

兴全优选进取三个月持有期混合型基金中 基金（FOF） 2020 年中期报告

2020 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2020 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 28 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 2020 年 3 月 6 日（基金合同生效日）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	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
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	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	48
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	53
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	53
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	53
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	53
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 市场中性策略执行情况	54
7.13 本报告期投资基金情况	54
7.14 投资组合报告附注	58
§8 基金份额持有人信息	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
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的情况	60
§9 开放式基金份额变动	61
§10 重大事件揭示	62
10.1 基金份额持有人大会决议	62
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	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
10.4 基金投资策略的改变	62
10.5 本报告持有的基金发生的重大影响事件	62
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	62
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	62

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	62
10.9 其他重大事件	63
§11 影响投资者决策的其他重要信息	66
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	66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	66
§12 备查文件目录	67
12.1 备查文件目录	67
12.2 存放地点	67
12.3 查阅方式	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）
基金简称	兴全优选进取三个月持有混合（FOF）
场内简称	—
基金主代码	008145
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 3 月 6 日
基金管理人	兴证全球基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,196,762,133.87 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	—
上市日期	—

注：本基金每份基金份额的最短持有期限为 3 个月。

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的前提下，通过优选基金积极把握基金市场的投资机会，力求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金的投资策略包括：大类资产配置策略、优选基金策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、证券公司短期公司债券投资策略等。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准：中证偏股型基金指数收益率×80%+中债综合（全价）指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

注：本基金每份基金份额的最短持有期限为 3 个月。对于每份基金份额，最短持有期指基金合同生效日（对认购份额而言，下同）或基金份额申购确认日（对申购份额而言，下同）起（即最短持有期起始日），至基金合同生效日或基金份额申购申请日起满 3 个月（3 个月指 30 天乘以 3 的自然天数，下同）后的下一工作日（即最短持有期到期日）。本基金每份基金份额在其最短持有期到期日（含该日）后，基金份额持有人方可就该基金份额提出赎回申请。因此，对于基金份额持有人而言，存在投资本基金后，3 个月内无法赎回的风险。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨卫东	郭明
	联系电话	021-20398888	010-66105799

	电子邮箱	yangwd@xqfunds.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006780099, 021-38824536	95588
传真		021-20398858	010-66105798
注册地址		上海市黄浦区金陵东路368号	北京市西城区复兴门内大街55号
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	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		201204	100140
法定代表人		兰荣	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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(2020 年 3 月 6 日 - 2020 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	30,058,917.88
本期利润	249,249,527.35
加权平均基金份额本期利润	0.1174
本期加权平均净值利润率	11.54%
本期基金份额净值增长率	11.11%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	30,424,585.59
期末可供分配基金份额利润	0.0138
期末基金资产净值	2,440,883,054.89
期末基金份额净值	1.1111
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	11.11%

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

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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。

4、本基金成立于 2020 年 3 月 6 日。

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	7.73%	0.68%	9.35%	0.74%	-1.62%	-0.06%
过去三个月	15.03%	0.75%	18.68%	0.82%	-3.65%	-0.07%
自基金合同生效起至今	11.11%	0.93%	7.64%	1.14%	3.47%	-0.21%

注：1、本基金业绩比较基准：中证偏股型基金指数收益率×80%+中债综合（全价）指数收益率×20%
采用该业绩比较基准主要基于以下考虑：本基金不低于 80%的资产投资于公开募集的证券投资基

金，中证偏股型基金指数选取内地市场所有股票型基金以及混合型基金中以股票为主要投资对象的基金作为样本，采用净值规模加权，以较好的反映所有偏股型开放式证券投资基金的整体走势。中债综合（全价）指数由中央国债登记结算有限公司编制，旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况，是具有代表性的债券市场指数。

选用以上业绩比较基准可以有效评估本基金投资组合业绩，反映本基金的风格特点。

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：

$$\text{Return}_t = (\text{中证偏股型基金指数收益率}_t / \text{中证偏股型基金指数收益率}_{t-1} - 1) * 80\% + (\text{中债综合（全价）指数收益率}_t / \text{中债综合（全价）指数收益率}_{t-1} - 1) * 20\%$$

