

兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金  
(LOF)  
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：兴证全球基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	6
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 其他指标 .....	10
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	14
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表 .....	14
6.2 利润表 .....	16
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	17
6.4 报表附注 .....	20
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>55</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	55
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	55
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	56
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	61
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	61
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	61

7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	62
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	62
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	62
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
7.12	投资组合报告附注	62
<b>§ 8</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>63</b>
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
8.2	期末上市基金前十名持有人	64
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	64
<b>§ 9</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>65</b>
<b>§ 10</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>65</b>
10.1	基金份额持有人大会决议	65
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	65
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
10.4	基金投资策略的改变	65
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	65
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	65
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	66
10.8	其他重大事件	69
<b>§ 11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>70</b>
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	70
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	70
<b>§ 12</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>70</b>
12.1	备查文件目录	70
12.2	存放地点	71
12.3	查阅方式	71

## § 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	
报告期末基金份额总额	11,810,473,511.90 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2018 年 4 月 23 日	
下属分级基金的基金简称	兴全合宜混合 A	兴全合宜混合 C
下属分级基金的场内简称	兴全合宜	无
下属分级基金的交易代码	163417	005491
报告期末下属分级基金的份额总额	11,051,657,021.37 份	758,816,490.53 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。

3、若销售机构为投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日为非刚港股通交易日，则本基金不开放。

### 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	本基金是一只混合型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其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。 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。投资者可在二级市场买卖基金份额，受市场供需关系等各种因素的影响，投资者买卖基金份额有可能面临相应的折溢价风险。
--	--

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		兴证全球基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨卫东	张姗
	联系电话	021-20398888	0755-83077987
	电子邮箱	yangwd@xqfunds.com	zhangshan_1027@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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.xqfunds.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	A 类份额：中国证券登记结算有限责任公司 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 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 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	兴全合宜混合 A	兴全合宜混合 C
本期已实现收益	-944,937,368.34	-65,535,340.58
本期利润	-963,031,074.87	-66,142,409.79
加权平均基金份额本期利润	-0.0841	-0.0859

本期加权平均净值利润率	-5.54%	-5.76%
本期基金份额净值增长率	-5.65%	-5.94%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	4,843,658,428.34	311,100,305.50
期末可供分配基金份额利润	0.4383	0.4100
期末基金资产净值	15,895,315,449.71	1,069,916,796.03
期末基金份额净值	1.4383	1.4100
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	43.83%	16.11%

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

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

3、所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：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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.35%	1.25%	1.52%	0.77%	-0.17%	0.48%
过去三个月	-7.39%	1.06%	-4.31%	0.69%	-3.08%	0.37%

过去六个月	-5.65%	1.10%	-1.01%	0.72%	-4.64%	0.38%
过去一年	-15.68%	1.36%	-10.79%	0.87%	-4.89%	0.49%
过去三年	1.00%	1.42%	-7.58%	0.95%	8.58%	0.47%
自基金合同生效 起至今	43.83%	1.28%	-12.23%	0.98%	56.06%	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
过去一个月	1.30%	1.25%	1.52%	0.77%	-0.22%	0.48%
过去三个月	-7.52%	1.06%	-4.31%	0.69%	-3.21%	0.37%
过去六个月	-5.94%	1.10%	-1.01%	0.72%	-4.93%	0.38%
过去一年	-16.19%	1.36%	-10.79%	0.87%	-5.40%	0.49%
过去三年	-0.79%	1.43%	-7.58%	0.95%	6.79%	0.48%
自基金合同生效 起至今	16.11%	1.45%	-7.40%	0.97%	23.51%	0.48%

注：1. 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%。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，是反映香港股市价幅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：

