兴全沪港深两年持有期混合型证券投资基金
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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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

§1 重要提示及目录 2

1.1 重要提示 2
1.2 目录 3

§2 基金简介 5

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 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6

§3 主要财务指标和基金净值表现 6

3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 6
3.3 其他指标 8

§4 管理人报告 8

4.1 基金管理人及基金经理情况 8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 9
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 10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 11
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 11

§5 托管人报告 11

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 11
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 11
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 12

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 12

6.1 资产负债表 12
6.2 利润表 13
6.3 净资产（基金净值）变动表 14
6.4 报表附注 17

§7 投资组合报告 47

7.1 期末基金资产组合情况 47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 47
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 48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 53
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 54
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 54

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 54
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 54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 54
7.12 投资组合报告附注 54

§8 基金份额持有人信息 55

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 55

§9 开放式基金份额变动 56

§10 重大事件揭示 56

10.1 基金份额持有人大会决议 56
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 56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 56
10.4 基金投资策略的改变 56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 56
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 56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 57
10.8 其他重大事件 59

§11 影响投资者决策的其他重要信息 59

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 59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 60

§12 备查文件目录 60

12.1 备查文件目录 60
12.2 存放地点 60
12.3 查阅方式 60

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴全沪港深两年持有期混合型证券投资基金
基金简称	兴全沪港深两年持有混合
基金主代码	009007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 5 月 22 日
基金管理人	兴证全球基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,279,585,631.65 份
基金合同存续期	不定期

注：本基金每份基金份额最短持有期为 2 年。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对沪深港三地证券市场内资本动向的追踪研究，在有效控制投资组合风险的前提下，力求实现资产净值的长期稳健增值。
投资策略	本基金的投资策略可以细分为资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略以及其他品种的投资策略等。详见基金合同及招募说明书等法律文件。
业绩比较基准	恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×80%+沪深 300 指数收益率×10%+中债综合（全价）指数收益率×10%
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。 本基金投资于港股通标的股票，需面临汇率风险、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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		兴证全球基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨卫东	王小飞
	联系电话	021-20398888	021-60637103
	电子邮箱	yangwd@xqfunds.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		4006780099，021-38824536	021-60637228
传真		021-20398988	021-60635778
注册地址		上海市黄浦区金陵东路 368 号	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		上海市浦东新区芳甸路 1155 号嘉里城办公楼 28-29 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		201204	100033
法定代表人		杨华辉	田国立

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	兴证全球基金管理有限公司	上海市浦东新区芳甸路 1155 号浦东嘉里城办公楼 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)
本期已实现收益	-202,864,834.06
本期利润	-151,816,885.70
加权平均基金份额本期利润	-0.0640
本期加权平均净值利润率	-8.96%
本期基金份额净值增长率	-8.91%
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	-761,530,562.47
期末可供分配基金份额利润	-0.3341
期末基金资产净值	1,518,055,069.18
期末基金份额净值	0.6659
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	-33.41%

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

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

	率①	准差②	率③	④		
过去一个月	5.00%	1.51%	4.80%	1.17%	0.20%	0.34%
过去三个月	-7.97%	1.28%	-2.25%	1.02%	-5.72%	0.26%
过去六个月	-8.91%	1.37%	-0.86%	1.12%	-8.05%	0.25%
过去一年	-21.56%	1.74%	-6.36%	1.38%	-15.20%	0.36%
过去三年	-34.32%	1.59%	-17.38%	1.29%	-16.94%	0.30%
自基金合同生效起至今	-33.41%	1.56%	-16.60%	1.30%	-16.81%	0.26%

注：本基金业绩比较基准为：恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×80%+沪深 300 指数收益率×10%+中债综合（全价）指数收益率×10%。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，按下列公式计算：

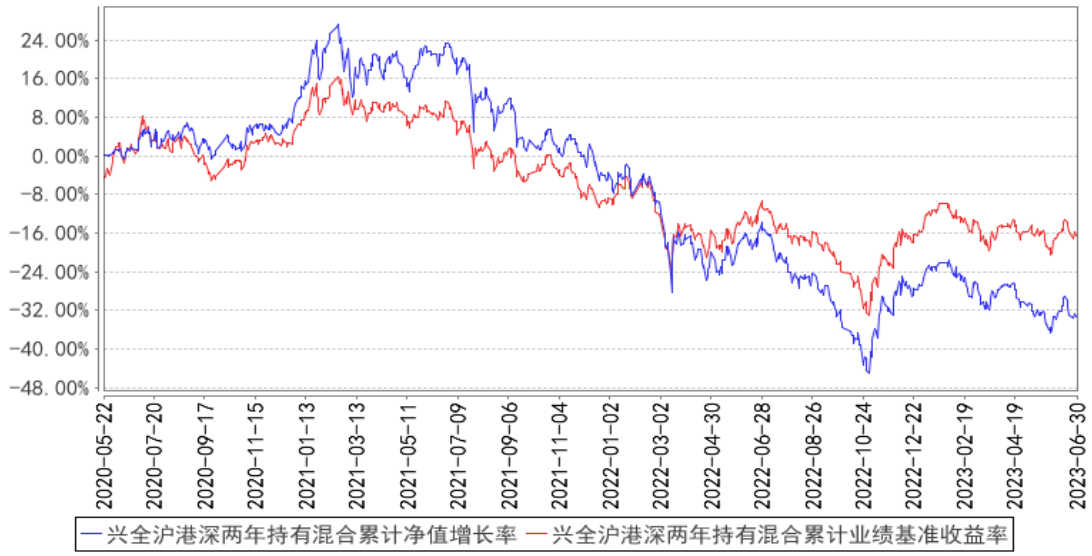
Return t =80%×（恒生指数收益率（使用估值汇率折算） t / 恒生指数收益率（使用估值汇率折算） t-1 -1） +10%×（沪深 300 指数收益率 t / 沪深 300 指数收益率 t-1 -1）+10%×（中债综合（全价）指数收益率 t / 中债综合（全价）指数收益率 t-1 -1）