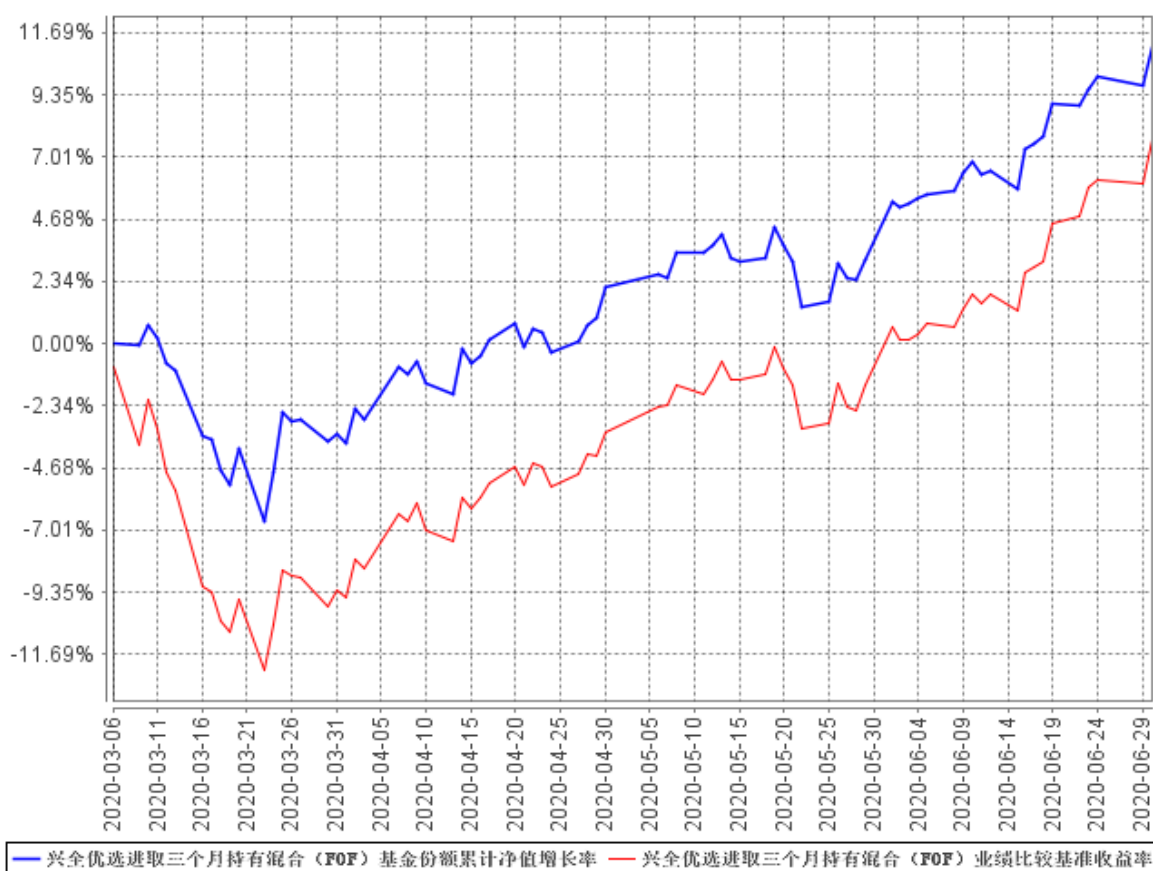
$$\text{Benchmark}_t = (1 + \text{Return}_t) * (1 + \text{Benchmark}_{t-1}) - 1$$

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

2、本基金基金合同生效日为 2020 年 3 月 6 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

兴全优选进取三个月持有混合（FOF）基金份额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 2020 年 6 月 30 日。

2、按照《兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》的规定，本基金应自 2020 年 3 月 6 日至 2020 年 9 月 5 日之间的六个月为建仓期，建仓期结束时本基金将符合基金合同约定的比例限制及投资组合的比例范围。截至 2020 年 6 月 30 日，本基金尚在建仓期内。

3.3 其他指标

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”。

截止 2020 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、兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全货币市场证券投资基金、兴全全球视野股票型证券投资基金、兴全社会责任混合型证券投资基金、兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金、兴全磐稳增利债券型证券投资基金、兴全合润分级混合型证券投资基金、兴全沪深 300 指数增强型基金（LOF）、兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全精选混合型证券投资基金、兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全商业模式优选混合型证券投资基金（LOF）、兴全添利宝货币市场基金、兴全新视野灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、兴全稳益定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全天添益货币市场基金、兴全稳泰债券型证券投资基金、兴全兴泰定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全恒益债券型证券投资基金、兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、兴全祥泰定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、兴全恒裕债券型证券投资基金、兴全多维价值混合型证券投资基金、兴全恒瑞三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全合泰混合型证券投资基金、兴全社会价值三年持有期混合型基金中基金（FOF）、兴全恒鑫债券型证券投资基金、兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）、兴全沪港深两年持有期混合型基金中基金共 31 只基金。

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	说明
----	----	-----------------	-----	----

		任职日期	离任日期	业年限	
林国怀	FOF 投资与金融工程部、养老金管理部总监，本基金、兴全安泰平衡养老三年持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理	2020 年 3 月 6 日	-	11 年	经济学硕士。历任天相投资顾问有限公司基金分析师，瑞泰人寿保险基金组合投资经理，合众人寿资产管理中心基金组合投资经理，泰康资产管理有限公司执行总监，天安人寿资产管理中心权益投资部经理。
丁凯琳	本基金基金经理助理、兴全安泰平衡养老三年持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理助理	2020 年 3 月 6 日	-	8 年	硕士，历任芝加哥商品交易所量化分析师，兴证全球基金管理有限公司 FOF 投资与金融工程部研究员。

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

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

3、“证券从业年限”按其从事证券投资、研究等业务的年限计算。

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

本报告期末，本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划的投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）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，存在本投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况，原因为合规调整，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

2020 年上半年股票市场大幅上涨，2、3 月份在国内外新冠疫情的影响下市场出现了较大幅度的调整，但随着全球央行纷纷采取史无前例的宽松货币政策，全球股票市场均出现了较大幅度的回升，A 股市场更是在创业板、科创板的带动下走出了波澜壮阔的行情，但分化显著。上半年，创业板 50 指数上涨 42.61%，沪深 300 指数仅上涨 1.64%；医药、科技、消费等相关行业涨幅居前，采掘、金融、交运、地产等周期板块出现了一定程度的下跌。