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

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

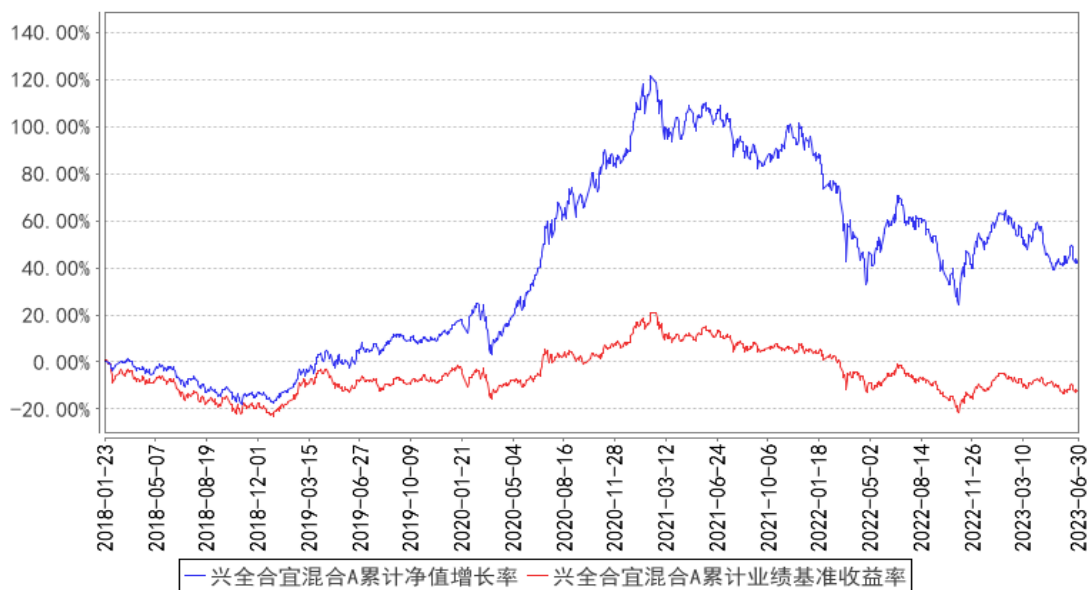


其中,  $t = 1, 2, 3, \dots, T$ ,  $T$  表示时间截至日。

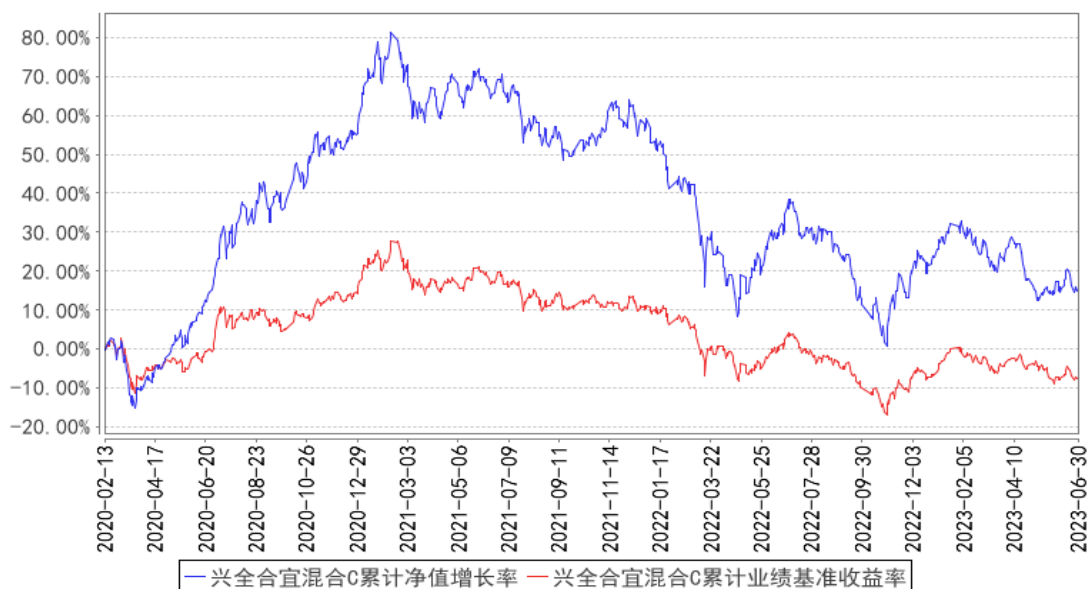
2. 自 2020 年 2 月 13 日起, 本基金开始销售兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) C 类份额 (代码: 005491)。详情请见管理人网站公告。

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

兴全合宜混合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 2023 年 06 月 30 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、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)。详情请见管理人网站公告。

### 3.3 其他指标

注: 无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2023 年 6 月 30 日，公司旗下已管理兴全可转债混合型证券投资基金等共 58 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	2018 年 1 月 23 日	-	16 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。

	型证券投资基金基金经理、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				
程剑	本基金的基金经理	2023 年 1 月 30 日	-	9 年	硕士, 2007 年 8 月至 2009 年 6 月就职于万向集团有限公司, 2012 年 6 月至 2014 年 7 月就职于涛石股权投资管理 (上海) 有限公司, 2014 年 7 月至 2015 年 3 月就职于中国国际金融有限公司, 2015 年 3 月至今就职于兴证全球基金管理有限公司, 先后担任研究员、基金经理助理。
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	-	11 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，本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划的投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全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 公平交易制度的执行情况

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

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金上半年一方面关注与挖掘人工智能、港股互联网等新兴产业投资机会，另一方面持续跟踪周期、消费、医药、新能源等。基金总体维持较高的仓位，仍将以追求长期收益为主要目标，持续关注行业景气度、公司核心竞争力、商业模式、企业家精神等影响公司长期价值的因素。

##### 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 1.4383 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.65%，同期业绩比较基准收益率为-1.01%；截至本报告期末兴全合宜混合 C 的基金份额净值

为 1.4100 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.94%，同期业绩比较基准收益率为-1.01%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年以来宏观经济呈现弱复苏态势。地产数据仍处于下行周期，靠基建投资托底。年中以来国家在房屋旧改、认房不认贷等多种方面优化调整地产政策预期，其效果显现需要时间和力度的精准把握；居民消费增长仍受到收入预期转弱影响，迟迟未启动。海外美联储连续加息后，美国各项经济数据仍未见衰退。

从各板块看，随着 CHATGPT4.0 的发布和应用，人工智能在应用端的空间打开，服务器、算力、模型、芯片需求不断放大；上半年游戏版号增加，影视产品供应增加，相关公司市值上涨后有所回调，主要是 AI 在各个领域的杀手级应用出现还需时间和技术不断演进。另外与固投周期相关行业走弱，之后随地产预期好转出现阶段性反弹，如地产、建材、煤炭、钢铁、轻工等板块。在港股方面，恒生指数和恒生科技指数上半年分别下跌 4.37%和 5.27%，港股互联网、医药等大市值公司股价以震荡为主。

展望下半年，关注宏观经济拐点与关注各个新兴技术的边际变化并举，平衡好股价短期波动和公司长期投资之间的矛盾，以长视角继续寻找和持有具有良好投资性价比的公司，期望为投资人获取稳健的投资回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：1、估值委员会制定旗下基金的估值政策和流程，选取适当的估值方法、定期对估值政策和程序进行评价。采用的基金估值方法、政策和程序应经估值委员会审议，并报管理层批准后方可实施。2、估值方法确立后，由 IT 人员或 IT 人员协助估值系统开发商及时对系统中的参数或模型作相应的调整或对系统进行升级，以适应新的估值方法的需要。3、基金会计具体负责执行估值委员会确定的估值策略，并通过与托管行核对等方法确保估值准确无误。4、投资人员（包括基金经理）积极关注市场环境变化及证券发行机构有关影响证券价格的重大事件等可能对给估值造成影响的因素，并就可能带来的影响提出建议和意见。5、合规管理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；负责基金估值业务的定期和临时信息披露。6、审计部对估值流程、估值结果等进行检查，确保估值委员会决议的有效执行。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《兴全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，本报告期内未进行利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

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

本基金本报告期内未发生需披露的基金份额持有人数不满两百人或基金资产净值低于五千元的情形。

### § 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遵规守信、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。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	376,110,324.26	783,751,443.66
结算备付金		21,889,615.98	22,197,723.40

存出保证金		1,498,172.65	1,106,268.30
交易性金融资产	6.4.7.2	16,603,558,081.87	18,367,693,088.72
其中：股票投资		15,840,695,588.81	17,727,410,143.90
基金投资		-	-
债券投资		762,862,493.06	640,282,944.82
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		7,775,813.06	152,870.18
应收股利		6,940,974.27	-
应收申购款		3,511,324.74	9,988,323.08
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		17,021,284,306.83	19,184,889,717.34
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		16,426,895.30	18,545,111.08
应付赎回款		9,887,901.28	21,623,934.03
应付管理人报酬		21,140,681.00	24,157,396.16
应付托管费		3,523,446.84	4,026,232.71
应付销售服务费		532,633.52	600,636.38
应付投资顾问费		-	-
应交税费		344.41	213.53
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	4,540,158.74	3,330,114.72
负债合计		56,052,061.09	72,283,638.61
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	11,810,473,511.90	12,549,949,378.15
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	5,154,758,733.84	6,562,656,700.58