Benchmark t =（1+Return t）×（1+Benchmark t-1）-1

其中，t=1，2，3，…T，T 表示时间截至日。

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

兴全沪港深两年持有混合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 6 月 30 日。

2、按照《兴全沪港深两年持有期混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金建仓期为 2020 年 5 月 22 日至 2020 年 11 月 21 日。建仓期结束时，本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制和投资组合的比例范围。

3.3 其他指标

注：无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 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		
林翠萍	兴证全球基金管理有限公司国际业务部总监助理、兴全沪港深两年持有期混合型证	2020 年 5 月 22 日	-	28 年	硕士。历任中华经济研究院研究助理，京华(元大)证券股份有限公司研究员、自营部交易员，保诚(瀚亚)证券投资信托股份有限公司基金经理，富鼎(中国信托)证券投资信托股份有限公司投研处协理，联邦证券投资信托股份有限公司基金经理，华南永昌证券投资信托股份有限公司研究经理，金鼎(联博)证券投资信托股份有限公司基金经理，华顿证券投资信托股份有

	券投资基金基金经理				限公司资深经理，未来资产证券投资信托股份有限公司资深副总经理。中海基金管理有限公司基金经理。2016 年 4 月至 2019 年 5 月担任中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018 年 3 月至 2019 年 5 月担任中海沪港深多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
陈聪	兴全沪港深两年持有期混合型证券投资基金基金经理	2022 年 11 月 16 日	-	7 年	硕士。历任美国银行美林证券(Bank of America Merill Lynch) 全球投资组合策略部 策略研究员、衍生品部 量化研究员，埃信华迈 (IHS Markit) 衍生品部产品经理，兴证全球基金管理有限公司研究员、兴全沪港深两年持有期混合型证券投资基金基金经理助理。
程奎皓	本基金的基金助理	2021 年 2 月 10 日	-	13 年	硕士。历任麦格理证券（Macquarie Securities）分析师，国泰证券投资信托研究员，国开泰富基金专户投资经理，平安资产管理研究员、兴证全球基金管理有限公司研究员。现任兴全沪港深两年持有期混合型证券投资基金基金经理助理（2021 年 2 月 10 日起至今）。

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

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

3、证券从业的涵义遵从行业的相关规定，包括资管相关行业从业经历。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本报告期末，本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划的投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全沪港深两年持有期混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人制定了《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 异常交易行为的专项说明

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

4.4 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

我们今年初在《2022 年回顾与展望》中提到：“中国疫情快速达峰，为之后的经济增长铺平了道路，市场信心恢复，港股的风险偏好也显著改善…”。一季度继续演绎这个向好逻辑，但二季度经济数据开始转弱，复苏逻辑受到挑战。

恒生指数上半年下跌 4.37%，打破了年初许多投资者对今年港股反弹的预期，我们认为主要原因有两个，第一是中美关系方向不明确，外资撤出港股;第二是前面提到的存量财富受损与政策定力；整体来看，流动性与基本面都缺乏支撑，导致市场在年初反弹后又重新下跌。

我们判断经济复苏的基调将持续，加大消费、互联网、医药行业的配置，我们相信便宜的好公司终将获得资金的青睐；虽然香港股市的波动依然较大，但这也是择优入市的机会。我们维持逢低买入优质企业及具结构性投资机会公司的策略；同时，增加交易性投资，适时波段操作，期待碎步修复净值。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.6659 元；本报告期基金份额净值增长率为-8.91%，业绩比较基准收益率为-0.86%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为不利的因素正在淡化，首先中美关系在高级官员参访下继续保持沟通，往改善的方向发展，再者，我们认为随着经济数据的转弱，下半年托底经济的政策必定会出现。多个海外股票市场创下历史新高，我们认为港股的低估值已经充分反映绝大部分的风险，随着经济基本面触底回升，投资人风险偏好也将有所提升，我们预期港股市场下半年表现也将出现转折。