本基金于 3 月 6 日成立，成立初期市场出现了较大幅度的快速调整，我们在此过程中采取了相对积极的建仓策略，随后组合基本上维持了相对稳定的权益仓位。资产配置方面，我们以权益类资产为主，适度配置绝对收益类资产，其中权益类资产主要包括权益类基金和股票，以 A 股市场为主，小部分参与了港股和美股市场；绝对收益类资产部分，我们主要从市场上挖掘确定性较高的绝对收益品种，包括债券基金、可转债、新股策略基金等等。

在基金选择方面，我们依然坚持从三个角度来寻找超额收益，1、通过选择优秀的基金经理管理的基金产品构建组合来获取超额收益；2、通过选择性价比更优的基金品种来获取超额收益；3、通过适度的低买高卖的操作来获取超额收益。

此外，建仓完成后部分的持仓基金发生了基金经理变更情况，我们也根据细致的调研和分析，对相关的持仓品种进行了调整。

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 1.1111 元；本报告期基金份额净值增长率为 11.11%，业绩比较基准收益率为 7.64%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济方面，在疫苗和特效药没有面世之前，新冠肺炎对国内外的经济依然存在负面影响；中美之间的冲突短期内仍没有解决方案，虽然当前一些宏观经济指标有转好的态势，但不确定性依然较大。

流动性方面，新基金发行火爆，场内融资规模提升，北向资金流入，在市场的上涨阶段，股票市场和流动性形成正反馈，但从历史情况来看，一旦资金面出现了逆转，市场可能会面临一定的风险；

估值方面，目前市场分化显著，部分行业和板块的估值水平相对于历史而言处于较高水平，而另一部分行业和板块的估值水平依然偏低，立足于稍长一点的视角来看，目前的估值差异应该不可持续；

政策方面整体偏正面，创业板注册制改革落地，新股发行加速。

我们仍然对 A 股的长期走势保持乐观，但在资金面的推动下，全球股票市场背离宏观基本面对大幅上行，A 股也出现了部分的行业和板块估值偏高，我们对此保持谨慎。所以在整体的组合管理过程中，我们会做好板块之间的再平衡，提升组合的安全边际，积极把握市场上确定性较高的投资机会。

本基金是一只较高风险的普通 FOF 基金，FOF 的最大优势是在不降低组合预期收益率的情况下能有效的降低组合的波动率，兼顾长期收益率和持有人体验，我们也将秉承勤勉尽责的态度进行组合管理，遵守契约要求、保持策略的稳定性，从而陪伴投资者实现财富增值。

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《中华人民共和国证券投资基金法》、《兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）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

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金管理人——兴证全球基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对兴证全球基金管理有限公司编制和披露的本基金 2020 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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：兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	157,883,992.69	-
结算备付金		598,020.78	-
存出保证金		193,364.30	-
交易性金融资产	6.4.7.2	2,286,958,112.08	-
其中：股票投资		181,247,973.17	-
基金投资		2,084,472,433.63	-
债券投资		21,237,705.28	-
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		11,619,837.49	-
应收利息	6.4.7.5	43,402.13	-
应收股利		-	-
应收申购款		17,630,975.96	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,474,927,705.43	-
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 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		1,095,002.91	-
应付赎回款		30,963,104.19	-
应付管理人报酬		1,326,827.97	-
应付托管费		340,334.09	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	48,922.54	-
应交税费		132,413.37	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	138,045.47	-
负债合计		34,044,650.54	-
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	2,196,762,133.87	-
未分配利润	6.4.7.10	244,120,921.02	-
所有者权益合计		2,440,883,054.89	-
负债和所有者权益总计		2,474,927,705.43	-

报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1111 元，基金份额总额 2,196,762,133.87 份。

6.2 利润表

会计主体：兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2020 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 3 月 6 日（基金 合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		256,045,395.55	-
1.利息收入		663,340.14	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	559,594.73	-
债券利息收入		14,148.01	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		89,597.40	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		35,451,507.79	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	4,257,605.30	-
基金投资收益	6.4.7.13	11,922,722.88	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	19,271,179.61	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	219,190,609.47	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	739,938.15	-
减：二、费用		6,795,868.20	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,838,877.05	-

2. 托管费	6.4.10.2.2	1, 212, 105. 22	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	659, 991. 46	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		14, 530. 94	-
7. 其他费用	6.4.7.21	70, 363. 53	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		249, 249, 527. 35	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		249, 249, 527. 35	-

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2020 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 3 月 6 日（基金合同生效日）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）	1, 978, 308, 637. 71	-	1, 978, 308, 637. 71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	249, 249, 527. 35	249, 249, 527. 35
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）	218, 453, 496. 16	-5, 128, 606. 33	213, 324, 889. 83
其中：1.基金申购款	495, 858, 808. 26	13, 442, 094. 72	509, 300, 902. 98
2. 基金赎回款	-277, 405, 312. 10	-18, 570, 701. 05	-295, 976, 013. 15
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）	2, 196, 762, 133. 87	244, 120, 921. 02	2, 440, 883, 054. 89