净资产合计		16,965,232,245.74	19,112,606,078.73
负债和净资产总计		17,021,284,306.83	19,184,889,717.34

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 11,810,473,511.90 份。其中兴全合宜混合 A 基金份额总额 11,051,657,021.37 份，基金份额净值 1.4383；兴全合宜混合 C 基金份额总额 758,816,490.53 份，基金份额净值 1.4100。

## 6.2 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-864,246,856.49	-3,476,843,034.70
1. 利息收入		1,234,220.97	2,449,578.00
其中：存款利息收入	6.4.7.13	1,234,220.97	2,449,578.00
债券利息收入		-	-
资产支持证券 利息收入		-	-
买入返售金融 资产收入		-	-
证券出借利息 收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		-848,654,093.59	-929,270,508.85
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-941,747,515.02	-1,033,931,937.39
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	10,973,552.60	10,963,125.25
资产支持证券 投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收 益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	82,119,868.83	93,698,303.29
以摊余成本计 量的金融资产终止确 认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益 （损失以“-”号填 列）	6.4.7.20	-18,700,775.74	-2,557,737,116.61



4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	1,873,791.87	7,715,012.76
<b>减：二、营业总支出</b>		164,926,628.17	198,033,743.19
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	138,292,393.99	166,266,444.07
2. 托管费	6.4.10.2.2	23,048,732.32	27,711,074.00
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	3,424,378.54	3,888,068.84
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	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		191.69	48.65
8. 其他费用	6.4.7.23	160,931.63	168,107.63
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-1,029,173,484.66	-3,674,876,777.89
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-1,029,173,484.66	-3,674,876,777.89
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-1,029,173,484.66	-3,674,876,777.89

### 6.3 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	12,549,949,378.15	-	6,562,656,700.58	19,112,606,078.73
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)	12,549,949,378.15	-	6,562,656,700.58	19,112,606,078.73
三、本期增减变	-	-	-	-

动额(减少以“-”号填列)	739,475,866.25		1,407,897,966.74	2,147,373,832.99
(一)、综合收益总额	-	-	1,029,173,484.66	1,029,173,484.66
(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)	-	-	-	-
其中：1. 基金申购款	739,475,866.25		378,724,482.08	1,118,200,348.33
2. 基金赎回款	482,210,820.02	-	254,353,302.74	736,564,122.76
	-	-	-	-
	1,221,686,686.27	-	633,077,784.82	1,854,764,471.09
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	11,810,473,511.90	-	5,154,758,733.84	16,965,232,245.74
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	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、本期期初净资产(基金净值)	14,118,885,813	-	13,487,068,220	27,605,954,034.

	. 87		. 81	68
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	- 920,894,617.04	-	4,189,573,430. 69	5,110,468,047.7 3
(一)、综合收益总额	-	-	3,674,876,777. 89	3,674,876,777.8 9
(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)	- 920,894,617.04	-	514,696,652.80	1,435,591,269.8 4
其中：1. 基金申购款	1,513,378,599. 45	-	992,386,866.73	2,505,765,466.1 8
2. 基金赎回款	- 2,434,273,216. 49	-	- 1,507,083,519. 53	- 3,941,356,736.0 2
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	13,197,991,196 . 83	-	9,297,494,790. 12	22,495,485,986. 95

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

杨华辉

基金管理人负责人

庄园芳

主管会计工作负责人

詹鸿飞

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内未发生重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内未发生重大会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

### 6.4.6 税项

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,暂不计缴企业所得税。

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入,由上市公司代扣代缴个人所得税;从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
活期存款	376,110,324.26
等于：本金	376,081,122.84
加：应计利息	29,201.42
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	376,110,324.26

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	18,364,436,767.44	-	15,840,695,588.81	- 2,523,741,178.63	
贵金属投资 -金交所黄金 合约	-	-	-	-	
债券	交易所市 场	142,462,864.17	792,420.68	157,995,329.64	14,740,044.79
	银行 间市	598,487,430.00	4,910,163.42	604,867,163.42	1,469,570.00

	场				
	合计	740,950,294.17	5,702,584.10	762,862,493.06	16,209,614.79
资产支持证 券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		19,105,387,061.61	5,702,584.10	16,603,558,081.87	- 2,507,531,563.84

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末各项买入返售金融资产余额为零。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未通过买断式逆回购交易取得债券。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

##### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。



## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	7,307.64
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	4,428,712.75
其中：交易所市场	4,426,262.75
银行间市场	2,450.00
应付利息	-
预提信息披露费	59,507.37
预提审计费	44,630.98
合计	4,540,158.74

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 兴全合宜混合 A

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	11,756,817,375.17	11,756,817,375.17
本期申购	374,112,760.49	374,112,760.49
本期赎回（以“-”号填列）	-1,079,273,114.29	-1,079,273,114.29
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	11,051,657,021.37	11,051,657,021.37

## 兴全合宜混合 C

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	793,132,002.98	793,132,002.98

本期申购	108,098,059.53	108,098,059.53
本期赎回(以“-”号填列)	-142,413,571.98	-142,413,571.98
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	758,816,490.53	758,816,490.53

注：申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换转出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 6.4.7.12 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
上年度末	8,357,249,197.42	-2,190,359,685.72	6,166,889,511.70
本期利润	-944,937,368.34	-18,093,706.53	-963,031,074.87
本期基金份额交易产生的变动数	-461,506,383.32	101,306,374.83	-360,200,008.49
其中：基金申购款	252,965,396.17	-51,629,817.43	201,335,578.74
基金赎回款	-714,471,779.49	152,936,192.26	-561,535,587.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,950,805,445.76	-2,107,147,017.42	4,843,658,428.34

