101 | 301309 | 万得凯  | 228   | 5,576.88  | 0.00 |
| 102 | 301233 | 盛帮股份 | 158   | 5,419.40  | 0.00 |
| 103 | 301316 | 慧博云通 | 359   | 5,140.88  | 0.00 |

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

## 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  | 01024  | 快手-W   | 967,416,291.46 | 3.50            |
| 2  | 600703 | 三安光电   | 515,082,302.84 | 1.87            |
| 3  | 03690  | 美团-W   | 488,547,832.66 | 1.77            |
| 4  | 02382  | 舜宇光学科技 | 468,737,193.10 | 1.70            |
| 5  | 601012 | 隆基绿能   | 441,009,097.14 | 1.60            |
| 6  | 300454 | 深信服    | 418,823,662.05 | 1.52            |
| 7  | 00700  | 腾讯控股   | 380,224,038.87 | 1.38            |
| 8  | 600309 | 万华化学   | 373,707,348.93 | 1.35            |
| 9  | 00291  | 华润啤酒   | 359,296,521.79 | 1.30            |
| 10 | 688303 | 大全能源   | 355,369,940.32 | 1.29            |
| 11 | 600745 | 闻泰科技   | 334,546,934.14 | 1.21            |
| 12 | 000739 | 普洛药业   | 317,426,752.64 | 1.15            |
| 13 | 01347  | 华虹半导体  | 283,244,854.18 | 1.03            |
| 14 | 688200 | 华峰测控   | 280,806,427.73 | 1.02            |
| 15 | 09992  | 泡泡玛特   | 276,237,151.80 | 1.00            |
| 16 | 603259 | 药明康德   | 253,310,136.88 | 0.92            |
| 17 | 00168  | 青岛啤酒股份 | 239,288,490.34 | 0.87            |

|    |       |       |                |      |
|----|-------|-------|----------------|------|
| 18 | 02269 | 药明生物  | 223,217,936.58 | 0.81 |
| 19 | 06699 | 时代天使  | 205,343,650.29 | 0.74 |
| 20 | 06078 | 海吉亚医疗 | 202,027,226.74 | 0.73 |

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  | 600309 | 万华化学 | 898,364,291.12 | 3.25            |
| 2  | 600754 | 锦江酒店 | 846,876,077.34 | 3.07            |
| 3  | 600521 | 华海药业 | 688,809,387.77 | 2.50            |
| 4  | 002415 | 海康威视 | 605,781,646.14 | 2.19            |
| 5  | 03690  | 美团-W | 586,621,429.87 | 2.12            |
| 6  | 600690 | 海尔智家 | 535,830,266.85 | 1.94            |
| 7  | 600438 | 通威股份 | 517,938,901.37 | 1.88            |
| 8  | 002555 | 三七互娱 | 515,757,801.41 | 1.87            |
| 9  | 01024  | 快手-W | 463,272,496.15 | 1.68            |
| 10 | 600745 | 闻泰科技 | 443,360,899.54 | 1.61            |
| 11 | 601012 | 隆基绿能 | 380,041,958.21 | 1.38            |
| 12 | 000733 | 振华科技 | 359,628,663.52 | 1.30            |
| 13 | 603517 | 绝味食品 | 340,189,284.80 | 1.23            |
| 14 | 00175  | 吉利汽车 | 327,113,746.70 | 1.18            |
| 15 | 600703 | 三安光电 | 313,213,877.13 | 1.13            |
| 16 | 600873 | 梅花生物 | 301,713,769.00 | 1.09            |
| 17 | 688303 | 大全能源 | 300,883,568.25 | 1.09            |
| 18 | 000739 | 普洛药业 | 293,345,958.21 | 1.06            |
| 19 | 600089 | 特变电工 | 276,237,901.99 | 1.00            |
| 20 | 00763  | 中兴通讯 | 250,623,494.41 | 0.91            |

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 | 10,844,721,800.90 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 13,250,933,302.23 |

