

兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 2021 年中期报告

2021 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：2021 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 2021 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 2021 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	6
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	7
3.3 其他指标	10
§ 4 管理人报告	10
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
§ 5 托管人报告	14
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
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	52
7.1 期末基金资产组合情况	52
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	52
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	53
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	59
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	59

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	59
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	59
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
7.12 投资组合报告附注	60
§ 8 基金份额持有人信息	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
8.2 期末上市基金前十名持有人	62
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	63
§ 9 开放式基金份额变动	63
§ 10 重大事件揭示	64
10.1 基金份额持有人大会决议	64
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
10.4 基金投资策略的改变	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
10.8 其他重大事件	67
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	68
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	68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	68
§ 12 备查文件目录	69
12.1 备查文件目录	69
12.2 存放地点	69
12.3 查阅方式	69

§ 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	契约型开放式	
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	17,329,533,242.37 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
下属分级基金的交易代码	163417	005491
报告期末下属分级基金的份额总额	16,243,814,867.52 份	1,085,718,374.85 份

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 $\times$ 60% + 恒生指数收益率 $\times$ 20% + 中国债券总指数收益率 $\times$ 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	张燕
	联系电话	021-20398888	0755-83199084
	电子邮箱	yangwd@xqfunds.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4006780099, 021-38824536	95555
传真		021-20398858	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 28-30 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(2021 年 1 月 1 日-2021 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	4,362,517,513.57	227,455,779.16
本期利润	1,773,771,205.04	53,046,721.12
加权平均基金份额本期利润	0.1113	0.0566
本期加权平均净值利润率	5.43%	2.78%
本期基金份额净值增长率	6.26%	5.94%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	15,032,227,441.50	986,621,093.75
期末可供分配基金份额利润	0.9254	0.9087
期末基金资产净值	33,782,033,689.93	2,240,305,686.13
期末基金份额净值	2.0797	2.0634
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	107.97%	69.91%

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）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴全合宜混合 A

阶段	份额净	份额净值	业绩比较	业绩比较基准	①—③	②—④
----	-----	------	------	--------	-----	-----

	值增长 率①	增长率标 准差②	基准收益 率③	收益率标准差 ④		
过去一个月	-0.70%	0.66%	-1.45%	0.59%	0.75%	0.07%
过去三个月	3.39%	0.85%	2.56%	0.71%	0.83%	0.14%
过去六个月	6.26%	1.20%	1.59%	0.96%	4.67%	0.24%
过去一年	46.05%	1.35%	18.89%	0.95%	27.16%	0.40%
过去三年	124.91%	1.21%	29.97%	1.00%	94.94%	0.21%
自基金合同生效 起至今	107.97%	1.16%	12.91%	0.99%	95.06%	0.17%

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	-0.75%	0.66%	-1.45%	0.59%	0.70%	0.07%
过去三个月	3.23%	0.85%	2.56%	0.71%	0.67%	0.14%
过去六个月	5.94%	1.20%	1.59%	0.96%	4.35%	0.24%
过去一年	45.19%	1.35%	18.89%	0.95%	26.30%	0.40%
自基金合同生效 起至今	69.91%	1.4190%	19.11%	1.00%	50.80%	0.42%

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：

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

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

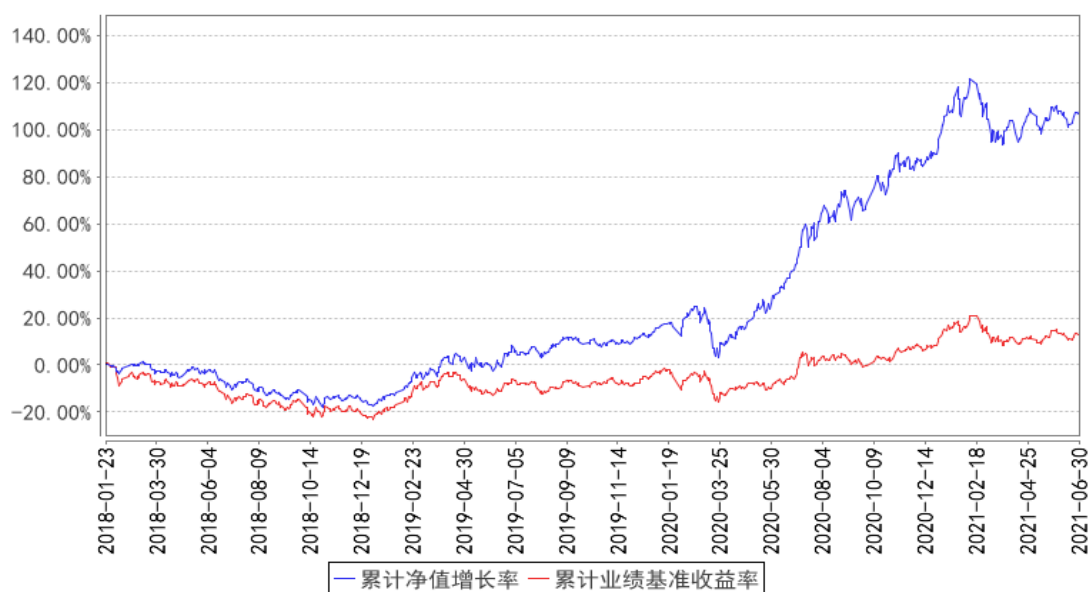
其中， $t = 1, 2, 3, \dots, T$ ， T 表示时间截至日。