##### 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
上年度末	541,008,247.55	-145,241,058.67	395,767,188.88
本期利润	-65,535,340.58	-607,069.21	-66,142,409.79
本期基金份额交易产生的变动数	-22,277,299.46	3,752,825.87	-18,524,473.59
其中：基金申购款	68,708,526.07	-15,690,802.07	53,017,724.00
基金赎回款	-90,985,825.53	19,443,627.94	-71,542,197.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	453,195,607.51	-142,095,302.01	311,100,305.50

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	884,715.48
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	336,250.25
其他	13,255.24

合计	1,234,220.97
----	--------------

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-941,747,515.02
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	-941,747,515.02

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	10,009,095,834.51
减：卖出股票成本总额	10,922,473,706.03
减：交易费用	28,369,643.50
买卖股票差价收入	-941,747,515.02

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	5,438,139.47
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	5,535,413.13
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	10,973,552.60

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	363,767,354.61
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	353,474,680.00
减：应计利息总额	4,753,406.44
减：交易费用	3,855.04
买卖债券差价收入	5,535,413.13

#### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

#### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

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

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

##### 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

##### 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

##### 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

##### 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内未进行衍生工具买卖交易。

##### 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

#### 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	82,119,868.83
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	82,119,868.83

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	-18,700,775.74
股票投资	-27,806,293.98
债券投资	9,105,518.24
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	-18,700,775.74

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	1,717,637.89
基金转换费收入	156,153.98
合计	1,873,791.87

#### 6.4.7.22 信用减值损失

无。

## 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	38,193.28
账户维护费	18,600.00
合计	160,931.63

## 6.4.7.24 分部报告

无。

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

## 6.4.8.2 资产负债表日后事项

根据本基金的基金管理人于 2023 年 7 月 8 日发布的《兴证全球基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，本基金自 2023 年 7 月 10 日起基金管理费率自 1.50% 降低至 1.20%，托管费率自 0.25% 降低至 0.20%。

## 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

## 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
兴证全球基金管理有限公司（“兴证全球基金”）	基金管理人、基金销售机构、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

注：1、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2、兴证全球基金为本基金 C 类份额的注册登记机构。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例 (%)
兴业证券	1,712,690,181.16	8.98	1,530,595,868.99	11.35

#### 6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
兴业证券	1,625,999.83	12.61	209,446.95	4.73
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
兴业证券	1,459,586.68	15.78	241,610.27	5.11

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

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	138,292,393.99	166,266,444.07
其中：支付销售机构的客户维护费	41,094,402.22	45,875,677.41

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。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	23,048,732.32	27,711,074.00

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费率。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方 名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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	-	78,109.99	78,109.99
兴证全球基金	-	202,780.91	202,780.91
招商银行	-	318,048.14	318,048.14
合计	-	598,939.04	598,939.04
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴全合宜混合 A	兴全合宜混合 C	合计
兴业证券	-	109,528.31	109,528.31
兴证全球基金	-	271,580.68	271,580.68
招商银行	-	331,241.80	331,241.80
合计	-	712,350.79	712,350.79

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，逐日累记至每月月底，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。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

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

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

注：本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

注：本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	兴全合宜混合 A	兴全合宜混合 C
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	105,610,738.14	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减:报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	105,610,738.14	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.8942%	-%
项目	上年度可比期间	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

	兴全合宜混合 A	兴全合宜混合 C
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	-
报告期内申购/买入总份额	39,680,045.13	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减:报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	91,289,936.13	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.6917%	-%

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

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

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

份额单位: 份

##### 兴全合宜混合 A

关联方名称	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例(%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例(%)
兴业证券	31,365,468.00	0.2656	31,365,468.00	0.2499

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。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	376,110,324.26	884,715.48	934,088,558.53	2,125,191.80

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。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位: 人民币元

本期
----

2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
兴业证券	688469	中芯集成	首次公开发行网下申购	137,994	785,185.86
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001286	陕西能源	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-
00132	长	202	6个月	新	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-

4	青科技	3年5月12日	月	股流通受限						
001328	登康口腔	2023年3月29日	6个月	新股流通受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001367	海森药业	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
002980	华盛昌	2023年6月21日	6个月	大宗交易购入流通受限	29.66	31.70	630,000	18,685,800.00	19,971,000.00	-
300188	美亚柏科	2023年4月11日	6个月	大宗交易购入流通受限	22.13	18.66	1,070,000	23,679,100.00	19,966,200.00	-
30115	华	202	6个	新	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-

7	塑科技	3年3月1日	月	股流通受限						
301260	格力博	2023年1月20日	6个月	新股流通受限	30.85	23.63	3,121	96,282.85	73,749.23	-
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月	新股流通受限	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	-
301307	美利信	2023年4月14日	6个月	新股流通受限	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-
301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301337	亚华电子	2023年5月16日	6个月	新股流通受限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301357	北方长龙	2023年4月11日	6个月	新股流通受限	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301358	湖南裕	2023年2月	6个月	新股流	23.77	42.89	2,023	48,086.71	86,766.47	-

	能	1日		通受限						
301382	蜂助手	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
301387	光大同创	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	58.32	45.36	307	17,904.24	13,925.52	-
301428	世纪恒通	2023年5月10日	6个月	新股流通受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
301439	泓淋电力	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-
600549	厦门钨业	2023年3月9日	6个月	大宗交易购入流通受限	19.15	18.57	4,130,000	79,089,500.00	76,694,100.00	-
601065	江盐集团	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-
60113	柏	202	6个	新	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-

3	诚股份	3年3月31日	月	股流通受限						
601138	工业富联	2023年5月22日	6个月	大宗交易购入流通受限	14.87	22.72	10,050,000	149,443,500.00	228,336,000.00	-
603125	常青科技	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
603137	恒尚节能	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
603172	万丰股份	2023年4月28日	6个月	新股流通受限	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
688008	澜起科技	2023年3月22日	6个月	大宗交易购入流通受限	60.00	54.32	630,000	37,800,000.00	34,221,600.00	-
68800	澜	202	6个	大	62.00	54.32	658,456	40,824,272.00	35,767,329.92	-

8	起科技	3年 3月 23日	月	大宗交易 购入 流通受限						
688008	澜起科技	2023年 3月 24日	6个月	大宗交易 购入 流通受限	65.80	54.31	190,000	12,502,000.00	10,318,900.00	-
688099	晶晨股份	2023年 1月 18日	6个月	大宗交易 购入 流通受限	71.81	82.92	1,470,000	105,560,700.00	121,892,400.00	-
688146	中船特气	2023年 4月 13日	6个月	新股流 通受限	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	-
688249	晶合集成	2023年 4月 24日	6个月	新股流 通受限	19.86	18.06	7,405	147,063.30	133,734.30	-
688352	顾中科	2023年 4月	6个月	新股流	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-