项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-	-
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	-	-	-

注：本基金合同于 2020 年 3 月 6 日生效，本期数据按实际存续期计算。

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：

<u>兰荣</u>	<u>庄园芳</u>	<u>詹鸿飞</u>
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

兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2019]1862 号文准予募集注册，由兴证全球基金管理有限公司作为管理人向社会公开发行募集，基金合同于 2020 年 3 月 6 日正式生效，首次设立募集规模为 1,978,308,637.71 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为及注册登记机构为兴证全球基金管理有限公司，基金托管人为中国工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，包括经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金（包括 QDII 基金和香港互认基金）、国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板以及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公

司债券、证券公司短期公司债券、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具以及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。

本基金不投资具有复杂、衍生品性质的基金份额，包括分级基金和中国证监会认定的其他基金份额。

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，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

本基金投资于经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金的资产比例不低于基金资产的 80%，其中，股票、股票型基金、混合型基金等权益类资产投资合计占基金资产的比例为 60%-95%，投资于货币市场基金的资产占基金资产的比例不高于 15%。本基金应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金业绩比较基准：中证偏股型基金指数收益率×80%+中债综合（全价）指数收益率×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

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及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 2020 年 6 月 30 日的财务状况、自 2020 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2020 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项。

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括基金投资、股票投资和债券投资。

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的基金、股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益。

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认。

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 基金投资

买入基金于成交日确认为基金投资，基金投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用

入账。

卖出基金于成交日确认基金投资收益，卖出基金的成本按移动加权平均法于成交日结转。

(2) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账。

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

(3) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本。

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法确认债券投资成本。

卖出债券于成交日确认债券投资收益；卖出债券的成本按移动加权平均法结转。

(4) 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

(1) 对于银行间市场交易的固定收益品种，以及交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），按照第三方估值机构提供的估值确定公允价值。

(2) 对于基金投资，按如下方法估值：(a) 对于交易型开放式指数基金、境内上市定期开放式基金及封闭式基金，按所投资基金估值日的收盘价估值；(b) 对于境内上市开放式基金（LOF）及其他境内非货币市场基金，按所投资基金估值日的份额净值估值；(c) 对于境内上市交易型货币市场基金，如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金估值日的份额净值估值；如所投资基金披露

万份（百份）收益，则按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份（百份）收益计提估值日基金收益；(d) 对于境内非上市货币市场基金，按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份收益计提估值日基金收益。如遇所投资的证券投资基金不公布基金份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情况的，按以下原则进行估值：(a) 以所投资基金的份额净值估值的，若所投资基金与本基金估值频率一致但未公布估值日基金份额净值，按其最近公布的份额净值为基础估值。(b) 以所投资基金的收盘价估值的，若估值日无交易，且最近交易日后市场环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后市场环境发生了重大变化的，可使用最新的份额净值为基础或参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素调整最近交易市价，确定公允价值。(c) 若所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分，基金管理人将根据份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。

(3) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值；对于发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时股票公司公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按照监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

(4) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

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

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

（1）存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示。

（2）债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。

（3）资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提。

（4）买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提。

（5）基金投资收益/（损失）于卖出基金成交日确认，并按卖出基金成交金额与其成本的差额入账。

（6）股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账。

（7）债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账。

（8）衍生工具收益/（损失）于卖出成交日确认，并按卖出成交金额与其成本的差额入账。

(9) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

(10) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

(11) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.00%的年费率逐日计提，但本基金投资于本基金管理人所管理的基金的部分不收取管理费。

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20%的年费率逐日计提，但本基金投资于本基金托管人所托管的基金的部分不收取托管费。

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

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

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

(3) 每一基金份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向

管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1) 对于基金投资，根据中基协发[2017]3 号《关于发布〈基金中基金估值业务指引（试行）〉的通知》之附件《基金中基金估值业务指引（试行）》的规定在估值日对非上市基金和上市基金进行估值。

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

(3) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证监会公告[2017]13 号）及《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》（中基协发[2013]13 号）相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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

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

本基金在本报告期无重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]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; 公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务, 以基金管理人为增值税纳税人, 暂适用简易计税方法, 按照 3% 的征收率缴纳增值税。

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

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入, 由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳; 从公开发行和转让市场取得的上市公司股票, 持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的, 暂减按 50% 计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	157,883,992.69

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：	157,883,992.69

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	166,074,076.93	181,247,973.17	15,173,896.24
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	21,977,961.37	21,237,705.28
	银行间市场	-	-
	合计	21,977,961.37	21,237,705.28
资产支持证券	-	-	-
基金	1,879,715,464.31	2,084,472,433.63	204,756,969.32
其他	-	-	-
合计	2,067,767,502.61	2,286,958,112.08	219,190,609.47

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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

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

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 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	13,888.02

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	242.19
应收债券利息	29,193.62
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	78.30
合计	43,402.13

6.4.7.6 其他资产

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 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	48,922.54
银行间市场应付交易费用	-
合计	48,922.54

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	77,796.32
应付证券出借违约金	-
预提费用	60,249.15
合计	138,045.47