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》、《兴全沪港深两年持有期混合型证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，本报告期内，本基金未实施利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：兴全沪港深两年持有期混合型证券投资基金

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	174,678,274.19	131,404,048.70
结算备付金		2,419,781.59	590,339.91
存出保证金		126,875.42	87,454.00
交易性金融资产	6.4.7.2	1,355,923,195.70	1,675,454,028.15
其中：股票投资		1,355,843,868.70	1,654,600,383.22
基金投资		-	-
债券投资		79,327.00	20,853,644.93
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		-	77,754.21
应收股利		4,859,395.31	289,704.45
应收申购款		30,250.56	105,997.40
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,538,037,772.77	1,808,009,326.82
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2023 年 6 月 30 日**	**上年度末 2022 年 12 月 31 日**
负 债：			

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		15,300,915.87	2,074,424.44
应付赎回款		1,511,140.12	5,046,625.51
应付管理人报酬		1,909,290.42	2,289,505.38
应付托管费		318,215.08	381,584.24
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.34	2,274.17
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	943,141.76	1,187,547.68
负债合计		19,982,703.59	10,981,961.42
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	2,279,585,631.65	2,458,211,138.53
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-761,530,562.47	-661,183,773.13
净资产合计		1,518,055,069.18	1,797,027,365.40
负债和净资产总计		1,538,037,772.77	1,808,009,326.82

注： 报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.6659 元，基金份额总额 2,279,585,631.65 份。

6.2 利润表

会计主体：兴全沪港深两年持有期混合型证券投资基金

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
一、营业总收入		-136,947,736.75	-337,174,257.47
1.利息收入		327,669.75	585,796.59
其中：存款利息收入	6.4.7.13	327,669.75	585,796.59
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）		-188,323,354.86	-362,180,102.41
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-198,765,027.47	-384,278,031.55
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	428,181.14	594,394.65
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	10,013,491.47	21,503,534.49
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	51,047,948.36	24,420,048.35
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	-	-
减：二、营业总支出		14,869,148.95	22,020,318.98
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	12,655,189.46	18,779,732.27
2．托管费	6.4.10.2.2	2,109,198.24	3,129,955.38
3．销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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		1,322.58	2,139.88
8．其他费用	6.4.7.23	103,438.67	108,491.45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-151,816,885.70	-359,194,576.45
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-151,816,885.70	-359,194,576.45
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-151,816,885.70	-359,194,576.45

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：兴全沪港深两年持有期混合型证券投资基金

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）	2,458,211,138.53	-	-661,183,773.13	1,797,027,365.40
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	2,458,211,138.53	-	-661,183,773.13	1,797,027,365.40
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-178,625,506.88	-	-100,346,789.34	-278,972,296.22
（一）、综合收益总额	-	-	-151,816,885.70	-151,816,885.70
（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）	-178,625,506.88	-	51,470,096.36	-127,155,410.52
其中：1.基金申购款	18,515,149.55	-	-5,061,780.79	13,453,368.76
2.基金赎回款	-197,140,656.43	-	56,531,877.15	-140,608,779.28
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	2,279,585,631.65	-	-761,530,562.47	1,518,055,069.18
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）	2,982,578,579.76	-	-104,331,723.17	2,878,246,856.59
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	2,982,578,579.76	-	-104,331,723.17	2,878,246,856.59
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-250,531,235.67	-	-308,400,322.20	-558,931,557.87
（一）、综合收益总额	-	-	-359,194,576.45	-359,194,576.45
（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）	-250,531,235.67	-	50,794,254.25	-199,736,981.42
其中：1.基金申购款	28,298,543.26	-	-4,421,675.17	23,876,868.09
2.基金赎回款	-278,829,778.93	-	55,215,929.42	-223,613,849.51
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	2,732,047,344.09	-	-412,732,045.37	2,319,315,298.72

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

杨华辉	庄园芳	詹鸿飞
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

兴全沪港深两年持有期混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)，经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)于 2020 年 2 月 5 日印发的证监许可[2020]222 号文的核准公开募集，由兴证全球基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法规和《兴全沪港深两年持有期混合型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2020 年 5 月 22 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为 2,870,103,924.47 份基金份额。本基金的基金管理人为兴证全球基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《兴全沪港深两年持有期混合型证券投资基金基金合同》和《兴全沪港深两年持有期混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，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（包

括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册发行的股票）、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、地方政

府债、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、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。

基金的投资组合比例为：本基金的股票资产投资比例为基金资产的 60%—95%，其中，投资于港股通标的股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；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，本基金应当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%，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：恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×80%+沪深 300　指数收益率×10%+中债综合（全价）指数收益率×10%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 6 月 30 日的财务状况、自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日期间的经营成果和净资产变动情况。

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

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

本基金本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》(财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号)、财税 [2014] 81 号文《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 [2016] 127 号文《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[2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号

文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税 (以下称营改增) 试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人 (以下称管理人) 运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2018 年 1 月 1 日 (含) 以后，管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上