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

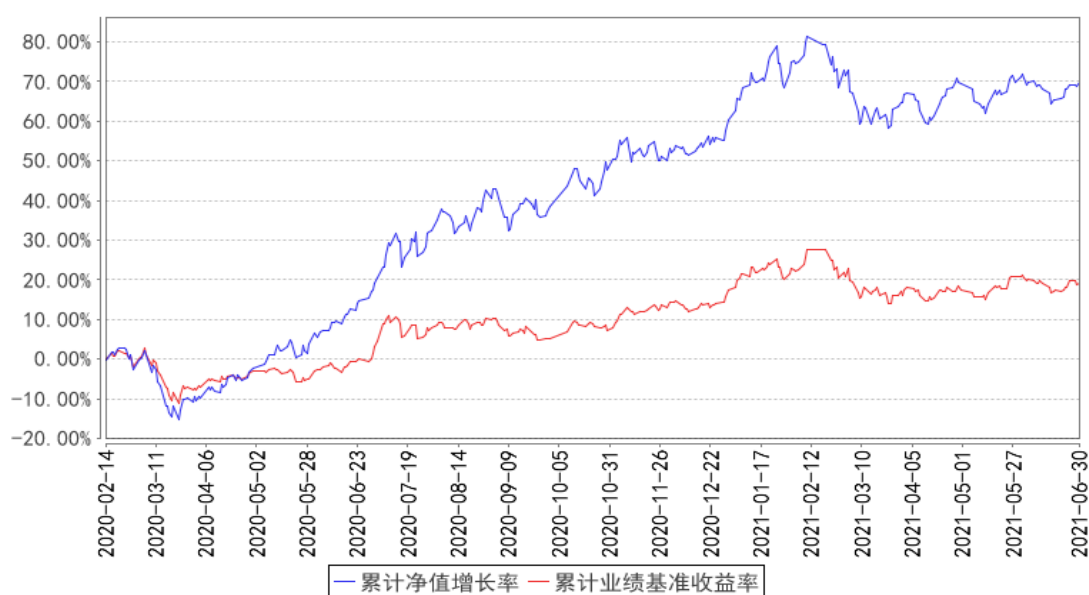
(LOF) C 类份额（代码：005491）。详情请见管理人网站公告。

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 2021 年 6 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 1 月 23 日至 2018 年 7 月 22 日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

3、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。

3.3 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 2021 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 42 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	总经理助理、基金管理部投资总监，兴全合润混合型证券投资基金、兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金基金经理	2018 年 1 月 23 日	-	13 年	硕士，2007 年加入兴证全球基金管理有限公司，历任行业研究员、专户投资部任投资经理、基金管理部投资副总监、兴全轻资产投资混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理。
杨 世 进	兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理	2020 年 12 月 9 日	-	11 年	硕士，历任国家知识产权局专利局审查员，招商基金管理有限公司研究员，天治基金管理有限公司研究员，兴证全球基金管理有限公司任研究员、基金经理助理。
陈玲	固定收益部总监助理、兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、兴全磐稳	2018 年 1 月 30 日	2021 年 1 月 5 日	12 年	硕士，历任国信证券股份有限公司经济研究所行业研究员，兴证全球基金管理有限公司固定收益部研究员。

	增利债券型证券投资基金、兴全恒益债券型证券投资基金基金经理助理				
--	---------------------------------	--	--	--	--

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

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

3、证券从业的涵义遵从行业的相关规定，包括资管相关行业从业经历。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

年初以来，国内疫情仍然控制地较好，经济持续稳定恢复、稳中向好。海外部分国家受新冠

疫情影响较大，发达国家疫苗接种相对较快，经济从疫情中有所恢复；但是新冠病毒不断突变，疫情影响恐将持续。货币政策方面，国内保持灵活精准、合理适度的稳健货币政策。美联储淡化通胀影响，其资产负债表仍处于扩张状态，美国 10 年期国债收益率在 2 季度有所回落。

2021 年上半年上证指数上涨 3.40%，创业板指上涨 17.22%，港股恒生指数上涨 5.86%。开年之初，核心资产延续 2020 年涨势，2-3 月份股市回调之后，以新能源汽车和半导体为代表的科技股逐渐表现强势。最终上半年基础化工、钢铁及电力设备新能源等行业表现较好，而非银金融、家电、军工等行业表现较差。

本基金报告期内股票仓位较为稳定，继续坚持自下而上精选个股的操作理念，持续关注具备核心竞争力的优秀公司，平衡好公司短期估值与长期价值，不断寻找具有良好投资性价比的优秀公司，力求为投资者带来稳健的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末兴全合宜混合 A 的基金份额净值为 2.0797 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.26%，同期业绩比较基准收益率为 1.59%；截至本报告期末兴全合宜混合 C 的基金份额净值为 2.0634 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 1.59%。

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，国内宏观经济政策仍会着力保持经济运行在合理区间，经济高质量发展成果已有所体现。海外方面，美联储开启 Taper 预期逐渐加强。在此背景下，我们仍将坚持自下而上精选个股的投资策略，选择具备核心竞争力的优秀公司，同时注重公司短期估值和长期投资价值的平衡，努力为持有人带来稳健的回报。

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估值造成影响的因素，并就可能带来的影响提出建议和意见；5、监察稽核人员参与估值方案的制定，确保估值方案符合相关法律法规及基金合同的约定，定期对估值流程、系

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《兴全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五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

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

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	4,558,040,824.02	3,598,700,902.46
结算备付金		24,568,898.74	49,451,248.68
存出保证金		6,043,504.36	9,234,433.66
交易性金融资产	6.4.7.2	31,662,353,050.43	27,021,211,144.06
其中：股票投资		31,650,610,518.03	26,984,517,930.06
基金投资		-	-
债券投资		11,742,532.40	36,693,214.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		115,201,739.15	-
应收利息	6.4.7.5	488,998.84	395,618.63
应收股利		28,652,349.78	-
应收申购款		37,682,287.11	27,559,117.33
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		36,433,031,652.43	30,706,552,464.82
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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		-	-
应付证券清算款		89,109,662.81	237,532,467.60
应付赎回款		257,365,240.17	133,088,997.66
应付管理人报酬		44,753,044.04	37,267,854.68
应付托管费		7,458,840.68	6,211,309.08
应付销售服务费		1,104,709.26	527,551.76
应付交易费用	6.4.7.7	10,380,720.93	13,068,340.67
应交税费		96.43	195.83
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	519,962.05	371,205.39
负债合计		410,692,276.37	428,067,922.67
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	17,329,533,242.37	15,472,636,669.12

未分配利润	6.4.7.10	18,692,806,133.69	14,805,847,873.03
所有者权益合计		36,022,339,376.06	30,278,484,542.15
负债和所有者权益总计		36,433,031,652.43	30,706,552,464.82

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 17,329,533,242.37 份。其中兴全合宜混合 A 基金份额总额 16,243,814,867.52 份，基金份额净值 2.0797；兴全合宜混合 C 基金份额总额 1,085,718,374.85 份，基金份额净值 2.0634。

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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		2,186,491,675.87	3,962,395,647.14
1. 利息收入		8,478,658.63	26,131,664.50
其中：存款利息收入	6.4.7.11	8,214,574.27	15,455,460.25
债券利息收入		18,911.40	5,716,500.06
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		245,172.96	4,959,704.19
证券出借利息收入		—	—
其他利息收入		—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,922,424,649.67	3,495,548,411.91
其中：股票投资收益	6.4.7.12	4,686,022,959.29	3,391,575,022.06
基金投资收益	—	—	—
债券投资收益	6.4.7.13	3,597,011.44	-381,749.18
资产支持证券投资	6.4.7.13.5	—	—
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	—	—
衍生工具收益	6.4.7.15	—	—
股利收益	6.4.7.16	232,804,678.94	104,355,139.03
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-2,763,155,366.57	420,692,861.65
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	18,743,734.14	20,022,709.08
减：二、费用		359,673,749.71	224,264,754.21