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
----	--

	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,978,308,637.71	1,978,308,637.71
本期申购	495,858,808.26	495,858,808.26
本期赎回(以“-”号填列)	-277,405,312.10	-277,405,312.10
— 基金拆分/份额折算前	—	—
基金拆分/份额折算变动份额	—	—
本期申购	—	—
本期赎回(以“-”号填列)	—	—
本期末	2,196,762,133.87	2,196,762,133.87

6.4.7.10 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
基金合同生效日	—	—	—
本期利润	30,058,917.88	219,190,609.47	249,249,527.35
本期基金份额交易产生的变动数	365,667.71	-5,494,274.04	-5,128,606.33
其中：基金申购款	2,142,842.35	11,299,252.37	13,442,094.72
基金赎回款	-1,777,174.64	-16,793,526.41	-18,570,701.05
本期已分配利润	—	—	—
本期末	30,424,585.59	213,696,335.43	244,120,921.02

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	543,893.45
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	14,987.66
其他	713.62
合计	559,594.73

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	12,297,211.73
减：卖出股票成本总额	8,039,606.43
买卖股票差价收入	4,257,605.30

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	418,991,398.15
减：卖出/赎回基金成本总额	407,068,675.27
基金投资收益	11,922,722.88

6.4.7.14 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内未进行衍生工具买卖交易。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2020 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,413,785.50
其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	17,857,394.11
合计	19,271,179.61

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	219,190,609.47
—— 股票投资	15,173,896.24
—— 债券投资	-740,256.09
—— 资产支持证券投资	—
—— 基金投资	204,756,969.32
—— 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	219,190,609.47

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	739,938.15
合计	739,938.15

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2020 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	152,948.89
银行间市场交易费用	—
交易基金产生的费用	507,042.57
其中：申购费	47,000.00
赎回费	428,437.56
交易费	31,605.01
合计	659,991.46

6.4.7.20.1 持有基金产生的费用

单位：人民币元

项目	本期费用 2020 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	47,819.39
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	6,257,173.61
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	1,105,156.58

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	21,378.24
信息披露费	38,870.91
证券出借违约金	—
银行费用	10,114.38
合计	70,363.53

6.4.7.22 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
兴证全球基金管理有限公司（以下简称“兴证全球基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（以下简称“工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
兴业证券股份有限公司（以下简称“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 2020年3月6日(基金合同生效日)至 2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	163,071,101.61	100.00%	—	—

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年3月6日(基金合同生效日)至 2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	21,908,881.03	100.00%	-	-

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年3月6日(基金合同生效日)至 2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比例
兴业证券	600,000,000.00	100.00%	-	-

6.4.10.1.4 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年3月6日(基金合同生效日)至 2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	成交金额	占当期基金 成交总额的比例	成交金额	占当期基金 成交总额的比例
兴业证券	1,083,870,194.63	100.00%	-	-

6.4.10.1.5 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年3月6日(基金合同生效日)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	113,852.05	100.00%	48,922.54	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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
-	-	-	-	-

注：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。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 2020年3月6日(基金合同生效日)至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,838,877.05	-
其中：支付销售机构的客户维护费	2,870,707.41	-

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.00%的年费率计提，但本基金投资于本基金管理人所管理的基金的部分不收取管理费。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×1.00%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年3月6日(基金合同生效日)至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,212,105.22	-

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20%的年费率计提，但本基金投资于本基金托管人所托管的基金的部分不收取托管费。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

净值扣除本基金投资于本基金托管人所托管的基金的部分×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

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

本基金本报告期末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

本基金本报告期内无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

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

本基金本报告期内无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

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

本基金的管理人在本报告期内未持有过本基金。

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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未持有本基金。

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 2020年3月6日(基金合同生效日)至 2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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
工商银行	157,883,992.69	543,893.45	-	-

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，按银行同业利率计算。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末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**6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明**

本报告期末本基金持有基金管理人兴证全球基金管理有限公司所管理的基金合计 762,378,270.20 元，占本基金资产净值的比例为 31.23%。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

单位：人民币元

项目	本期费用 2020 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
当期交易基金产生的申购费（元）	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	79,595.86
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	2,508,926.22
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	434,152.03
-	-

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2020 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
000710	贝瑞基因	2020 年 5 月 6 日	2020 年 11 月 6 日	大宗交易购入流通受限	39.97	54.68	100,000	3,997,000.00	5,468,000.00	-

000938	紫光股份	2020 年 3 月 10 日	2020 年 9 月 10 日	大宗交易 购入 流通受限	40.71	41.44	120,000	4,885,200.00	4,972,800.00	-
603486	科沃斯	2020 年 4 月 16 日	2020 年 10 月 16 日	大宗交易 购入 流通受限	17.28	28.34	300,000	5,184,000.00	8,502,000.00	-
002624	完美世界	2020 年 3 月 12 日	2020 年 9 月 14 日	大宗交易 购入 流通受限	39.78	55.57	120,000	4,773,600.00	6,668,400.00	-
300629	新劲刚	2020 年 5 月 22 日	2020 年 11 月 25 日	非公开发 行流 通受限	17.74	24.71	304,397	5,400,002.78	7,521,649.87	-
600517	国网英大	2020 年 5 月 19 日	2020 年 11 月 16 日	非公开发 行流 通受限	5.50	6.24	690,909	3,799,999.50	4,311,272.16	-
603305	旭升股份	2020 年 6 月 11 日	2020 年 12 月 9 日	非公开发 行流 通受限	32.41	34.64	123,419	4,000,009.79	4,275,234.16	-
300609	汇纳科技	2020 年 6 月 3 日	2020 年 12 月 7 日	非公开发 行流 通受限	30.61	33.62	120,000	3,673,200.00	4,034,400.00	-
603955	大千生态	2020 年 6 月 9 日	2020 年 12 月 7 日	非公开发 行流 通受限	13.46	14.64	211,668	2,849,051.28	3,098,819.52	-
300735	光弘科技	2020 年 4 月 23 日	2020 年 10 月 27 日	非公开发 行流 通受限	23.68	17.36	32,014	758,091.52	555,763.04	-