述收入时代扣代缴 20%的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内 （含 1 个月） 的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年 （含 1 年） 的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20%的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，其股息红利所得暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金通过沪港通/深港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。基金通过沪港通/深港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。

(e) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。对于基金通过沪港通/深港通买卖、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。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日 （含） 以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	174,678,274.19
等于：本金	174,664,600.19
加：应计利息	13,674.00
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	174,678,274.19

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		1,551,023,230.14	-	1,355,843,868.70	-195,179,361.44
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	76,843.79	105.20	79,327.00	2,378.01
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	76,843.79	105.20	79,327.00	2,378.01
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,551,100,073.93	105.20	1,355,923,195.70	-195,176,983.43

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	858,839.20
其中：交易所市场	858,839.20
银行间市场	-
应付利息	-
预提信息披露费	59,507.37
预提审计费	24,795.19
合计	943,141.76

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,458,211,138.53	2,458,211,138.53
本期申购	18,515,149.55	18,515,149.55
本期赎回（以“-”号填列）	-197,140,656.43	-197,140,656.43
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,279,585,631.65	2,279,585,631.65

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-483,813,625.75	-177,370,147.38	-661,183,773.13
本期利润	-202,864,834.06	51,047,948.36	-151,816,885.70
本期基金份额交易产生的变动数	44,465,915.21	7,004,181.15	51,470,096.36
其中：基金申购款	-4,353,670.91	-708,109.88	-5,061,780.79
基金赎回款	48,819,586.12	7,712,291.03	56,531,877.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-642,212,544.60	-119,318,017.87	-761,530,562.47

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	242,884.14
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	82,639.68
其他	2,145.93
合计	327,669.75

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	-198,765,027.47
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	-198,765,027.47

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	1,569,456,644.00
减：卖出股票成本总额	1,762,639,968.37
减：交易费用	5,581,703.10
买卖股票差价收入	-198,765,027.47

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	367,367.41
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	60,813.73
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	428,181.14

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	20,820,800.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	19,939,183.29

减：应计利息总额	820,800.00
减：交易费用	2.98
买卖债券差价收入	60,813.73

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：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

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	10,013,491.47
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	10,013,491.47

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	51,047,948.36
股票投资	51,312,387.06
债券投资	-264,438.70
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	51,047,948.36

6.4.7.21 其他收入

注：本基金本报告期内无其他收入。

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	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	536.11
账户维护费	18,600.00
合计	103,438.67

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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

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 日起基金管理费费率自 1.50%降低至 1.20%，托管费费率自 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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	311,337,200.14	10.48	303,002,957.48	12.75

6.4.10.1.2 债券交易

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	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
兴业证券	76,915.37	100.00	-	-

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	206,932.70	10.66	191,316.22	22.28
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	211,668.40	13.49	-	-

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用兴业证券证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还从兴业证券获得证券研究综合服务。

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	12,655,189.46	18,779,732.27
其中：支付销售机构的客户维护费	5,007,429.98	7,443,512.90

注：支付基金管理人兴证全球基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

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	2,109,198.24	3,129,955.38

注：支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：本基金在本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行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：本基金在本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行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固有资金投资本基金的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末和上年度末均未持有本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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

建设银行	174,678,274.19	242,884.14	155,795,383.58	468,451.55

注：本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，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：本基金在本报告期内未进行过利润分配。

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	2023	6 个月	新	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-

	电港	年 3 月 30 日		股流通受限						
001324	长青科技	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
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	-
301157	华塑科技	2023 年 3 月 1 日	6 个月	新股流通受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301170	锡南科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301202	朗威股	2023 年 6 月 28	1 个月内（含）	新股流	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-

	份	日		通受限						
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股流通受限	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
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	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	1个月内（含）	新股流通受限	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
301292	海科新源	2023年6月29日	1个月内（含）	新股流通受限	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-
301292	海科新源	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-
301307	美利信	2023年4月14日	6个月	新股流通受	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-

				限						
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	湖南裕能	2023 年 2 月 1 日	6 个月	新股流通受限	23.77	42.89	2,023	48,086.71	86,766.47	-
301376	致欧科技	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股流通受限	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
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	2023	6 个月	新	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-

	纪恒通	年 5 月 10 日		股流通受限						
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	-
301488	豪恩汽电	2023 年 6 月 26 日	6 个月	新股流通受限	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-
301488	豪恩汽电	2023 年 6 月 26 日	1 个月内（含）	新股流通受限	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-
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	-
601133	柏诚股份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
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	2023 年 4 月 10	6 个月	新股流	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-

	能	日		通受限						
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	-
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	颀中科技	2023年4月11日	6个月	新股流通受限	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-
688361	中科飞测	2023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	-
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	新股流通受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
688433	华曙高科	2023年4月7日	6个月	新股流通受	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-