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	257,723,456.60	157,429,584.06
2. 托管费	6.4.10.2.2	42,953,909.41	26,238,264.02
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	5,680,512.64	67,591.69
4. 交易费用	6.4.7.19	53,145,334.01	40,361,232.44
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		67.89	3,230.53
7. 其他费用	6.4.7.20	170,469.16	164,851.47
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,826,817,926.16	3,738,130,892.93
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,826,817,926.16	3,738,130,892.93

6.3 所有者权益（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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	15,472,636,669.12	14,805,847,873.03	30,278,484,542.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,826,817,926.16	1,826,817,926.16
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	1,856,896,573.25	2,060,140,334.50	3,917,036,907.75
其中：1. 基金申购款	5,713,630,205.28	6,109,161,914.18	11,822,792,119.46
2. 基金赎回款	-3,856,733,632.03	-4,049,021,579.68	-7,905,755,211.71
四、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)			
五、期末所有者权益 (基金净值)	17,329,533,242.37	18,692,806,133.69	36,022,339,376.06
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	32,699,590,743.51	4,559,212,981.51	37,258,803,725.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	3,738,130,892.93	3,738,130,892.93
三、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)	-20,627,853,473.63	-3,178,726,664.67	-23,806,580,138.30
其中: 1. 基金申购款	2,298,762,495.06	411,502,237.21	2,710,264,732.27
2. 基金赎回款	-22,926,615,968.69	-3,590,228,901.88	-26,516,844,870.57
四、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)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	12,071,737,269.88	5,118,617,209.77	17,190,354,479.65

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

兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”) 系由基金管理人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》、《兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 基金合同》(以下简称“基金合同”) 及其他有关法律法规的规定, 经中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”) 以证监许可[2017]2233 号文核准予以公开募集。本基金为契约型开放式, 存续期限不定, 首次设立募集基金份额为 32,699,592,445.33 份, 经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证, 并出具了编号为德师报(验)字(18)第 00050 号验资报告。基金合同于 2018 年 1 月 23 日正式生效。本基金的管理人为兴证全球基金管理有限公司, 托管人为招商银行股份有限公司。

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、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。

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 $\times$ 60% + 恒生指数收益率 $\times$ 20% + 中国债券总指数收益率 $\times$ 20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

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[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]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]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]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，对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) 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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	4,558,040,824.02
定期存款	—
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	—
合计	4,558,040,824.02

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	28,745,551,065.60	31,650,610,518.03	2,905,059,452.43
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	10,384,000.00	11,742,532.40
	银行间市场	-	-
	合计	10,384,000.00	11,742,532.40
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	28,755,935,065.60	31,662,353,050.43	2,906,417,984.83

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	426,986.84
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	47,590.44
应收债券利息	11,447.42
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	2,974.14
合计	488,998.84

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	10,378,321.73
银行间市场应付交易费用	2,399.20
合计	10,380,720.93

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	410,866.11
应付证券出借违约金	-
预提审计费	49,588.57
预提信息披露费	59,507.37
合计	519,962.05

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

兴全合宜混合 A

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	14,951,068,544.33	14,951,068,544.33
本期申购	4,564,998,056.24	4,564,998,056.24
本期赎回（以“-”号填列）	-3,272,251,733.05	-3,272,251,733.05
-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	16,243,814,867.52	16,243,814,867.52

兴全合宜混合 C

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	521,568,124.79	521,568,124.79
本期申购	1,148,632,149.04	1,148,632,149.04
本期赎回（以“-”号填列）	-584,481,898.98	-584,481,898.98
-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	1,085,718,374.85	1,085,718,374.85

注：申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换转出份额。

6.4.7.10 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	9,638,777,770.45	4,672,795,384.42	14,311,573,154.87
本期利润	4,362,517,513.57	-2,588,746,308.53	1,773,771,205.04
本期基金份额交易产生的变动数	1,030,932,157.48	421,942,305.02	1,452,874,462.50
其中：基金申购款	3,707,312,586.92	1,187,383,453.01	4,894,696,039.93
基金赎回款	-2,676,380,429.44	-765,441,147.99	-3,441,821,577.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,032,227,441.50	2,505,991,380.91	17,538,218,822.41

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	331,545,089.54	162,729,628.62	494,274,718.16
本期利润	227,455,779.16	-174,409,058.04	53,046,721.12
本期基金份额交易产生的变动数	427,620,225.05	179,645,646.95	607,265,872.00
其中：基金申购款	909,900,314.20	304,565,560.05	1,214,465,874.25
基金赎回款	-482,280,089.15	-124,919,913.10	-607,200,002.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	986,621,093.75	167,966,217.53	1,154,587,311.28

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	7,434,754.95
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-

结算备付金利息收入	652,923.46
其他	126,895.86
合计	8,214,574.27

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	4,686,022,959.29
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	4,686,022,959.29

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	17,573,358,034.03
减：卖出股票成本总额	12,887,335,074.74
买卖股票差价收入	4,686,022,959.29

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	3,597,011.44
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	3,597,011.44
----	--------------

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	23,539,234.10
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	19,932,000.00
减：应收利息总额	10,222.66
买卖债券差价收入	3,597,011.44

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 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。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 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。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	232,804,678.94
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	232,804,678.94

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-2,763,155,366.57
股票投资	-2,757,264,684.97
债券投资	-5,890,681.60
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	-2,763,155,366.57

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	18,649,562.20
基金转换费收入	94,171.94
合计	18,743,734.14

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	53,145,334.01
银行间市场交易费用	—
合计	53,145,334.01

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
银行费用	42,773.22
账户维护费用	18,600.00
合计	170,469.16

6.4.7.21 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

截至财务报表批准日，本基金无须做披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
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
兴证全球基金管理有限公司（“兴证全球基金”）	基金管理人、本基金 C 类份额注册登记机构、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：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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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	6,259,364,006.82	16.95	1,746,616,560.71	6.68

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
兴业证券	5,926,030.25	21.93	1,685,344.13	16.24
关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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	1,639,736.36	9.10	763,752.10	9.47

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	257,723,456.60	157,429,584.06
其中：支付销售机构的客户维护费	64,796,545.21	47,685,032.13

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：每日应支付的基金管理费=前一日的基金资产净值×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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	42,953,909.41	26,238,264.02

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：每日应支付的基金托管费=前一日的基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴全合宜混合 A	兴全合宜混合 C	合计
兴证全球基金	—	433,377.05	433,377.05
招商银行	—	68,565.27	68,565.27
兴业证券	—	147,496.52	147,496.52
合计	—	649,438.84	649,438.84
获得销售服务费的各关	上年度可比期间		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		