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 | -    | -             |
| 2  | 央行票据 | -    | -             |

|    |           |                |      |
|----|-----------|----------------|------|
| 3  | 金融债券      | 602,750,465.75 | 3.15 |
|    | 其中：政策性金融债 | 602,750,465.75 | 3.15 |
| 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） | 37,532,479.07  | 0.20 |
| 8  | 同业存单      | -              | -    |
| 9  | 其他        | -              | -    |
| 10 | 合计        | 640,282,944.82 | 3.35 |

## 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<br>(张) | 公允价值           | 占基金资产净值比例<br>(%) |
|----|--------|----------|-----------|----------------|------------------|
| 1  | 220306 | 22 进出 06 | 6,000,000 | 602,750,465.75 | 3.15             |
| 2  | 127074 | 麦米转 2    | 264,653   | 30,806,298.02  | 0.16             |
| 3  | 113658 | 密卫转债     | 56,300    | 6,726,181.05   | 0.04             |

## 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：贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

## 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

基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

## 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

本基金投资国债期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以萃取相应债券组合的超额收益。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 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。

### 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 | 1,106,268.30  |
| 2  | 应收清算款 | 152,870.18    |
| 3  | 应收股利  | -             |
| 4  | 应收利息  | -             |
| 5  | 应收申购款 | 9,988,323.08  |
| 6  | 其他应收款 | -             |
| 7  | 待摊费用  | -             |
| 8  | 其他    | -             |
| 9  | 合计    | 11,247,461.56 |

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值    | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明  |
|----|--------|------|----------------|---------------|-----------|
| 1  | 600703 | 三安光电 | 265,953,545.80 | 1.39          | 非公开发行流通受限 |

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别 | 持有人户数 | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 |       |
|------|-------|-----------|-------|-------|
|      |       |           | 机构投资者 | 个人投资者 |
|      |       |           |       |       |

|          | (户)     |           | 持有份额             | 占总<br>份额<br>比例<br>(%) | 持有份额              | 占总<br>份额<br>比例<br>(%) |
|----------|---------|-----------|------------------|-----------------------|-------------------|-----------------------|
| 兴全合宜混合 A | 620,015 | 18,962.15 | 1,137,564,754.14 | 9.68                  | 10,619,252,621.03 | 90.32                 |
| 兴全合宜混合 C | 144,723 | 5,480.35  | 6,293,384.78     | 0.79                  | 786,838,618.20    | 99.21                 |
| 合计       | 764,738 | 16,410.78 | 1,143,858,138.92 | 9.11                  | 11,406,091,239.23 | 90.89                 |

## 9.2 期末上市基金前十名持有人

### 兴全合宜混合 A

| 序号 | 持有人名称                                      | 持有份额 (份)      | 占上市总份额比例 (%) |
|----|--|---------------|--------------|
| 1  | 夏建   | 41,959,880.00 | 1.30         |
| 2  | 中荷人寿保险有限公司                                 | 32,299,828.00 | 1.00         |
| 3  | 兴业证券股份有限公司                                 | 31,365,468.00 | 0.97         |
| 4  | 金圆资本管理(厦门)有限公司                             | 26,205,173.00 | 0.81         |
| 5  | 国信证券股份有限公司                                 | 20,666,560.00 | 0.64         |
| 6  | 蒋剑松  | 16,244,957.00 | 0.50         |
| 7  | 浙商证券股份有限公司                                 | 16,085,719.00 | 0.50         |
| 8  | 颜贤德  | 14,781,662.00 | 0.46         |
| 9  | 上海浦东发展银行股份有限公司-兴证全球积极配置三年封闭运作混合型基金中基金(FOF) | 14,366,881.00 | 0.45         |
| 10 | 江泉   | 14,234,861.00 | 0.44         |

注：上表所列持有人为本基金场内持有人。

## 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 | 兴全合宜混合 A | 41,859,770.43 | 0.3560       |
|                  | 兴全合宜混合 C | 1,808,347.56  | 0.2280       |
|                  | 合计       | 43,668,117.99 | 0.3480       |