				限						
300735	光弘科技	2020 年 5 月 29 日	2020 年 10 月 27 日	非公开发行流通受限-转增	-	17.36	12,806	-	222,312.16	注 1
688568	中科星图	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 8 日	新股流通受限	16.21	16.21	11,020	178,634.20	178,634.20	-
688377	迪威尔	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 8 日	新股流通受限	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	-
688027	国盾量子	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 9 日	新股流通受限	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	-
300845	捷安高科	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 3 日	新股流通受限	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300843	胜蓝股份	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 2 日	新股流通受限	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300840	酷特智能	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 8 日	新股流通受限	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300846	首都在线	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 1 日	新股流通受限	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-

1. 本基金持有的非公开发行股票光弘科技，于 2020 年 5 月 29 日实施 2019 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 3.00 元（含税），同时，以资本公积金向全体股东每 10 股转增 4 股。本基金新增 12,806.00 股。
2. 上述流通受限证券可流通日系本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

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

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

本基金本报告期末无参加因转融通证券业务而出借的证券。

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、风险管理部和监察稽核部、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。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金持有一家公司发行的证券或本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券（均不含证券投资基金），不超过该证券的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

本基金于本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末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

本基金于本报告期末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 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
AAA	10,358,652.10	-
AAA 以下	10,879,053.18	-
未评级	0.00	-
合计	21,237,705.28	-

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

本基金于本报告期末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

本基金于本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金每份基金份额的最短持有期限为 3 个月。对于每份基金份额，最短持有期指基金合同生效日（对认购份额而言，下同）或基金份额申购确认日（对申购份额而言，下同）起（即最短持有期起始日），至基金合同生效日或基金份额申购申请日起满 3 个月（3 个月指 30 天乘以 3 的

自然天数，下同）后的下一工作日（即最短持有期到期日）。本基金每份基金份额在其最短持有期到期日（含该日）后，基金份额持有人方可就该基金份额提出赎回申请。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 2020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	157,883,992.69	-	-	-	-	-	157,883,992.69
结算备付金	598,020.78	-	-	-	-	-	598,020.78
存出保证金	193,364.30	-	-	-	-	-	193,364.30
交易性金融资产	-	-	-	9,807,099.60	11,430,605.68	2,265,720,406.80	2,286,958,112.08
应收证券清算款	-	-	-	-	-	11,619,837.49	11,619,837.49
应收利息	-	-	-	-	-	43,402.13	43,402.13
应收申购款	233,454.41	-	-	-	-	17,397,521.55	17,630,975.96
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	158,908,832.18	-	-	9,807,099.60	11,430,605.68	2,294,781,167.97	2,474,927,705.43
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,095,002.91	1,095,002.91
应付赎回款	-	-	-	-	-	30,963,104.19	30,963,104.19

应付管理人 报酬	-	-	-	-	-	1,326,827.97	1,326,827.97
应付托管费	-	-	-	-	-	340,334.09	340,334.09
应付交易费 用	-	-	-	-	-	48,922.54	48,922.54
应交税费	-	-	-	-	-	132,413.37	132,413.37
其他负债	-	-	-	-	-	138,045.47	138,045.47
负债总计	-	-	-	-	-	34,044,650.54	34,044,650.54
利率敏感度 缺口	158,908,832.18	-	-	-9,807,099.60	11,430,605.68	2,260,736,517.43	2,440,883,054.89
上年度末 2019 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							
资产总计	-	-	-	-	-	-	-
负债							
负债总计	-	-	-	-	-	-	-
利率敏感度 缺口	-	-	-	-	-	-	-

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

无。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

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。本基金主要投资于经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金、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。

本基金投资于经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金（包括 QDII 基金和香港互认基金）的资产比例不低于基金资产的 80%；本基金会将拟投资的资产分为权益类资产和非权益类资产两类。权益类资产主要包括股票、股票型基金以及混合型基金等，非权益类资产主要包括各

类债券、债券型基金、货币市场型基金等固收类资产。本基金的权益类资产投资比例中枢为 80%。
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 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	181,247,973.17	7.43	—	—
交易性金融资产—基金投资	2,084,472,433.63	85.40	—	—
交易性金融资产—债券投资	21,237,705.28	0.87	—	—
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	2,286,958,112.08	93.69	—	—

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（2020 年 6 月 30 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准+10%	230,968,551.33	—
	业绩比较基准-10%	-230,968,551.33	—