	技	11 日		通 受 限							
68836 1	中 科 飞 测	202 3年 5月 12日	6个 月	新 股 流 通 受 限	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-	
68843 3	华 曙 高 科	202 3年 4月 7日	6个 月	新 股 流 通 受 限	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-	
68846 9	中 芯 集 成	202 3年 4月 28日	6个 月	新 股 流 通 受 限	5.69	5.41	13,800	78,522.00	74,658.00	-	
68847 8	晶 升 股 份	202 3年 4月 13日	6个 月	新 股 流 通 受 限	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	-	
68847 9	友 车 科 技	202 3年 5月 4日	6个 月	新 股 流 通 受 限	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-	
68848 4	南 芯 科 技	202 3年 3月 28日	6个 月	新 股 流 通 受 限	39.99	36.71	1,008	40,309.92	37,003.68	-	
68850 7	索 辰 科 技	202 3年 4月 10日	6个 月	新 股 流 通 受 限	245.5 6	122.1 1	150	36,834.00	18,316.50	-	

				限						
688507	索辰科技	2023年6月20日	4个月	新股流通受限 - 转增	-	122.11	72	-	8,791.92	注1
688512	慧智微	2023年5月8日	6个月	新股流通受限	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-
688535	华海诚科	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
688552	航天南湖	2023年5月8日	6个月	新股流通受限	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	-
688570	天玛智控	2023年5月29日	6个月	新股流通受限	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	-
688581	安杰思	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-
688593	新相微	2023年5月25日	6个月	新股流通	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-

		日		受限						
688617	惠泰医疗	2023年4月13日	6个月	大宗交易购入流通受限	336.50	355.25	95,000	31,967,500.00	33,748,750.00	-
688617	惠泰医疗	2023年5月17日	6个月	大宗交易购入流通受限	349.20	352.90	239,086	83,488,831.20	84,373,449.40	-
688617	惠泰医疗	2023年5月25日	6个月	大宗交易购入流通受限	355.19	352.80	130,000	46,174,700.00	45,864,000.00	-

注：1、本基金持有的新股流通受限股票索辰科技，于 2023 年 6 月 20 日实施 2022 年年度权益分配方案，向全体股东每股派发现金红利人民币 0.15 元（含税），同时，以资本公积金向全体股东每股转增 0.48 股。本基金新增 72 股。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有临时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

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

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

##### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	80,140,903.88	37,532,479.07

未评级	-	-
合计	80,140,903.88	37,532,479.07

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

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

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

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金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。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 202 3 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资 产							
银 行 存 款	376,110,324.26	-	-	-	-	-	376,110,324.26
结 算 备 付 金	21,889,615.98	-	-	-	-	-	21,889,615.98
存 出 保 证 金	1,498,172.65	-	-	-	-	-	1,498,172.65
交	-263,968,810	418,752,778	23,155,073	56,985,830	15,840,695.58		16,603,558.08

易性金融资产		.96	.22	.39	.49	8.81	1.87
应收股利	-	-	-	-	-	6,940,974.27	6,940,974.27
应收申购款	221,869.32	-	-	-	-	3,289,455.42	3,511,324.74
应收清算款	-	-	-	-	-	7,775,813.06	7,775,813.06
资产总计	399,719,982.21	263,968,810.96	418,752,778.22	23,155,073.39	56,985,830.49	15,858,701,831.56	17,021,284,306.83
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	9,887,901.28	9,887,901.28
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	21,140,681.00	21,140,681.00
应付托管费	-	-	-	-	-	3,523,446.84	3,523,446.84
应付	-	-	-	-	-	16,426,895.30	16,426,895.30

清算款							
应付销售服务费	-	-	-	-	-	532,633.52	532,633.52
应交税费	-	-	-	-	-	344.41	344.41
其他负债	-	-	-	-	-	4,540,158.74	4,540,158.74
负债总计	-	-	-	-	-	56,052,061.09	56,052,061.09
利率敏感度缺口	399,719,982.21	263,968,810.96	418,752,778.22	23,155,073.39	56,985,830.49	15,802,649.770.47	16,965,232,245.74
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存	783,751,443.66	-	-	-	-	-	783,751,443.66



款							
结算 备付 金	22,197,723. 40	-	-	-	-	-	-22,197,723.40
存出 保证 金	1,106,268.3 0	-	-	-	-	-	1,106,268.30
交易 性金 融资 产	-	602,750,465 .75	6,726,181. 05	30,806,298 .02	17,727,410,14 3.90	18,367,693,08 8.72	
应收 申购 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	17,737,295,62 0.27	19,184,889,71 7.34	
负 债							
应付 赎回 款	-	-	-	-	-	21,623,934.03	21,623,934.03
应付 管理 人报	-	-	-	-	-	24,157,396.16	24,157,396.16

酬							
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
其他负债	-	-	-	-	-	3,330,114.72	3,330,114.72
负债总计	-	-	-	-	-	72,283,638.61	72,283,638.61
利率敏感度缺口	807,311,152.25	602,750,465.75	6,726,181.05	30,806,298.02	17,665,011.98	1.66	19,112,606.078.73

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他影响债券公允价值的变量保持不变，仅利率发生变动；
	假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化(即平移收益率曲线)。

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	1. 市场利率+1%	-3,547,945.88	-3,444,068.25
2. 市场利率-1%	3,603,391.94	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。

#### 6.4.13.4.2 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。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-4,903,882,516.42			4,903,882,516.42
资产合计	-4,903,882,516.42			4,903,882,516.42
以外币计价的负债				
负债合计	-			-
资产负债表外汇 风险敞口净额	-4,903,882,516.42			4,903,882,516.42
项目	上年度末 2022年12月31日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 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	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	7,259,297,406.45	-	7,259,297,406.45

#### 6.4.13.4.2.2 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		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	所有外币相对人民币升值5%	245,194,125.80	362,964,870.32
所有外币相对人民币贬值5%	-245,194,125.80	-362,964,870.32	

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金投资组合比例为：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：