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

#### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                           | 份额级别     | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|------------------------------|----------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金 | 兴全合宜混合 A | >100              |
|                              | 兴全合宜混合 C | 50~100            |
|                              | 合计       | >100              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金              | 兴全合宜混合 A | >100              |
|                              | 兴全合宜混合 C | 0                 |
|                              | 合计       | >100              |

注：本基金的基金经理也是本公司投资部门负责人，故上述两点统计数据有重合部分。

#### 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                                  | 兴全合宜混合 A          | 兴全合宜混合 C       |
|-------------------------------------|-------------------|----------------|
| 基金合同生效日<br>(2018 年 1 月 23 日) 基金份额总额 | 32,699,592,445.33 | -              |
| 本报告期期初基金份额总额                        | 13,258,180,965.54 | 860,704,848.33 |
| 本报告期基金总申购份额                         | 1,862,536,845.81  | 371,451,789.63 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                       | 3,363,900,436.18  | 439,024,634.98 |
| 本报告期基金拆分变动份额                        | -                 | -              |
| 本报告期末基金份额总额                         | 11,756,817,375.17 | 793,132,002.98 |

注：申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

### § 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 7 月 15 日起，孙乐女士担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

### 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 2018 年起连续 5 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 10.00 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：本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 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 (%) |    |
| 中金公司 | 2      | 4,199,911,122.26 | 18.15            | 2,749,080.03 | 16.97          | -  |
| 广发证券 | 4      | 3,223,315,325.61 | 13.93            | 2,166,202.68 | 13.37          | -  |
| 兴业证券 | 3      | 3,075,942,771.77 | 13.29            | 2,928,666.79 | 18.08          | -  |
| 天风证券 | 2      | 2,581,229,979.56 | 11.15            | 1,662,199.29 | 10.26          | -  |
| 长江证券 | 2      | 1,702,224,416.63 | 7.36             | 1,133,417.33 | 7.00           | -  |

|          |   |                  |      |            |      |          |
|----------|---|------------------|------|------------|------|----------|
| 中信证券     | 5 | 1,390,240,950.83 | 6.01 | 969,870.37 | 5.99 | -        |
| 国盛证券     | 2 | 1,335,191,374.23 | 5.77 | 895,808.77 | 5.53 | -        |
| 东吴证券     | 2 | 1,146,234,714.85 | 4.95 | 743,088.37 | 4.59 | -        |
| 东方证券     | 1 | 928,421,788.74   | 4.01 | 678,951.38 | 4.19 | -        |
| 国信证券     | 2 | 765,952,082.31   | 3.31 | 545,295.05 | 3.37 | -        |
| 东方财富证券   | 2 | 655,440,148.65   | 2.83 | 295,340.62 | 1.82 | -        |
| 国金证券     | 2 | 529,700,088.70   | 2.29 | 346,679.29 | 2.14 | -        |
| 华泰证券     | 2 | 452,314,067.11   | 1.95 | 301,023.81 | 1.86 | -        |
| 国泰君安     | 2 | 392,332,518.74   | 1.70 | 295,636.35 | 1.82 | -        |
| 华创证券     | 1 | 361,301,540.18   | 1.56 | 264,423.10 | 1.63 | -        |
| 申万宏源证券   | 2 | 210,118,261.11   | 0.91 | 94,835.83  | 0.59 | -        |
| 摩根大通证券   | 2 | 125,474,100.99   | 0.54 | 83,895.74  | 0.52 | -        |
| 招商证券     | 2 | 65,056,775.41    | 0.28 | 48,153.23  | 0.30 | -        |
| 安信证券     | 2 | -                | -    | -          | -    | -        |
| 渤海证券     | 2 | -                | -    | -          | -    | -        |
| 德邦证券     | 2 | -                | -    | -          | -    | -        |
| 国都证券     | 2 | -                | -    | -          | -    | -        |
| 华福证券     | 1 | -                | -    | -          | -    | -        |
| 华西证券     | 2 | -                | -    | -          | -    | -        |
| 民生证券     | 1 | -                | -    | -          | -    | -        |
| 南京证券     | 1 | -                | -    | -          | -    | -        |
| 太平洋证券    | 2 | -                | -    | -          | -    | -        |
| 万联证券     | 1 | -                | -    | -          | -    | -        |
| 信达证券     | 2 | -                | -    | -          | -    | -        |
| 银河证券     | 1 | -                | -    | -          | -    | -        |
| 中国中金财富证券 | 4 | -                | -    | -          | -    | -        |
| 中泰证券     | 2 | -                | -    | -          | -    | 退租<br>2个 |
| 中信建投     | 5 | -                | -    | -          | -    | -        |