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

2. 本基金基金合同生效时间为 2020 年 3 月 6 日。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

假设	1. 置信区间 -		
	2. 观察期 -		
分析	风险价值 (单位: 人民币元)	本期末 (2020 年 6 月 30 日)	上年度末 (2019 年 12 月 31 日)
	-	-	-
	合计	-	-

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	181,247,973.17	7.32
	其中：股票	181,247,973.17	7.32
2	基金投资	2,084,472,433.63	84.22
3	固定收益投资	21,237,705.28	0.86
	其中：债券	21,237,705.28	0.86
	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	158,482,013.47	6.40
8	其他各项资产	29,487,579.88	1.19
9	合计	2,474,927,705.43	100.00

7.2 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	7,249,724.00	0.30
C	制造业	93,550,612.90	3.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.00
E	建筑业	6,710,618.52	0.27
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	1,795,425.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,655,553.77	0.89
J	金融业	24,189,178.32	0.99
K	房地产业	7,684,846.00	0.31
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	8,424,732.80	0.35
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	9,974,515.54	0.41
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	181,247,973.17	7.43

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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	占基金资产净值比例（%）
1	002044	美年健康	692,194	9,974,515.54	0.41
2	603486	科沃斯	300,000	8,502,000.00	0.35
3	300629	新劲刚	304,397	7,521,649.87	0.31
4	002624	完美世界	120,000	6,668,400.00	0.27
5	002415	海康威视	211,100	6,406,885.00	0.26
6	002001	新 和 成	194,960	5,673,336.00	0.23
7	000338	潍柴动力	403,400	5,534,648.00	0.23
8	300271	华宇软件	194,900	5,498,129.00	0.23
9	000710	贝瑞基因	100,000	5,468,000.00	0.22
10	000333	美的集团	84,900	5,076,171.00	0.21
11	000938	紫光股份	120,000	4,972,800.00	0.20
12	000002	万 科 A	167,900	4,388,906.00	0.18
13	600517	国网英大	690,909	4,311,272.16	0.18
14	603305	旭升股份	123,419	4,275,234.16	0.18
15	601799	星宇股份	32,300	4,102,100.00	0.17
16	300609	汇纳科技	120,000	4,034,400.00	0.17
17	601939	建设银行	637,500	4,022,625.00	0.16
18	601128	常熟银行	531,300	3,990,063.00	0.16
19	002142	宁波银行	151,416	3,977,698.32	0.16
20	600309	万华化学	76,000	3,799,240.00	0.16
21	600031	三一重工	199,800	3,748,248.00	0.15
22	600036	招商银行	109,200	3,682,224.00	0.15
23	002050	三花智控	161,850	3,544,515.00	0.15
24	601318	中国平安	47,600	3,398,640.00	0.14

25	601166	兴业银行	209,600	3,307,488.00	0.14
26	600048	保利地产	223,000	3,295,940.00	0.14
27	601138	工业富联	216,700	3,283,005.00	0.13
28	601899	紫金矿业	735,300	3,235,320.00	0.13
29	000858	五 粮 液	18,800	3,217,056.00	0.13
30	601088	中国神华	219,600	3,153,456.00	0.13
31	603955	大千生态	211,668	3,098,819.52	0.13
32	600406	国电南瑞	150,100	3,039,525.00	0.12
33	603259	药明康德	30,608	2,956,732.80	0.12
34	002064	华峰氨纶	560,300	2,840,721.00	0.12
35	600436	片仔癀	16,000	2,724,000.00	0.11
36	601668	中国建筑	546,900	2,608,713.00	0.11
37	300454	深信服	10,800	2,224,368.00	0.09
38	603589	口子窖	42,100	2,142,890.00	0.09
39	601012	隆基股份	50,800	2,069,084.00	0.08
40	601688	华泰证券	96,300	1,810,440.00	0.07
41	600754	锦江酒店	64,700	1,795,425.00	0.07
42	600585	海螺水泥	32,000	1,693,120.00	0.07
43	002008	大族激光	46,100	1,657,295.00	0.07
44	000651	格力电器	18,300	1,035,231.00	0.04
45	601186	中国铁建	119,700	1,003,086.00	0.04
46	002110	三钢闽光	129,300	861,138.00	0.04
47	601666	平煤股份	230,200	860,948.00	0.04
48	300735	光弘科技	44,820	778,075.20	0.03
49	000895	双汇发展	16,100	742,049.00	0.03
50	300124	汇川技术	18,400	699,016.00	0.03
51	000625	长安汽车	51,800	569,800.00	0.02
52	002600	领益智造	45,400	482,602.00	0.02
53	300450	先导智能	10,200	471,342.00	0.02
54	000786	北新建材	19,900	424,467.00	0.02
55	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.01
56	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.01
57	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.00
58	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.00
59	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
60	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
61	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
62	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
63	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00