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	15,840,695,588.81	93.37	17,727,410,143.90	92.75
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	762,862,493.06	4.50	640,282,944.82	3.35
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	16,603,558,081.87	97.87	18,367,693,088.72	96.10

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假设单个证券的公允价值和市场组合的公允价值依照资本-资产定价模型 (CAPM) 描述的规律进行变动		
	使用本基金业绩比较基准所对应的市场组合进行分析		
	在业绩基准变化 10% 时，对单个证券相应的公允价值变化进行加总得到基金净值的变化		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 (2023 年 6 月 30 日)	上年度末 (2022 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准+10%	2,026,569,871.92	3,140,970,435.63
	业绩比较基准-10%	-2,026,569,871.92	-3,140,970,435.63

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

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	15,208,742,865.63	16,856,585,252.06
第二层次	682,721,589.18	602,750,465.75
第三层次	712,093,627.06	908,357,370.91
合计	16,603,558,081.87	18,367,693,088.72

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2022年12月31日：无）。

###### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括货币资金、应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相若。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### § 7 投资组合报告

#### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	15,840,695,588.81	93.06
	其中：股票	15,840,695,588.81	93.06
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	762,862,493.06	4.48
	其中：债券	762,862,493.06	4.48
	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	397,999,940.24	2.34
8	其他各项资产	19,726,284.72	0.12
9	合计	17,021,284,306.83	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 4,903,882,516.42 元，占净值比例 28.91%。

#### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	49,529,800.68	0.29
C	制造业	8,945,770,631.94	52.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	26,925,166.48	0.16
E	建筑业	5,974,516.15	0.04
F	批发和零售业	9,735,785.72	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	514,017,039.20	3.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,156,446,194.49	6.82

J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	104,993,631.27	0.62
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	123,420,306.46	0.73
S	综合	-	-
	合计	10,936,813,072.39	64.47

### 7.2.2 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	252,933,345.27	1.49
日常消费品	505,690,570.24	2.98
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	1,175,226,502.23	6.93
工业	-	-
信息技术	863,141,981.40	5.09
通信服务	1,841,896,359.00	10.86
公用事业	-	-
房地产	264,993,758.28	1.56
合计	4,903,882,516.42	28.91

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。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	01024	快手-W	23,296,082	1,150,174,836.09	6.78
2	600703	三安光电	53,190,959	917,012,133.16	5.41
3	00700	腾讯控股	1,984,905	606,842,163.27	3.58
4	688099	晶晨股份	7,166,452	602,217,232.64	3.55
5	688008	澜起科技	10,246,324	583,758,810.48	3.44
6	601138	工业富联	23,735,073	573,199,839.60	3.38
7	600690	海尔智家	24,322,028	571,081,217.44	3.37
8	000063	中兴通讯	12,500,369	569,266,804.26	3.36
9	00291	华润啤酒	10,629,520	505,690,570.24	2.98
10	02269	药明生物	13,872,500	480,270,791.50	2.83
11	01347	华虹半导体	19,818,335	467,765,977.68	2.76



12	600873	梅花生物	47,727,936	426,210,468.48	2.51
13	002851	麦格米特	11,185,201	407,924,280.47	2.40
14	06078	海吉亚医疗	10,307,000	402,920,749.26	2.37
15	300750	宁德时代	1,688,405	386,290,179.95	2.28
16	002120	韵达股份	38,426,332	367,355,733.92	2.17
17	603707	健友股份	26,830,767	362,215,354.50	2.14
18	300454	深信服	2,836,891	321,277,905.75	1.89
19	300832	新产业	5,014,129	295,833,611.00	1.74
20	603195	公牛集团	3,057,774	293,729,770.44	1.73
21	02382	舜宇光学科技	3,989,102	287,425,717.27	1.69
22	000739	普洛药业	15,747,273	279,356,623.02	1.65
23	06049	保利物业	7,573,600	264,993,758.28	1.56
24	09992	泡泡玛特	15,748,400	252,933,345.27	1.49
25	002371	北方华创	724,098	230,009,729.70	1.36
26	688617	惠泰医疗	613,458	219,813,984.40	1.30
27	688200	华峰测控	1,378,454	210,903,462.00	1.24
28	600309	万华化学	2,319,807	203,771,846.88	1.20
29	600160	巨化股份	14,712,560	202,739,076.80	1.20
30	600584	长电科技	6,460,100	201,361,317.00	1.19
31	06699	时代天使	2,680,200	180,513,182.65	1.06
32	600031	三一重工	10,128,000	168,428,640.00	0.99
33	603658	安图生物	3,238,514	167,528,329.22	0.99
34	002250	联化科技	14,899,042	155,843,979.32	0.92
35	300769	德方纳米	1,395,592	153,836,106.16	0.91
36	603816	顾家家居	4,012,702	153,084,581.30	0.90
37	002465	海格通信	13,575,822	140,373,999.48	0.83
38	603713	密尔克卫	1,522,592	135,647,721.28	0.80
39	000938	紫光股份	4,118,104	131,161,612.40	0.77
40	300413	芒果超媒	3,607,726	123,420,306.46	0.73
41	02171	科济药业-B	12,267,500	109,597,675.71	0.65
42	601717	郑煤机	8,784,604	109,368,319.80	0.64
43	603507	振江股份	3,014,586	109,308,888.36	0.64
44	01415	高伟电子	8,086,000	107,950,286.45	0.64
45	002027	分众传媒	15,417,567	104,993,631.27	0.62
46	688083	中望软件	705,678	102,245,685.42	0.60
47	02400	心动公司	4,673,200	84,879,359.64	0.50
48	600549	厦门钨业	4,130,000	76,694,100.00	0.45
49	300559	佳发教育	4,640,889	76,574,668.50	0.45
50	603283	赛腾股份	1,501,889	66,834,060.50	0.39
51	603712	七一二	1,824,900	55,130,229.00	0.32
52	688114	华大智造	498,883	43,183,312.48	0.25
53	601899	紫金矿业	3,400,000	38,658,000.00	0.23
54	002920	德赛西威	239,960	37,388,167.60	0.22