|    |  |  |  |  |  |  |
|----|--|--|--|--|--|--|
| 证券 |  |  |  |  |  |  |
|----|--|--|--|--|--|--|

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(%) |
| 中金公司   | -             | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 广发证券   | 44,728,392.60 | 100.00          | -      | -                 | -    | -               |
| 兴业证券   | -             | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 天风证券   | -             | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 长江证券   | -             | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 中信证券   | -             | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 国盛证券   | -             | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 东吴证券   | -             | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 东方证券   | -             | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 国信证券   | -             | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 东方财富证券 | -             | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 国金证券   | -             | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 华泰证券   | -             | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 国泰君安   | -             | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 华创证券   | -             | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 申万宏    | -             | -               | -      | -                 | -    | -               |

|          |   |   |   |   |   |   |
|----------|---|---|---|---|---|---|
| 源证券      |   |   |   |   |   |   |
| 摩根大通证券   | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券     | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券     | - | - | - | - | - | - |
| 渤海证券     | - | - | - | - | - | - |
| 德邦证券     | - | - | - | - | - | - |
| 国都证券     | - | - | - | - | - | - |
| 华福证券     | - | - | - | - | - | - |
| 华西证券     | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券     | - | - | - | - | - | - |
| 南京证券     | - | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券    | - | - | - | - | - | - |
| 万联证券     | - | - | - | - | - | - |
| 信达证券     | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券     | - | - | - | - | - | - |
| 中国中金财富证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券     | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券   | - | - | - | - | - | - |

### 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 | 上海证券报、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            | 上海证券报、规定互联网站 | 2022-01-06 |

|    |   |                   |            |
|----|---|-------------------|------------|
| 3  | 关于旗下部分基金 2022 年非港股通交易日暂停申购、赎回等业务安排的提示性公告          | 上海证券报、规定互联<br>网网站 | 2022-01-10 |
| 4  | 关于增加旗下部分基金销售机构的公告                                 | 上海证券报、规定互联<br>网网站 | 2022-01-19 |
| 5  | 关于副总经理离任的公告                                       | 上海证券报、规定互联<br>网网站 | 2022-01-21 |
| 6  | 关于兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 暂停申购 (含定投)、转换、赎回业务的公告   | 上海证券报、规定互联<br>网网站 | 2022-01-25 |
| 7  | 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                       | 上海证券报、规定互联<br>网网站 | 2022-01-26 |
| 8  | 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                         | 上海证券报、规定互联<br>网网站 | 2022-01-27 |
| 9  | 关于公司副总经理任职的公告                                     | 上海证券报、规定互联<br>网网站 | 2022-01-28 |
| 10 | 关于增加德邦证券为旗下部分基金销售机构的公告                            | 上海证券报、规定互联<br>网网站 | 2022-03-15 |
| 11 | 关于兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 暂停申购 (含定投)、转换、赎回业务的公告   | 上海证券报、规定互联<br>网网站 | 2022-03-29 |
| 12 | 关于增加财达证券为旗下部分基金销售机构的公告                            | 上海证券报、规定互联<br>网网站 | 2022-04-11 |
| 13 | 关于兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 暂停申购 (含定投)、转换、赎回业务的公告   | 上海证券报、规定互联<br>网网站 | 2022-04-13 |
| 14 | 关于增加兴业银行为旗下部分基金销售机构的公告                            | 上海证券报、规定互联<br>网网站 | 2022-04-20 |
| 15 | 关于旗下部分基金投资玲珑轮胎 (601966) 非公开发行股票的公告                | 上海证券报、规定互联<br>网网站 | 2022-04-21 |
| 16 | 关于兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 暂停申购 (含定投)、转换、赎回业务的公告   | 上海证券报、规定互联<br>网网站 | 2022-04-26 |
| 17 | 关于增加兴业银行为旗下部分基金销售机构的公告                            | 上海证券报、规定互联<br>网网站 | 2022-05-06 |
| 18 | 关于兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 基金暂停申购 (含定投)、转换、赎回业务的公告 | 上海证券报、规定互联<br>网网站 | 2022-05-06 |
| 19 | 关于增加南京银行为旗下部分基金销售机构的公告                            | 上海证券报、规定互联<br>网网站 | 2022-05-06 |
| 20 | 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                     | 上海证券报、规定互联<br>网网站 | 2022-06-17 |
| 21 | 关于兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 暂停申购 (含定投)              | 上海证券报、规定互联<br>网网站 | 2022-06-28 |