				限						
688469	中芯集成	2023 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	-
688472	阿特斯	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通受限	11.10	17.04	5,426	60,228.60	92,459.04	-
688478	晶升股份	2023 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	-
688479	友车科技	2023 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	-
688484	南芯科技	2023 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	-
688507	索辰科技	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通受限	245.56	122.11	150	36,834.00	18,316.50	-
688507	索辰科技	2023 年 6 月 20 日	4 个月	新股流通受限-转	-	122.11	72	-	8,791.92	注 1

				增						
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	-
688543	国科军工	2023年6月14日	6个月	新股流通受限	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-
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	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
688593	新	2023	6个月	新	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-

	相微	年 5 月 25 日		股流通受限						
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	新股流通受限	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月内（含）	新股流通受限	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
688623	双元科技	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新股流通受限	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
688629	华丰科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股流通受限	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-

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发行的证券，不得超过该证券的 10%。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

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

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	0.00	-
AAA 以下	79,327.00	20,853,644.93
未评级	0.00	-
合计	79,327.00	20,853,644.93

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

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

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

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

本基金所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易。因此，除在本报告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 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金为开放式基金，投资者可在合同规定的交易日进行基金申购与赎回业务，本基金管理人针对基金特定的运作方式，建立了相应的流动性风险监控与预警机制。本基金管理人每日预测基金的流动性需求，通过独立的风险管理部门设置流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，并按照基金类型建立并定期开展专项的流动性压力测试工作，对流动性风险进行预警。本基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款及强制赎回费条款，同时控制每日确认的净赎回申请不超过本基金投资组合 7 个工作日可变现资产的可变现价值，减少赎回业务对本基金的流动性冲击，从而控制流动性风险。此外，本基金通过预留一定的现金头寸，并且可在需要时通过卖出回购金融资产方式借入短期资金，以缓解流动性风险。

本基金所持的证券在证券交易所上市或可于银行间同业市场交易。截止本报告期末，单一投资者持有基金份额比例未超过基金总份额 50%。本报告期末，除完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合以外，本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的 30%，本基金投资未违背法律法规对流通受限资产的相关比例要求。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、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 2023 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	174,678,274.19	-	-	-	-	-	174,678,274.19
结算备付金	2,419,781.59	-	-	-	-	-	2,419,781.59
存出保证金	126,875.42	-	-	-	-	-	126,875.42
交易性金融资产	-	-	-	79,327.00	-	1,355,843,868.70	1,355,923,195.70
应收股利	-	-	-	-	-	4,859,395.31	4,859,395.31
应收申购款	1,697.72	-	-	-	-	28,552.84	30,250.56
资产总计	177,226,628.92	-	-	79,327.00	-	1,360,731,816.85	1,538,037,772.77
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,511,140.12	1,511,140.12
应付管	-	-	-	-	-	1,909,290.42	1,909,290.42

理人报酬							
应付托管费	-	-	-	-	-	318,215.08	318,215.08
应付清算款	-	-	-	-	-	15,300,915.87	15,300,915.87
应交税费	-	-	-	-	-	0.34	0.34
其他负债	-	-	-	-	-	943,141.76	943,141.76
负债总计	-	-	-	-	-	19,982,703.59	19,982,703.59
利率敏感度缺口	177,226,628.92	-	-	79,327.00	-	1,340,749,113.26	1,518,055,069.18
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							
银行存款	131,404,048.70	-	-	-	-	-	131,404,048.70
结算备付金	590,339.91	-	-	-	-	-	590,339.91
存出保证金	87,454.00	-	-	-	-	-	87,454.00
交易性金融资产	-	20,853,644.93	-	-	-	1,654,600,383.22	1,675,454,028.15
应收股利	-	-	-	-	-	289,704.45	289,704.45
应收申购款	25,109.07	-	-	-	-	80,888.33	105,997.40
应收清算款	-	-	-	-	-	77,754.21	77,754.21
资产总计	132,106,951.68	20,853,644.93	-	-	-	1,655,048,730.21	1,808,009,326.82
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,046,625.51	5,046,625.51
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,289,505.38	2,289,505.38

应付托管费	-	-	-	-	-	381,584.24	381,584.24
应付清算款	-	-	-	-	-	2,074,424.44	2,074,424.44
应交税费	-	-	-	-	-	2,274.17	2,274.17
其他负债	-	-	-	-	-	1,187,547.68	1,187,547.68
负债总计	-	-	-	-	-	10,981,961.42	10,981,961.42
利率敏感度缺口	132,106,951.68	20,853,644.93	-	-	-	-1,644,066,768.79	1,797,027,365.40

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)。		
	其他影响债券公允价值的变量保持不变，仅利率发生变动；		
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.市场利率下降 1%	0.00	44,003.11
	2.市场利率上升 1%	0.00	-43,812.16

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。本基金持有非记账本位币人民币计价的资产，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。

本报告期末基金各外币资产负债项目汇率风险敞口如下。本出于列报考虑，风险敞口金额以人民币列示，以资产负债表日即期汇率折算。

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	-	1,194,532,967.94	-	1,194,532,967.94
资产合计	-	1,194,532,967.94	-	1,194,532,967.94
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	-	1,194,532,967.94	-	1,194,532,967.94
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	-	1,503,564,570.71	-	1,503,564,570.71
资产合计	-	1,503,564,570.71	-	1,503,564,570.71
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	-	1,503,564,570.71	-	1,503,564,570.71