关联方名称	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
兴证全球基金	—	10,033.26	10,033.26
招商银行	—	—	—
兴业证券	—	2,642.37	2,642.37
合计	—	12,675.63	12,675.63

注：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。基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售、服务等各项费用，由基金管理人支配使用。本报告期内本基金的 A 类份额不收取销售服务费，C 类份额基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.60% 的年费率计提。计算方法如下：每日应支付的 C 类基金份额销售服务费 = C 类基金份额前一日基金资产净值 × 年销售服务费率 / 当年天数。

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固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	46,149,937.00	—
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	46,149,937.00	—
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.2663%	—
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 2 月 14 日 (基金合同生效日) 至 2020 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	37,067,337.00	—
报告期间申购/买入总份额	9,082,600.00	—
报告期间因拆分变动份额	—	—
减: 报告期间赎回/卖出总份额	—	—
报告期末持有的基金份额	46,149,937.00	—
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.3841%	—

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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	1,850,000.00	0.0107	650,000.00	0.0042

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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	4,558,040,824.02	7,434,754.95	1,464,741,189.47	14,903,977.39

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末(2021 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	可流通日	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
300123	亚光科技	2021 年 3 月 3 日	2021 年 9 月 3 日	大宗交易购入流通受限	9.06	10.42	1,800,000	16,308,000.00	18,756,000.00	-
300614	百川畅银	2021 年 5 月 18 日	2021 年 11 月 25 日	新股流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-

300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年07月12日	新股流通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	新股流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021年1月12日	2021年07月21日	新股流通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300931	通用电梯	2021年1月13日	2021年7月21日	新股流通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300932	三友联众	2021年1月15日	2021年7月22日	新股流通受限	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300933	中辰股份	2021年1月15日	2021年7月22日	新股流通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易购	2021年1月20日	2021年7月27日	新股流通受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300942	易瑞	2021年2月	2021年8月	新股	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-

	生物	月 2 日	月 9 日	流通受限						
300948	冠中生态	2021 年 2 月 18 日	2021 年 8 月 25 日	新股流通受限	13.00	27.42	216	2,808.00	5,922.72	-
300948	冠中生态	2021 年 6 月 4 日	2021 年 8 月 25 日	新股流通受限-转增	-	27.42	108	-	2,961.36	1
300950	德固特	2021 年 2 月 24 日	2021 年 9 月 3 日	新股流通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300952	恒辉安防	2021 年 3 月 3 日	2021 年 9 月 13 日	新股流通受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
300953	震裕科技	2021 年 3 月 11 日	2021 年 9 月 22 日	新股流通受限	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300955	嘉亨家化	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 24 日	新股流通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300956	英力	2021 年 3 月	2021 年 9 月	新股	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-

	股份	月 16 日	月 27 日	流 通 受 限						
300957	贝泰妮	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 27 日	新 股 流 通 受 限	47.33	251.96	853	40,372.49	214,921.88	-
300958	建工修复	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 29 日	新 股 流 通 受 限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300960	通业科技	2021 年 3 月 22 日	2021 年 9 月 29 日	新 股 流 通 受 限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021 年 3 月 23 日	2021 年 9 月 30 日	新 股 流 通 受 限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金辐照	2021 年 3 月 29 日	2021 年 10 月 11 日	新 股 流 通 受 限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300966	共同药业	2021 年 3 月 31 日	2021 年 10 月 11 日	新 股 流 通 受 限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300967	晓鸣股份	2021 年 4 月 2 日	2021 年 10 月 13 日	新 股 流 通	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-

				受限						
300968	格林精密	2021年4月6日	2021年10月15日	新股流通受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300971	博亚精工	2021年4月7日	2021年10月15日	新股流通受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300972	万辰生物	2021年4月8日	2021年10月19日	新股流通受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300973	立高食品	2021年4月8日	2021年10月15日	新股流通受限	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月21日	新股流通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	新股流通受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300985	致远新能	2021年4月21日	2021年10月29日	新股流通受限	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-

300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月1日	新股流通受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021年4月28日	2021年11月11日	新股流通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	新股流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300992	泰福泵业	2021年5月17日	2021年11月25日	新股流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300993	玉马遮阳	2021年5月17日	2021年11月24日	新股流通受限	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300995	奇德新材	2021年5月17日	2021年11月26日	新股流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联软件	2021年5月26日	2021年12月3日	新股流通受限	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300997	欢乐	2021年5月	2021年12月	新股	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-

	家	月 26 日	月 2 日	流 通 受 限						
300998	宁 波 方 正	2021 年 5 月 25 日	2021 年 12 月 2 日	新 股 流 通 受 限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧 盛 股 份	2021 年 5 月 27 日	2021 年 12 月 7 日	新 股 流 通 受 限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301004	嘉 益 股 份	2021 年 6 月 18 日	2021 年 12 月 27 日	新 股 流 通 受 限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
301007	德 迈 仕	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	新 股 流 通 受 限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301010	晶 雪 节 能	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 20 日	新 股 流 通 受 限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301011	华 立 科 技	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	新 股 流 通 受 限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬 电 科 技	2021 年 6 月 15 日	2021 年 12 月 22 日	新 股 流 通	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-

				受 限						
301015	百 洋 医 药	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	新 股 流 通 受 限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷 尔 伟	2021 年 6 月 23 日	2021 年 12 月 30 日	新 股 流 通 受 限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
301017	漱 玉 平 民	2021 年 6 月 23 日	2022 年 1 月 5 日	新 股 流 通 受 限	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-
301017	漱 玉 平 民	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 5 日	新 股 流 通 受 限	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
301020	密 封 科 技	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新 股 流 通 受 限	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
301020	密 封 科 技	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新 股 流 通 受 限	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
301021	英 诺 激 光	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新 股 流 通 受 限	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-

301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	新股流通受限	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
600059	古越龙山	2021年4月28日	2021年10月26日	非公开发行流通受限	9.31	12.15	1,868,958	17,399,998.98	22,707,839.70	-
600754	锦江酒店	2021年3月23日	2021年9月22日	非公开发行流通受限	44.60	54.68	21,082,063	940,260,009.80	1,152,767,204.84	-
603486	科沃斯	2021年1月26日	2021年7月26日	大宗交易购入流通受限	109.37	222.09	1,150,000	125,775,500.00	255,403,500.00	-
603517	绝味食品	2020年12月31日	2021年7月1日	大宗交易购入流通受限	68.75	84.29	3,330,000	228,937,500.00	280,685,700.00	-