|    |   |               |            |
|----|---|---------------|------------|
|    | 投)、转换、赎回业务的公告                                   |               |            |
| 22 | 关于公司副总经理变更的公告                                   | 上海证券报、规定互联网网站 | 2022-06-30 |
| 23 | 关于增加华宝证券为旗下部分基金销售机构的公告                          | 上海证券报、规定互联网网站 | 2022-08-26 |
| 24 | 关于增加平安证券为旗下部分基金销售机构的公告                          | 上海证券报、规定互联网网站 | 2022-09-06 |
| 25 | 关于增加国新证券为旗下部分基金销售机构的公告                          | 上海证券报、规定互联网网站 | 2022-09-13 |
| 26 | 关于增加旗下部分基金销售机构的公告                               | 上海证券报、规定互联网网站 | 2022-09-16 |
| 27 | 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                    | 上海证券报、规定互联网网站 | 2022-09-27 |
| 28 | 关于兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 暂停申购 (含定投)、转换、赎回业务的公告 | 上海证券报、规定互联网网站 | 2022-09-27 |
| 29 | 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                    | 上海证券报、规定互联网网站 | 2022-09-28 |
| 30 | 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                       | 上海证券报、规定互联网网站 | 2022-10-18 |
| 31 | 关于关闭网上直销汇款交易的公告                                 | 上海证券报、规定互联网网站 | 2022-10-24 |
| 32 | 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                  | 上海证券报、规定互联网网站 | 2022-11-09 |
| 33 | 关于增加渤海证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告                    | 上海证券报、规定互联网网站 | 2022-11-16 |
| 34 | 关于增加旗下部分基金销售机构的公告                               | 上海证券报、规定互联网网站 | 2022-11-17 |
| 35 | 关于增加中泰证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告                    | 上海证券报、规定互联网网站 | 2022-11-18 |
| 36 | 关于我司网上直销平台汇通宝相关业务停止办理的通知                        | 上海证券报、规定互联网网站 | 2022-11-30 |
| 37 | 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                       | 上海证券报、规定互联网网站 | 2022-12-06 |
| 38 | 关于旗下部分基金投三安光电 (600703) 非公开发行股票的公告               | 上海证券报、规定互联网网站 | 2022-12-16 |
| 39 | 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                  | 上海证券报、规定互联网网站 | 2022-12-16 |
| 40 | 关于我司网上交易系统暂停服务的通知                               | 上海证券报、规定互联网网站 | 2022-12-16 |
| 41 | 关于兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 暂停申购 (含定投)、赎回、转换业务的公告 | 上海证券报、规定互联网网站 | 2022-12-22 |

## § 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、中国证监会准予兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金（LOF）注册的批复
- 2、《兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》
- 3、《兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金（LOF）托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 5、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 6、关于申请募集注册兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的法律意见书
- 7、中国证监会要求的其他文件

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

### 13.3 查阅方式

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

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

兴证全球基金管理有限公司

2023年3月31日