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他变量不变		
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 ）
	所有外币对人民币升值 5%	59,726,648.40	75,178,228.54
	所有外币对人民币	-59,726,648.40	-75,178,228.54

	贬值 5%		

6.4.13.4.3 其他价格风险

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	1,355,843,868.70	89.31	1,654,600,383.22	92.07
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	79,327.00	0.01	20,853,644.93	1.16
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	1,355,923,195.70	89.32	1,675,454,028.15	93.23

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 ）
	1.业绩比较基准上升 10%	161,913,071.67	242,214,865.46
	2.业绩比较基准下降 10%	-161,913,071.67	-242,214,865.46

注：本基金管理人运用 CAPM 模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的

敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

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

第二层次输入值： 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值： 相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	1,354,360,200.38	1,609,359,221.33
第二层次	448,883.70	20,853,644.93
第三层次	1,114,111.62	45,241,161.89
合计	1,355,923,195.70	1,675,454,028.15

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不会将相关股票和可转换债券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(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工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,355,843,868.70	88.15
	其中：股票	1,355,843,868.70	88.15
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	79,327.00	0.01
	其中：债券	79,327.00	0.01
	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	177,098,055.78	11.51
8	其他各项资产	5,016,521.29	0.33
9	合计	1,538,037,772.77	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 1,194,532,967.94 元，占净值比例 78.69%。

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	-	-

C	制造业	123,835,402.12	8.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	4,462,642.15	0.29
F	批发和零售业	38,587.92	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,795,230.10	0.91
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	19,143,591.00	1.26
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	161,310,900.76	10.63

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	16,870,909.78	1.11
非日常生活消费品	238,356,324.02	15.70
日常消费品	8,137,893.35	0.54
能源	11,875,157.72	0.78
金融	96,846,757.08	6.38
医疗保健	174,206,776.33	11.48
工业	94,052,086.02	6.20
信息技术	176,940,459.64	11.66
通信服务	274,127,243.81	18.06
公用事业	5,126,420.86	0.34
房地产	97,992,939.33	6.46
合计	1,194,532,967.94	78.69

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	00700	腾讯控股	465,971	142,460,646.56	9.38
2	03690	美团-W	851,342	95,995,752.34	6.32

3	01024	快手-W	1,760,196	86,904,447.96	5.72
4	01347	华虹半导体	3,247,337	76,645,882.04	5.05
5	00669	创科实业	836,206	65,647,687.45	4.32
6	00780	同程旅行	4,036,822	60,964,216.64	4.02
7	00688	中国海外发展	3,793,000	59,729,957.99	3.93
8	02269	药明生物	1,436,368	49,727,561.45	3.28
9	06078	海吉亚医疗	1,248,600	48,810,211.27	3.22
10	02318	中国平安	751,365	34,533,263.61	2.27
11	00941	中国移动	523,000	30,884,624.34	2.03
12	00285	比亚迪电子	1,407,500	30,755,178.35	2.03
13	06699	时代天使	419,343	28,243,019.01	1.86
14	00388	香港交易所	92,800	25,257,236.43	1.66
15	600031	三一重工	1,447,534	24,072,490.42	1.59
16	01928	金沙中国有限公司	923,200	22,726,290.69	1.50
17	02669	中海物业	2,966,000	21,575,936.25	1.42
18	01415	高伟电子	1,579,000	21,080,076.96	1.39
19	00763	中兴通讯	712,800	20,635,682.60	1.36
20	002027	分众传媒	2,811,100	19,143,591.00	1.26
21	02331	李宁	459,500	17,856,839.49	1.18
22	03311	中国建筑国际	2,094,000	17,240,491.25	1.14
23	002371	北方华创	54,200	17,216,630.00	1.13
24	01585	雅迪控股	996,000	16,363,964.87	1.08
25	03968	招商银行	494,500	16,230,720.32	1.07
26	01299	友邦保险	200,200	14,600,309.32	0.96
27	00020	商汤-W	7,403,000	14,128,615.14	0.93
28	01801	信达生物	474,000	12,935,748.19	0.85
29	00883	中国海洋石油	1,111,000	11,472,381.54	0.76
30	300750	宁德时代	47,520	10,872,100.80	0.72
31	02313	申洲国际	132,200	9,110,960.26	0.60
32	688686	奥普特	55,013	9,048,538.24	0.60
33	000333	美的集团	148,500	8,749,620.00	0.58
34	02018	瑞声科技	496,000	8,432,650.36	0.56
35	09987	百胜中国	20,300	8,265,071.27	0.54
36	00973	L'OCCITANE	468,500	8,137,893.35	0.54
37	603605	珀莱雅	70,301	7,901,832.40	0.52
38	00101	恒隆地产	649,000	7,240,216.74	0.48
39	01858	春立医疗	493,000	6,908,949.33	0.46
40	002223	鱼跃医疗	191,200	6,881,288.00	0.45
41	02400	心动公司	370,200	6,723,944.82	0.44
42	00123	越秀地产	749,000	6,291,029.11	0.41
43	02628	中国人寿	517,000	6,225,227.40	0.41
44	688099	晶晨股份	72,921	6,148,698.72	0.41
45	688031	星环科技	45,726	6,092,532.24	0.40