55	300762	上海瀚讯	3,127,016	36,804,978.32	0.22
56	002311	海大集团	712,580	33,377,247.20	0.20
57	000683	远兴能源	4,608,100	33,132,239.00	0.20
58	688798	艾为电子	519,354	30,719,789.10	0.18
59	601966	玲珑轮胎	1,326,000	29,463,720.00	0.17
60	688690	纳微科技	753,203	29,261,936.55	0.17
61	688766	普冉股份	255,400	27,281,828.00	0.16
62	605090	九丰能源	1,204,197	26,889,719.01	0.16
63	688111	金山办公	54,861	25,906,461.42	0.15
64	600161	天坛生物	918,940	24,949,221.00	0.15
65	002415	海康威视	640,000	21,190,400.00	0.12
66	002980	华盛昌	630,000	19,971,000.00	0.12
67	300188	美亚柏科	1,070,000	19,966,200.00	0.12
68	002812	恩捷股份	200,000	19,270,000.00	0.11
69	002179	中航光电	389,938	17,683,688.30	0.10
70	603338	浙江鼎力	267,156	14,963,407.56	0.09
71	600435	北方导航	1,276,993	14,672,649.57	0.09
72	688772	珠海冠宇	693,405	13,972,110.75	0.08
73	603501	韦尔股份	134,935	13,229,027.40	0.08
74	601111	中国国航	1,336,600	11,013,584.00	0.06
75	600938	中国海油	599,989	10,871,800.68	0.06
76	688661	和林微纳	150,346	10,569,323.80	0.06
77	601633	长城汽车	400,000	10,068,000.00	0.06
78	002236	大华股份	500,000	9,875,000.00	0.06
79	300592	华凯易佰	356,600	9,706,652.00	0.06
80	300170	汉得信息	700,000	8,078,000.00	0.05
81	002353	杰瑞股份	300,000	7,539,000.00	0.04
82	603997	继峰股份	450,000	6,435,000.00	0.04
83	000568	泸州老窖	29,952	6,277,040.64	0.04
84	601133	柏诚股份	400,664	5,972,140.64	0.04
85	002637	赞宇科技	400,000	4,124,000.00	0.02
86	605020	永和股份	110,320	2,847,359.20	0.02
87	09995	荣昌生物	60,500	1,910,457.81	0.01
88	300123	亚光科技	243,200	1,770,496.00	0.01
89	688249	晶合集成	74,041	1,391,155.62	0.01
90	605376	博迁新材	35,500	1,113,990.00	0.01
91	688570	天玛智控	8,837	234,259.64	0.00
92	688199	久日新材	4,494	134,011.08	0.00
93	688058	宝兰德	2,030	115,689.70	0.00
94	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.00
95	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.00
96	301260	格力博	3,121	73,749.23	0.00
97	603899	晨光股份	1,500	66,960.00	0.00

98	001269	欧晶科技	764	56,176.92	0.00
99	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
100	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
101	688484	南芯科技	1,008	37,003.68	0.00
102	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
103	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
104	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
105	301391	卡莱特	247	28,940.99	0.00
106	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00
107	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
108	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
109	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
110	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
111	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
112	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
113	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
114	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
115	301387	光大同创	307	13,925.52	0.00
116	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
117	01801	信达生物	500	13,645.30	0.00
118	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
119	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
120	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
121	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
122	301265	华新环保	819	9,516.78	0.00
123	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
124	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
125	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
126	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
127	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
128	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
129	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
130	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
131	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
132	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
133	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
134	603172	万丰股份	122	1,967.86	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。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
----	------	------	----------	-----------------

	码			
1	601138	工业富联	751,870,768.89	3.93
2	00700	腾讯控股	710,535,052.13	3.72
3	688008	澜起科技	697,430,863.50	3.65
4	000063	中兴通讯	471,859,744.91	2.47
5	01024	快手-W	434,493,656.18	2.27
6	300750	宁德时代	406,765,523.96	2.13
7	02269	药明生物	402,432,026.79	2.11
8	300832	新产业	285,423,792.07	1.49
9	600160	巨化股份	279,619,149.49	1.46
10	300308	中际旭创	275,955,794.60	1.44
11	600703	三安光电	254,817,723.27	1.33
12	600031	三一重工	244,553,235.35	1.28
13	603658	安图生物	228,040,556.33	1.19
14	688617	惠泰医疗	223,868,781.49	1.17
15	300769	德方纳米	204,844,455.01	1.07
16	600584	长电科技	184,963,073.70	0.97
17	688099	晶晨股份	172,516,911.41	0.90
18	002465	海格通信	140,415,899.50	0.73
19	300413	芒果超媒	138,527,291.81	0.72
20	01415	高伟电子	127,081,792.92	0.66

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	01024	快手-W	736,390,472.01	3.85
2	300413	芒果超媒	623,923,019.61	3.26
3	002938	鹏鼎控股	555,687,790.75	2.91
4	00700	腾讯控股	509,968,167.48	2.67
5	300308	中际旭创	475,434,512.19	2.49
6	00291	华润啤酒	466,590,496.29	2.44
7	601138	工业富联	457,402,743.60	2.39
8	02382	舜宇光学科技	413,794,982.31	2.17
9	600690	海尔智家	355,421,518.84	1.86
10	00780	同程旅行	310,788,638.34	1.63
11	688303	大全能源	294,020,474.85	1.54
12	01801	信达生物	266,924,824.86	1.40
13	603259	药明康德	259,743,662.98	1.36
14	600745	闻泰科技	248,539,256.38	1.30
15	600426	华鲁恒升	238,977,399.14	1.25
16	01347	华虹半导体	227,296,338.50	1.19

17	00168	青岛啤酒股份	214,612,688.11	1.12
18	600309	万华化学	206,908,268.58	1.08
19	002318	久立特材	201,309,219.38	1.05
20	603899	晨光股份	198,928,254.44	1.04

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	9,063,565,444.92
卖出股票收入（成交）总额	10,009,095,834.51

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	77,854,425.76	0.46
2	央行票据	-	-
3	金融债券	604,867,163.42	3.57
	其中：政策性金融债	604,867,163.42	3.57
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）	80,140,903.88	0.47
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	762,862,493.06	4.50

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	220306	22 进出 06	2,600,000	263,968,810.96	1.56
2	230206	23 国开 06	2,500,000	250,645,491.80	1.48
3	230406	23 农发 06	900,000	90,252,860.66	0.53
4	019694	23 国债 01	770,000	77,854,425.76	0.46
5	127074	麦米转 2	264,653	36,572,825.87	0.22