603816	顾家家居	2021年1月26日	2021年7月26日	大宗交易购入流通受限	71.09	75.26	670,000	47,630,300.00	50,424,200.00	-
603899	晨光文具	2021年1月15日	2021年7月15日	大宗交易购入流通受限	85.89	83.61	4,918,600	422,458,554.00	411,244,146.00	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688087	英科再生	2021年6月30日	2021年7月9日	新股流通受限	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688169	石头科技	2021年3月1日	2021年9月1日	大宗交易购入流通受限	918.00	1,176.05	23,500	21,573,000.00	27,637,175.00	-
688226	威腾	2021年6月	2021年7月	新股	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-

	电 气	月 28 日	月 7 日	流 通 受 限						
688317	之 江 生 物	2021 年 1 月 8 日	2021 年 7 月 19 日	新 股 流 通 受 限	43.22	63.82	5,740	248,082.80	366,326.80	-
688329	艾 隆 科 技	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 29 日	新 股 流 通 受 限	16.81	50.04	1,846	31,031.26	92,373.84	-
688607	康 众 医 疗	2021 年 1 月 25 日	2021 年 8 月 2 日	新 股 流 通 受 限	23.21	44.50	1,890	43,866.90	84,105.00	-
688636	智 明 达	2021 年 3 月 30 日	2021 年 10 月 8 日	新 股 流 通 受 限	34.50	80.72	918	31,671.00	74,100.96	-
688696	极 米 科 技	2021 年 2 月 23 日	2021 年 9 月 3 日	新 股 流 通 受 限	133.73	780.24	1,252	167,429.96	976,860.48	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券 代码	证 券 名 称	成 功 认 购 日	可 流 通 日	流 通 受 限 类 型	认 购 价 格	期 末 估 值 单 价	数 量 (单 位: 张)	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
113050	南 银 转 债	2021 年 6 月 17 日	2021 年 7 月 1 日	新 发 未 上 市	100.00	100.00	8,720	872,000.00	872,000.00	-

注：1、本基金持有的新股流通受限股票冠中生态，于 2021 年 6 月 4 日实施 2020 年年度权益分配方案，向全体股东每 10 股派发现金股利人民币 0.80 元（含税），同时，以资本公积金向全体股东每 10 股转增 5 股。本基金新增 108 股。

2、上述流通受限证券可流通日系基金根据上市公司公告暂估确定，最终日期以上市公司公告为准。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600460	士兰微	2021 年 6 月 30 日	重大事项停牌	56.35	2021 年 7 月 1 日	59.49	3,228,288	82,323,796.20	181,914,028.80	-

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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	872,000.00	—
AAA 以下	10,870,532.40	36,693,214.00
未评级	—	—
合计	11,742,532.40	36,693,214.00

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：无。

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 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。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 2021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	4,558,040.8	-	-	-	-	-	4,558,040.8

	24.02						824.02
结算备付金	24,568,898.74	-	-	-	-	-	24,568,898.74
存出保证金	6,043,504.36	-	-	-	-	-	6,043,504.36
交易性金融资产	-	-	-	6,539,332.80	5,203,199.60	31,650,610,518.03	31,662,353,050.43
应收利息	-	-	-	-	-	488,998.84	488,998.84
应收股利	-	-	-	-	-	28,652,349.78	28,652,349.78
应收申购款	1,599,699.12	-	-	-	-	36,082,587.99	37,682,287.11
应收证券清算款	-	-	-	-	-	115,201,739.15	115,201,739.15
资产总计	4,590,252,926.24	-	-	6,539,332.80	5,203,199.60	31,831,036,193.79	36,433,031,652.43
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	257,365,240.17	257,365,240.17
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	44,753,044.04	44,753,044.04
应付托管费	-	-	-	-	-	7,458,840.68	7,458,840.68
应付证券清算款	-	-	-	-	-	89,109,662.81	89,109,662.81
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,104,709.26	1,104,709.26
应付交易费用	-	-	-	-	-	10,380,720.93	10,380,720.93
应交税费	-	-	-	-	-	96.43	96.43
其他负债	-	-	-	-	-	519,962.05	519,962.05
负债总计	-	-	-	-	-	410,692,276.37	410,692,276.37
利率敏感度缺口	4,590,252,926.24	-	-	6,539,332.80	5,203,199.60	31,420,343,917.42	36,022,339,376.06
上年度末 2020 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	3,598,700,902.46	-	-	-	-	-	3,598,700,902.46
结算备付金	49,451,248.	-	-	-	-	-	49,451,248.

	68						. 68
存出保证金	9, 234, 433. 66	-	-	-	-	-	9, 234, 433. 66
交易性金融资产	-	-	-	-	36, 693, 214. 00	26, 984, 517, 930. 06	27, 021, 211, 144. 06
应收利息	-	-	-	-	-	395, 618. 63	395, 618. 63
应收申购款	1, 434, 600. 55	-	-	-	-	26, 124, 516. 78	27, 559, 117. 33
资产总计	3, 658, 821, 185. 35	-	-	-	36, 693, 214. 00	27, 011, 038, 065. 47	30, 706, 552, 464. 82
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	133, 088, 997. 66	133, 088, 997. 66
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	37, 267, 854. 68	37, 267, 854. 68
应付托管费	-	-	-	-	-	6, 211, 309. 08	6, 211, 309. 08
应付证券清算款	-	-	-	-	-	237, 532, 467. 60	237, 532, 467. 60
应付销售服务费	-	-	-	-	-	527, 551. 76	527, 551. 76
应付交易费用	-	-	-	-	-	13, 068, 340. 67	13, 068, 340. 67
应交税费	-	-	-	-	-	195. 83	195. 83
其他负债	-	-	-	-	-	371, 205. 39	371, 205. 39
负债总计	-	-	-	-	-	428, 067, 922. 67	428, 067, 922. 67
利率敏感度缺口	3, 658, 821, 185. 35	-	-	-	36, 693, 214. 00	26, 582, 970, 142. 80	30, 278, 484, 542. 15

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

注：本期末及上年度末，市场利率对基金资产净值均无重大影响。

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 2021 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	—	8,020,973,007. 50	—	8,020,973,007.50
资产合计	—	8,020,973,007. 50	—	8,020,973,007.50
以外币计价的负债				
负债合计	—	—	—	—
资产负债表外 外汇风险敞口净额	—	8,020,973,007. 50	—	8,020,973,007.50
项目	上年度末 2020 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	—	7,529,129,775. 04	—	7,529,129,775.04
资产合计	—	7,529,129,775. 04	—	7,529,129,775.04
以外币计价的负债				
负债合计	—	—	—	—
资产负债表外 外汇风险敞口净额	—	7,529,129,775. 04	—	7,529,129,775.04