46	02282	美高梅中国	722,400	6,087,590.54	0.40
47	688008	澜起科技	104,516	6,001,308.72	0.40
48	002384	东山精密	225,100	5,830,090.00	0.38
49	300896	爱美客	13,000	5,784,350.00	0.38
50	01789	爱康医疗	896,000	5,617,439.74	0.37
51	00570	中国中药	1,638,000	5,512,241.83	0.36
52	00916	龙源电力	689,000	5,126,420.86	0.34
53	02096	先声药业	701,000	5,015,349.92	0.33
54	601799	星宇股份	40,500	5,005,800.00	0.33
55	02899	紫金矿业	458,000	4,856,068.66	0.32
56	600703	三安光电	277,200	4,778,928.00	0.31
57	03323	中国建材	1,052,000	4,675,028.67	0.31
58	03888	金山软件	160,800	4,573,647.75	0.30
59	02171	科济药业-B	509,300	4,550,079.17	0.30
60	601133	柏诚股份	299,264	4,460,266.64	0.29
61	02273	固生堂	97,000	4,444,773.38	0.29
62	688328	深科达	121,818	4,078,466.64	0.27
63	01818	招金矿业	437,000	3,940,413.44	0.26
64	01896	猫眼娱乐	565,600	3,738,953.44	0.25
65	00772	阅文集团	112,400	3,414,626.69	0.22
66	01378	中国宏桥	579,727	3,399,399.01	0.22
67	00019	太古股份公司 A	57,000	3,155,799.24	0.21
68	002415	海康威视	82,900	2,744,819.00	0.18
69	688390	固德威	15,775	2,632,216.50	0.17
70	00564	郑煤机	390,400	2,458,396.98	0.16
71	01800	中国交通建设	611,000	2,411,051.46	0.16
72	01186	中国铁建	445,500	2,365,874.44	0.16
73	03808	中国重汽	142,500	1,999,636.32	0.13
74	002555	三七互娱	39,600	1,381,248.00	0.09
75	06826	昊海生物科技	46,300	1,366,005.57	0.09
76	01138	中远海能	150,000	1,087,014.42	0.07
77	02252	微创机器人-B	48,000	1,075,397.47	0.07
78	01910	新秀丽	48,300	984,149.11	0.06
79	06610	飞天云动	436,000	687,391.41	0.05
80	02338	潍柴动力	41,000	433,957.55	0.03
81	00558	力劲科技	62,500	407,976.15	0.03
82	02883	中海油田服务	54,000	402,776.18	0.03
83	688582	芯动联科	6,476	299,402.44	0.02
84	688496	清越科技	12,000	238,560.00	0.02
85	688629	华丰科技	7,073	160,957.02	0.01
86	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.01
87	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.01
88	688631	莱斯信息	3,357	108,400.08	0.01

89	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.01
90	688429	时创能源	3,452	98,752.08	0.01
91	688472	阿特斯	5,426	92,459.04	0.01
92	301170	锡南科技	2,496	92,283.70	0.01
93	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.01
94	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
95	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
96	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.00
97	301260	格力博	3,121	73,749.23	0.00
98	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	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	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
104	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00
105	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
106	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
107	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
108	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
109	688543	国科军工	410	21,750.50	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	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
114	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
115	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
116	301387	光大同创	307	13,925.52	0.00
117	688512	慧智微	721	13,814.36	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	301376	致欧科技	420	9,454.20	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
135	06690	海尔智家	60	1,363.61	0.00
136	03800	协鑫科技	800	1,335.03	0.00
137	06110	滔搏	20	125.20	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(%)
1	03690	美团-W	62,547,254.93	3.48
2	00780	同程旅行	50,778,796.30	2.83
3	01024	快手-W	48,428,671.85	2.69
4	06699	时代天使	47,480,409.86	2.64
5	02269	药明生物	39,155,617.75	2.18
6	00669	创科实业	32,668,981.77	1.82
7	02096	先声药业	31,277,865.49	1.74
8	00941	中国移动	29,042,343.67	1.62
9	01928	金沙中国有限公司	28,390,233.94	1.58
10	00992	联想集团	27,668,121.27	1.54
11	03888	金山软件	26,561,308.03	1.48
12	600031	三一重工	26,543,066.22	1.48
13	01415	高伟电子	24,030,359.78	1.34
14	00020	商汤-W	23,864,490.55	1.33
15	601888	中国中免	23,775,990.00	1.32
16	01801	信达生物	22,236,940.43	1.24
17	002027	分众传媒	19,993,423.00	1.11
18	601138	工业富联	19,986,268.00	1.11
19	02331	李宁	19,071,916.60	1.06
20	02500	启明医疗-B	18,540,441.36	1.03