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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。

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

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。

### 7.11.2 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。

## 7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，并且未在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,498,172.65
2	应收清算款	7,775,813.06
3	应收股利	6,940,974.27
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,511,324.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	19,726,284.72
---	----	---------------

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	127074	麦米转 2	36,572,825.87	0.22
2	110081	闻泰转债	16,660,903.87	0.10
3	113658	密卫转债	6,494,169.52	0.04

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601138	工业富联	228,336,000.00	1.35	大宗交易购入流通受限
2	688099	晶晨股份	121,892,400.00	0.72	大宗交易购入流通受限
3	688008	澜起科技	80,307,829.92	0.47	大宗交易购入流通受限

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
兴全合宜混合 A	570,168	19,383.16	979,017,659.58	8.86	10,072,639,361.79	91.14
兴全合宜混合 C	132,187	5,740.48	2,436,520.29	0.32	756,379,970.24	99.68
合计	702,355	16,815.53	981,454,179.87	8.31	10,829,019,332.03	91.69

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

## 8.2 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	中荷人寿保险有限公司	32,299,828.00	1.10
2	兴业证券股份有限公司	31,365,468.00	1.07
3	金圆资本管理(厦门)有限公司	26,205,173.00	0.89
4	国信证券股份有限公司	23,900,960.00	0.82
5	蒋剑松	16,244,957.00	0.55
6	浙商证券股份有限公司	16,085,719.00	0.55
7	江泉	14,234,861.00	0.49
8	邹积庆	13,587,900.00	0.46
9	李仁杰	9,466,600.00	0.32
10	章蔚强	9,349,136.00	0.32

注：持有人为 LOF 基金场内持有人。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	兴全合宜混合 A	44,685,216.10	0.4043
	兴全合宜混合 C	1,350,780.70	0.1780
	合计	46,035,996.80	0.3898

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

## 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	兴全合宜混合 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：本基金的基金经理之一也是本公司投资部门、研究部门负责人，故上述两点统计数据有重合部分。



## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	兴全合宜混合 A	兴全合宜混合 C
基金合同生效日 (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	11,756,817,375.17	793,132,002.98
本报告期基金总申 购份额	374,112,760.49	108,098,059.53
减：本报告期基金 总赎回份额	1,079,273,114.29	142,413,571.98
本报告期基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金 份额总额	11,051,657,021.37	758,816,490.53

注：总申购份额含红利再投资、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

## 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 报告期内基金管理人无重大人事变动。

(2) 报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

## 10.6.1 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，本基金管理人及其高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

## 10.6.2 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。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
天风证券	2	5,322,501,141.73	27.92	3,509,712.61	27.23	-
广发证券	4	2,063,203,571.29	10.82	1,434,970.45	11.13	-
长江证券	2	1,780,713,413.99	9.34	1,127,125.36	8.74	-
兴业证券	3	1,712,690,181.16	8.98	1,625,999.83	12.61	-
中金公司	2	1,488,774,920.60	7.81	979,794.51	7.60	-
东方财富证券	2	1,477,418,571.60	7.75	653,553.04	5.07	-
国金证券	2	1,208,783,500.10	6.34	767,746.79	5.96	-
东吴证券	2	1,058,946,295.87	5.56	692,498.21	5.37	-
国盛证券	2	796,741,820.37	4.18	531,153.30	4.12	-
中信证券	5	741,767,453.50	3.89	543,225.67	4.21	-
国信证券	2	314,325,505.90	1.65	241,766.37	1.88	-
华创证券	1	277,175,916.09	1.45	202,696.56	1.57	-
中信建投证券	5	273,630,917.64	1.44	172,739.15	1.34	-
民生证券	1	216,628,481.40	1.14	159,581.77	1.24	-
招商证券	2	202,672,295.34	1.06	159,258.93	1.24	-
中泰证券	2	65,296,217.82	0.34	41,218.70	0.32	-
国泰君安	2	61,127,150.	0.32	46,947.64	0.36	-

		40				
安信证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
摩根大通 证券	2	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	2	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
天风证券	19,930,049.00	17.76	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	1,152,725.68	1.03	-	-	-	-
东方财	-	-	-	-	-	-

富证券						
国金证 券	48,454,155 .00	43.19	-	-	-	-
东吴证 券	8,595,098. 00	7.66	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券	15,013,462 .98	13.38	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	19,054,877 .08	16.98	-	-	-	-
安信证 券	-	-	-	-	-	-
渤海证 券	-	-	-	-	-	-
德邦证 券	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
国都证 券	-	-	-	-	-	-
华福证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
摩根大 通证券	-	-	-	-	-	-
南京证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏	-	-	-	-	-	-

源证券						
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	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	兴证全球基金管理有限公司关于旗下部分基金 2023 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、规定互联网站	2023-01-10
2	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、规定互联网站	2023-01-17
3	关于兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理变更公告	上海证券报、规定互联网站	2023-01-30
4	兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 更新招募说明书 (20230201 更新)	上海证券报、规定互联网站	2023-02-01
5	兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) (兴全合宜混合 A 类份额) 基金产品资料概要更新	上海证券报、规定互联网站	2023-02-01
6	兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) (兴全合宜混合 C 类份额) 基金产品资料概要更新	上海证券报、规定互联网站	2023-02-01
7	关于增加广发银行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、规定互联网站	2023-02-28
8	关于更新旗下部分基金 2023 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、规定互联网站	2023-03-02
9	关于增加上海华夏财富投资管理有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报、规定互联网站	2023-03-23
10	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、规定互联网站	2023-04-04

11	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报、规定互联网站	2023-04-27
12	关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	上海证券报、规定互联网站	2023-05-05
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)、赎回、转换业务的公告	上海证券报、规定互联网站	2023-05-24
14	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报、规定互联网站	2023-06-14
15	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报、规定互联网站	2023-06-30

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

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

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

2、“赎回份额”包含份额赎回、转换转出等导致投资者持有份额减少的情形。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、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。

2、根据本基金的基金管理人于 2023 年 7 月 8 日发布的《关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，本基金自 2023 年 7 月 10 日起将基金管理费年费率调整为 1.2%，托管费年费率调整为 0.2%。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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

## 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

## 12.3 查阅方式

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

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

兴证全球基金管理有限公司

2023 年 8 月 31 日