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		
	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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	所有外币相对人民币升值 5%	401,048,650.38	376,456,488.75
	所有外币相对人民币贬值 5%	-401,048,650.38	-376,456,488.75

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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	31,650,610,518.03	87.86	26,984,517,930.06	89.12
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	11,742,532.40	0.03	36,693,214.00	0.12
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	31,662,353,050.43	87.90	27,021,211,144.06	89.24

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		
	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 (2021 年 6 月 30 日)	上年度末 (2020 年 12 月 31 日)
分析	业绩比较基准+10%	4,188,877,211.05	3,633,084,948.10
	业绩比较基准-10%	-4,188,877,211.05	-3,633,084,948.10

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。

6.4.14 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	31,650,610,518.03	86.87
	其中：股票	31,650,610,518.03	86.87
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	11,742,532.40	0.03
	其中：债券	11,742,532.40	0.03
	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	4,582,609,722.76	12.58
8	其他各项资产	188,068,879.24	0.52
9	合计	36,433,031,652.43	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 8,020,973,007.50 元，占净值比例 22.27%。

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	11,290.28	0.00
B	采矿业	—	—
C	制造业	15,849,031,754.83	44.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,662.00	0.00
E	建筑业	11,014.44	0.00
F	批发和零售业	47,998,744.28	0.13
G	交通运输、仓储和邮政业	415,090,901.94	1.15
H	住宿和餐饮业	1,250,767,334.34	3.47
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,088,445,890.11	5.80
J	金融业	2,359,552,975.65	6.55
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—

M	科学研究和技术服务业	572,217,746.33	1.59
N	水利、环境和公共设施管理业	44,438.33	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,046,460,758.00	2.91
S	综合	-	-
	合计	23,629,637,510.53	65.60

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	1,830,834,416.71	5.08
日常消费品	1,247,452,330.69	3.46
能源	-	-
金融	232,760,201.36	0.65
医疗保健	1,449,628,304.18	4.02
工业	-	-
信息技术	1,035,194,913.36	2.87
通信服务	1,940,442,298.86	5.39
公用事业	-	-
房地产	284,660,542.34	0.79
合计	8,020,973,007.50	22.27

注：以上分类采用全球行业分类标准（Global Industry Classification Standard, GICS）。

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	600690	海尔智家	87,672,150	2,271,585,406.50	6.31
1	06690	海尔智家	29,729,519	670,381,864.39	1.86
2	00700	腾讯控股	3,993,216	1,940,442,298.86	5.39
3	002415	海康威视	22,872,993	1,475,308,048.50	4.10
4	600754	锦江酒店	22,802,873	1,250,767,334.34	3.47
5	000001	平安银行	54,890,110	1,241,614,288.20	3.45
6	600309	万华化学	10,554,886	1,148,582,694.52	3.19
7	688099	晶晨股份	9,778,717	1,097,172,047.40	3.05
8	00291	华润啤酒	18,348,000	1,064,873,517.84	2.96
9	300413	芒果超媒	15,254,530	1,046,460,758.00	2.91
10	601166	兴业银行	50,809,813	1,044,141,657.15	2.90
11	603707	健友股份	23,166,306	967,193,275.50	2.68
12	000739	普洛药业	31,713,566	932,378,840.40	2.59
13	600521	华海药业	39,586,848	826,573,386.24	2.29

14	02382	舜宇光学科技	3,870,700	790,367,646.54	2.19
15	600031	三一重工	26,339,401	765,686,387.07	2.13
16	000895	双汇发展	23,441,657	745,444,692.60	2.07
17	00780	同程艺龙	40,087,600	648,442,393.64	1.80
18	06078	海吉亚医疗	7,592,800	644,417,336.45	1.79
19	600315	上海家化	10,131,716	609,321,400.24	1.69
20	01801	信达生物	7,908,500	595,864,698.77	1.65
21	603816	顾家家居	7,699,504	593,664,269.12	1.65
22	603259	药明康德	3,536,356	553,757,986.04	1.54
23	00175	吉利汽车	24,270,000	493,757,520.12	1.37
24	002938	鹏鼎控股	13,302,483	477,293,090.04	1.32
25	603517	绝味食品	5,503,773	463,913,026.17	1.29
26	002212	天融信	22,001,820	434,975,981.40	1.21
27	002555	三七互娱	17,388,322	417,667,494.44	1.16
28	002120	韵达股份	30,679,298	415,090,901.94	1.15
29	603899	晨光文具	4,922,760	411,595,915.60	1.14
30	600426	华鲁恒升	13,056,451	404,097,158.45	1.12
31	300124	汇川技术	5,413,299	401,991,583.74	1.12
32	002332	仙琚制药	29,363,343	368,216,321.22	1.02
33	600873	梅花生物	62,035,169	347,396,946.40	0.96
34	603486	科沃斯	1,530,871	342,272,557.68	0.95
35	002250	联化科技	11,344,792	316,519,696.80	0.88
36	002614	奥佳华	13,559,559	306,852,820.17	0.85
37	002603	以岭药业	9,093,599	265,169,346.84	0.74
38	00998	中信银行	76,002,000	232,722,258.51	0.65
38	601998	中信银行	3,632,542	18,525,964.20	0.05
39	688690	纳微科技	1,866,212	219,279,910.00	0.61
40	06049	保利物业	4,800,400	210,500,497.05	0.58
41	02018	瑞声科技	4,158,500	201,037,891.91	0.56
42	600460	士兰微	3,228,288	181,914,028.80	0.51
43	03799	达利食品	46,093,000	177,574,683.73	0.49
44	01530	三生制药	19,156,000	153,017,515.01	0.42
45	603195	公牛集团	642,983	129,882,566.00	0.36
46	300327	中颖电子	1,428,482	121,749,520.86	0.34
47	688083	中望软件	210,681	116,359,116.30	0.32
48	688065	凯赛生物	859,493	90,152,220.77	0.25
49	00688	中国海外发展	5,052,500	74,160,045.29	0.21
50	600496	精工钢构	17,885,577	72,973,154.16	0.20
51	01066	威高股份	3,736,000	56,328,753.95	0.16
52	000785	居然之家	7,854,850	47,678,939.50	0.13
53	00968	信义光能	3,140,000	43,789,374.91	0.12
54	002851	麦格米特	1,309,306	40,889,626.38	0.11