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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	02382	舜宇光学科技	54,117,748.07	3.01
2	02202	万科企业	35,511,903.83	1.98

2	000002	万科 A	9,460,559.00	0.53
3	00388	香港交易所	44,574,477.83	2.48
4	01299	友邦保险	42,281,869.38	2.35
5	01880	中国中免	21,475,338.92	1.20
5	601888	中国中免	19,148,611.00	1.07
6	00700	腾讯控股	39,142,122.96	2.18
7	600745	闻泰科技	39,000,990.95	2.17
8	01347	华虹半导体	38,628,153.44	2.15
9	03998	波司登	38,233,307.45	2.13
10	03868	信义能源	32,398,420.25	1.80
11	01211	比亚迪股份	31,976,131.74	1.78
12	01928	金沙中国有限公司	31,373,268.02	1.75
13	01093	石药集团	30,066,614.70	1.67
14	00992	联想集团	29,620,430.82	1.65
15	002475	立讯精密	28,697,945.86	1.60
16	06098	碧桂园服务	27,693,696.78	1.54
17	688303	大全能源	27,692,023.23	1.54
18	00669	创科实业	26,521,080.95	1.48
19	02359	药明康德	26,492,998.52	1.47
20	688008	澜起科技	26,467,373.41	1.47

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	1,412,571,066.79
卖出股票收入（成交）总额	1,569,456,644.00

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	79,327.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	79,327.00	0.01

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	110081	闻泰转债	710	79,327.00	0.01

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。

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未超出基金合同规定的备选股票库。

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	126,875.42
2	应收清算款	-
3	应收股利	4,859,395.31
4	应收利息	-
5	应收申购款	30,250.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,016,521.29

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	110081	闻泰转债	79,327.00	0.01

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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（%）
52,639	43,306.02	18,132,623.61	0.80	2,261,453,008.04	99.20

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	3,570,702.68	0.1566

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020 年 5 月 22 日）基金份额总额	2,870,103,924.47
本报告期期初基金份额总额	2,458,211,138.53
本报告期基金总申购份额	18,515,149.55
减：本报告期基金总赎回份额	197,140,656.43
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,279,585,631.65

注：申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换转出份额。

§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，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	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(%)	
中信建投证券	2	1,334,631,510.87	44.94	921,691.24	47.47	-
东方财富证券	2	522,844,620.52	17.61	256,513.01	13.21	-
兴业证券	3	311,337,200.14	10.48	206,932.70	10.66	-
国都证券	2	287,665,436.55	9.69	196,249.06	10.11	-
中金公司	1	145,336,800.54	4.89	98,555.80	5.08	-
东方证券	1	102,210,710.39	3.44	70,114.14	3.61	-
东北证券	1	67,592,946.65	2.28	42,670.96	2.20	-
海通证券	1	64,507,238.87	2.17	40,723.45	2.10	-
国泰君安	1	39,347,098.32	1.32	36,643.20	1.89	-
华鑫证券	1	38,689,781.27	1.30	24,423.97	1.26	-
长江证券	1	28,613,244.90	0.96	26,645.46	1.37	-
华泰证券	2	15,996,710.00	0.54	10,098.79	0.52	-
申万宏源证券	2	11,021,521.38	0.37	10,264.73	0.53	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-

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(%)
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	76,915.37	100.00	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-

西部证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

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、规定互联网网站	2023 年 1 月 10 日
2	关于兴全沪港深两年持有期混合型证券投资基金暂停申购（含定投）、赎回、转换业务的公告	上海证券报、规定互联网网站	2023 年 1 月 17 日
3	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、规定互联网网站	2023 年 3 月 2 日
4	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、规定互联网网站	2023 年 3 月 23 日
5	关于兴全沪港深两年持有期混合型证券投资基金暂停申购（含定投）、赎回、转换业务的公告	上海证券报、规定互联网网站	2023 年 4 月 4 日
6	关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	上海证券报、规定互联网网站	2023 年 5 月 5 日
7	关于兴全沪港深两年持有期混合型证券投资基金暂停申购（含定投）、赎回、转换业务的公告	上海证券报、规定互联网网站	2023 年 5 月 24 日
8	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	2023 年 6 月 14 日

§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。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

1.本基金每份基金份额的最短持有期限为 2 年。

2.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 日起基金管理费费率自 1.50%降低至 1.20%，托管费费率自 0.25%降低至 0.20%。

§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沪港深两年持有期混合型证券投资基金募集注册的文件；

2.《兴全沪港深两年持有期混合型证券投资基金基金合同》；

3.《兴全沪港深两年持有期混合型证券投资基金托管协议》；

4.关于申请募集注册兴全沪港深两年持有期混合型证券投资基金的法律意见书；

5.基金管理人业务资格批件和营业执照；

6.基金托管人业务资格批件和营业执照；

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