55	601658	邮储银行	8,004,000	40,180,080.00	0.11
56	300408	三环集团	825,284	35,008,547.28	0.10
57	603799	华友钴业	305,498	34,887,871.60	0.10
58	300474	景嘉微	348,597	34,134,618.24	0.09
59	002920	德赛西威	279,094	30,722,667.52	0.09
60	688106	金宏气体	1,122,310	30,336,039.30	0.08
61	601865	福莱特	766,674	30,306,623.22	0.08
62	688122	西部超导	459,336	29,797,126.32	0.08
63	002223	鱼跃医疗	775,471	29,568,709.23	0.08
64	002390	信邦制药	2,725,100	28,559,048.00	0.08
65	002985	北摩高科	286,049	27,889,777.50	0.08
66	600456	宝钛股份	647,184	27,764,193.60	0.08
67	688169	石头科技	23,500	27,637,175.00	0.08
68	000723	美锦能源	3,464,100	26,188,596.00	0.07
69	600703	三安光电	792,503	25,399,721.15	0.07
70	600059	古越龙山	1,868,958	22,707,839.70	0.06
71	603348	文灿股份	568,447	19,895,645.00	0.06
72	300123	亚光科技	1,800,000	18,756,000.00	0.05
73	000710	贝瑞基因	610,000	18,324,400.00	0.05
74	02238	广汽集团	3,147,225	18,252,638.56	0.05
75	300776	帝尔激光	118,480	17,696,172.80	0.05
76	300271	华宇软件	821,700	15,817,725.00	0.04
77	601939	建设银行	2,264,100	15,056,265.00	0.04
78	002384	东山精密	714,800	14,896,432.00	0.04
79	603501	韦尔股份	40,500	13,041,000.00	0.04
80	600416	湘电股份	674,800	9,845,332.00	0.03
81	688339	亿华通	34,695	9,808,276.50	0.03
82	00322	康师傅控股	388,000	5,004,129.12	0.01
83	300785	值得买	30,100	2,859,500.00	0.01
84	688561	奇安信	23,563	2,175,100.53	0.01
85	688256	寒武纪	8,962	1,238,548.40	0.00
86	688686	奥普特	2,330	1,050,830.00	0.00
87	300999	金龙鱼	12,114	1,029,205.44	0.00
88	688696	极米科技	1,252	976,860.48	0.00
89	688180	君实生物	5,902	479,301.42	0.00
90	688317	之江生物	5,740	366,326.80	0.00
91	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.00
92	688336	三生国健	14,352	293,211.36	0.00
93	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.00
94	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.00
95	688199	久日新材	4,494	193,961.04	0.00
96	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.00

97	688510	航亚科技	5,991	157,563.30	0.00
98	688131	皓元医药	391	135,360.29	0.00
99	688058	宝兰德	1,450	134,125.00	0.00
100	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.00
101	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.00
102	688329	艾隆科技	1,846	92,373.84	0.00
103	688607	康众医疗	1,890	84,105.00	0.00
104	688636	智明达	918	74,100.96	0.00
105	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
106	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
107	300894	火星人	679	46,172.00	0.00
108	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
109	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
110	01398	工商银行	10,000	37,942.85	0.00
111	000651	格力电器	675	35,167.50	0.00
112	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
113	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
114	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
115	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
116	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
117	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
118	300890	翔丰华	286	15,615.60	0.00
119	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
120	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
121	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
122	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
123	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
124	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
125	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
126	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
127	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
128	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
129	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
130	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
131	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
132	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
133	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
134	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
135	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
136	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
137	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
138	300950	德固特	219	8,569.47	0.00

139	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
140	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
141	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
142	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
143	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
144	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
145	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
146	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
147	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
148	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
149	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
150	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
151	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
152	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
153	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
154	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
155	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
156	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
157	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
158	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
159	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
160	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
161	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
162	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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	600690	海尔智家	1,391,000,263.70	4.59
1	06690	海尔智家	250,021,681.71	0.83
2	000001	平安银行	1,375,338,623.30	4.54
3	601166	兴业银行	1,226,739,883.22	4.05
4	600309	万华化学	1,131,075,448.78	3.74
5	600754	锦江酒店	1,039,471,954.87	3.43
6	00700	腾讯控股	992,569,169.16	3.28
7	002415	海康威视	755,176,219.23	2.49
8	02382	舜宇光学科技	642,457,405.70	2.12
9	002938	鹏鼎控股	564,730,313.48	1.87
10	00175	吉利汽车	523,054,457.73	1.73

11	600315	上海家化	479,335,120.05	1.58
12	600521	华海药业	440,705,826.59	1.46
13	603899	晨光文具	422,458,554.00	1.40
14	603259	药明康德	418,549,810.97	1.38
15	601601	中国太保	407,920,091.49	1.35
16	600873	梅花生物	388,441,015.10	1.28
17	01398	工商银行	349,545,988.24	1.15
17	601398	工商银行	10,509,059.45	0.03
18	00291	华润啤酒	332,726,390.01	1.10
19	600460	士兰微	325,456,528.49	1.07
20	002250	联化科技	313,082,128.72	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	600309	万华化学	1,409,997,907.48	4.66
2	601318	中国平安	1,266,228,741.42	4.18
3	01211	比亚迪股份	1,201,807,704.40	3.97
3	002594	比亚迪	31,249,816.82	0.10
4	603486	科沃斯	1,154,000,011.66	3.81
5	601012	隆基股份	983,028,838.96	3.25
6	000333	美的集团	744,384,834.38	2.46
7	03690	美团-W	581,311,781.44	1.92
8	02238	广汽集团	527,931,773.83	1.74
9	02269	药明生物	518,973,361.94	1.71
10	00700	腾讯控股	509,569,604.96	1.68
11	600031	三一重工	507,186,879.06	1.68
12	600426	华鲁恒升	420,191,056.52	1.39
13	601601	中国太保	398,336,376.41	1.32
14	300124	汇川技术	396,777,751.58	1.31
15	01398	工商银行	349,987,493.63	1.16
15	601398	工商银行	36,140,046.28	0.12
16	002044	美年健康	380,258,152.09	1.26
17	600460	士兰微	374,863,031.05	1.24
18	03323	中国建材	330,542,991.07	1.09
19	06690	海尔智家	185,896,221.81	0.61
19	600690	海尔智家	118,397,578.57	0.39
20	002600	领益智造	300,985,800.53	0.99

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	20,310,692,347.68
卖出股票收入（成交）总额	17,573,358,034.03

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）	11,742,532.40	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	11,742,532.40	0.03

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	113579	健友转债	54,440	6,539,332.80	0.02
2	110076	华海转债	40,680	4,331,199.60	0.01
3	113050	南银转债	8,720	872,000.00	0.00

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 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中，腾讯控股有限公司、平安银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司具有在报告编制日前一年内受到监管部门处罚的情形；本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

前十名证券发行主体中，未见其他发行主体有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、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	6,043,504.36
2	应收证券清算款	115,201,739.15
3	应收股利	28,652,349.78
4	应收利息	488,998.84
5	应收申购款	37,682,287.11
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—

8	其他	-
9	合计	188,068,879.24

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	113579	健友转债	6,539,332.80	0.02
2	110076	华海转债	4,331,199.60	0.01

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	600754	锦江酒店	1,152,767,204.84	3.20	非公开发行 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	922,046	17,617.14	3,365,545,444.80	20.72	12,878,269,422.72	79.28
兴全合宜混合	233,488	4,650.00	35,192,313.95	3.24	1,050,526,060.90	96.76

C						
合计	1,155,534	14,996.99	3,400,737,758.75	19.62	13,928,795,483.62	80.38

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	基本养老保险基金三一零组合	171,616,286.00	3.17
2	兴银理财有限责任公司-兴银理财兴睿全明星 1 号混合类净值型理财产品	131,510,412.00	2.43
3	泰康资管-华夏银行-泰康资产管理有限责任公司 FOF 进取 1 号资产管理产品	119,784,941.00	2.21
4	东方基金-华夏银行-东方基金睿欣 1 号集合资产管理计划	55,150,342.00	1.02
5	兴银理财有限责任公司-兴银理财睿盈年年升 6 号净值型理财产品	41,261,364.00	0.76
6	兴银理财有限责任公司-兴银理财睿盈优选平衡 8 号混合类净值型理财产品	34,961,226.00	0.65
7	李国平	31,742,629.00	0.59
8	杨巧伟	25,289,629.00	0.47
9	兴银理财有限责任公司-兴银理财睿盈年年升 8 号净值型理财产品	24,285,651.00	0.45
10	聂晶	23,017,799.00	0.42

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	兴全合宜混合 A	22,180,379.75	0.1365
	兴全合宜混合 C	498,261.29	0.0459

有本基金			
	合计	22,678,641.04	0.1309

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	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	兴全合宜混合 A	>100
	兴全合宜混合 C	0
	合计	>100

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

§ 9 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	14,951,068,544.33	521,568,124.79
本报告期基金总申购份额	4,564,998,056.24	1,148,632,149.04
减：本报告期基金总赎回份额	3,272,251,733.05	584,481,898.98
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—	—
本报告期期末基金份额总额	16,243,814,867.52	1,085,718,374.85

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

报告期内本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中金公司	2	6,777,735,203.66	18.36%	4,494,034.23	16.63%	-
广发证券	4	6,375,630,165.21	17.27%	4,498,640.48	16.65%	-
兴业证券	2	6,259,364,006.82	16.95%	5,926,030.25	21.93%	-
华创证券	1	2,087,950,936.90	5.66%	1,526,941.32	5.65%	-
国信证券	2	2,037,249,825.42	5.52%	1,470,926.18	5.44%	-
东吴证券	2	1,904,032,266.49	5.16%	1,249,600.18	4.63%	-
中信证券	5	1,792,843,477.99	4.86%	1,237,661.68	4.58%	-

安信证券	2	1,447,808,387.34	3.92%	1,087,292.67	4.02%	-
长江证券	2	1,318,166,773.21	3.57%	876,838.09	3.25%	-
国金证券	2	1,136,503,629.85	3.08%	735,351.91	2.72%	-
银河证券	1	1,132,175,637.44	3.07%	827,946.57	3.06%	-
中泰证券	4	1,061,014,857.82	2.87%	681,768.72	2.52%	-
华泰证券	2	909,146,815.87	2.46%	603,909.41	2.24%	-
中信建投 证券	5	825,977,191.83	2.24%	549,791.80	2.03%	-
招商证券	2	702,808,877.85	1.90%	513,958.67	1.90%	-
东方证券	1	623,120,258.37	1.69%	455,691.95	1.69%	-
东方财富 证券	2	372,229,021.46	1.01%	168,823.20	0.62%	-
国泰君安	2	154,180,416.58	0.42%	112,753.44	0.42%	-
渤海证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
摩根大通 证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
南京证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
太平洋证 券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-

中金财富	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
中金公司	-	-	-	-	-	-
广发证券	23,539,234.10	100.00%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投 证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东方财富 证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
摩根大通 证券	-	-	-	-	-	-

南京证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-

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	兴全合兴两年封闭运作混合型证券投资基金 (LOF) 基金合同生效公告	上海证券报及规定互联网网站	2021-01-13
2	关于增加北京汇成基金销售有限公司、长量基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报及规定互联网网站	2021-01-14
3	关于兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	上海证券报及规定互联网网站	2021-02-03
4	关于旗下部分基金投资范围增加存托凭证并修改基金合同和托管协议的公告	上海证券报及规定互联网网站	2021-02-09
5	关于增加国元证券为兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金销售机构的公告	上海证券报及规定互联网网站	2021-03-02
6	关于增加中原证券为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报及规定互联网网站	2021-03-05
7	关于增加招商银行为兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) C 份额销售机构的公告	上海证券报及规定互联网网站	2021-03-11
8	关于旗下部分基金投资锦江酒店 (600754) 非公开发行股票的公告	上海证券报及规定互联网网站	2021-03-25
9	关于兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	上海证券报及规定互联网网站	2021-03-29
10	关于增加阳光人寿为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报及规定互联网网站	2021-04-01
11	关于增加华鑫证券为兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) C 份额销售机构的公告	上海证券报及规定互联网网站	2021-04-12
12	增加上海大智慧为旗下部分基金销售机构公告	上海证券报及规定互联网网站	2021-04-21
13	关于兴全合宜灵活配置混合型证券	上海证券报及规定互联	2021-04-26

	投资基金 (LOF) 暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	网网站	
14	关于旗下部分基金投资古越龙山 (600059) 非公开发行的公告	上海证券报及规定互联 网网站	2021-04-30
15	关于兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	上海证券报及规定互联 网网站	2021-05-17
16	关于增加陆金所为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报及规定互联 网网站	2021-06-01
17	关于增加北京新浪仓石基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报及规定互联 网网站	2021-06-16
18	关于增加泛华普益基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报及规定互联 网网站	2021-06-17
19	关于调整网上直销基金转换、赎回转购、汇款交易优惠费率的公告	上海证券报及规定互联 网网站	2021-06-18
20	关于兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 暂停申购、转换、赎回、定期定额投资业务的公告	上海证券报及规定互联 网网站	2021-06-28

§ 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

无。

§ 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中心电话: 400-678-0099, 021-38824536。

兴证全球基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日