64	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
65	300824	北鼎股份	500	6,855.00	0.00
66	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	002044	美年健康	7,999,620.94	0.33
2	002415	海康威视	5,994,541.00	0.25
3	000858	五 粮 液	5,984,786.36	0.25
4	000338	潍柴动力	5,529,419.00	0.23
5	300629	新劲刚	5,400,002.78	0.22
6	002001	新 和 成	5,207,446.60	0.21
7	603486	科沃斯	5,184,000.00	0.21
8	300271	华宇软件	5,007,924.00	0.21
9	000333	美的集团	4,994,100.00	0.20
10	000938	紫光股份	4,885,200.00	0.20
11	002624	完美世界	4,773,600.00	0.20
12	000002	万 科 A	4,613,469.00	0.19
13	601128	常熟银行	4,149,739.00	0.17
14	601939	建设银行	4,125,823.00	0.17
15	002142	宁波银行	4,044,565.72	0.17
16	603305	旭升股份	4,000,009.79	0.16
17	000710	贝瑞基因	3,997,000.00	0.16
18	600517	国网英大	3,799,999.50	0.16
19	600036	招商银行	3,762,350.55	0.15
20	601318	中国平安	3,719,464.00	0.15

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	000858	五 粮 液	3,021,351.00	0.12

2	688599	天合光能	1,719,295.97	0.07
3	600519	贵州茅台	1,595,480.00	0.07
4	601012	隆基股份	1,578,855.00	0.06
5	688106	金宏气体	1,027,874.05	0.04
6	688505	复旦张江	792,435.32	0.03
7	688312	燕麦科技	472,261.00	0.02
8	688558	国盛智科	396,389.60	0.02
9	688004	博汇科技	307,850.00	0.01
10	688157	松井股份	280,665.00	0.01
11	688555	泽达易盛	235,363.40	0.01
12	688516	奥特维	209,152.00	0.01
13	600918	中泰证券	200,500.08	0.01
14	300832	新产业	136,253.00	0.01
15	601827	三峰环境	75,364.83	0.00
16	002990	盛视科技	50,673.60	0.00
17	002989	中天精装	48,049.40	0.00
18	002986	宇新股份	37,800.00	0.00
19	605001	威奥股份	35,719.20	0.00
20	300838	浙江力诺	25,904.70	0.00

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	174,113,683.36
卖出股票收入（成交）总额	12,297,211.73

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）	21,237,705.28	0.87

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	21,237,705.28	0.87

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	110059	浦发转债	37,410	3,810,208.50	0.16
2	128085	鸿达转债	31,320	3,267,615.60	0.13
3	128097	奥佳转债	28,511	3,178,406.28	0.13
4	132018	G 三峡 EB1	23,020	2,554,299.20	0.10
5	110047	山鹰转债	20,250	2,183,152.50	0.09

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

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

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

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

股指期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

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

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.11.3 本期国债期货投资评价

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.12 市场中性策略执行情况

本基金不属于中性策略基金，故此项不适用。

7.13 本报告期投资基金情况

7.13.1 投资政策及风险说明

本基金是基金中基金，投资于经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金的资产比例不低于基金资产的 80%，同时，本基金会将拟投资的资产分为权益类资产和非权益类资产两类。权益类资产主要包括股票、股票型基金以及混合型基金等，非权益类资产主要包括各类债券、债券型基金、货币市场型基金等固收类资产。

本基金原则上以权益类资产为主要投资方向，本基金的权益类资产投资比例中枢为 80%。通过大类资产配置策略最终决定权益类基金在本基金组合中的占比。同时，在权益类基金内部，将根据不同的风险收益特征和投资风格对基金进行分类，建立相应的分析跟踪模型，在既定的投资范围和投资策略内进行基金类别比例的配置。

本基金主要投资于公开募集证券投资基金，整体风险中等，符合基金合同约定的投资政策、投资限制等要求。

7.13.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	163417	兴全合宜混合A	上市契约型开放式（LOF）	89,380,712.15	127,278,134.10	5.21	是
2	163402	兴全趋势投资混合（LOF）	上市契约型开放式（LOF）	134,016,777.67	114,311,609.03	4.68	是
3	003949	兴全稳泰债券A	契约型开放式	97,191,175.04	100,165,225.00	4.10	是
4	340007	兴全社会责任混合	契约型开放式	18,605,256.31	85,546,968.51	3.50	是
5	340006	兴全全球视	契约型	33,942,795.07	84,337,662.91	3.46	是

		野股票	开放式				
6	163415	兴全商业模式混合（LOF）	上市契约型开放式（LOF）	29,288,702.93	81,100,418.41	3.32	是
7	510900	H股ETF	交易型开放式（ETF）	66,198,000.00	75,068,532.00	3.08	否
8	163407	兴全沪深300指数（LOF）A	上市契约型开放式（LOF）	33,474,223.26	72,900,163.42	2.99	是
9	510050	上证50ETF	交易型开放式	24,236,300.00	71,642,502.80	2.94	否
10	260116	景顺长城核心竞争力混合	契约型开放式	17,192,649.58	62,065,464.98	2.54	否
11	000020	景顺长城品质投资混合	契约型开放式	18,270,209.43	59,615,693.37	2.44	否
12	001256	泓德优选成长混合	契约型开放式	44,615,919.62	59,606,868.61	2.44	否
13	000628	大成高新技术产业股票	契约型开放式	26,317,762.24	59,162,329.52	2.42	否
14	160613	鹏华盛世创新混合（LOF）	上市契约型开放式（LOF）	41,353,540.38	57,894,956.53	2.37	否
15	161017	富国中证500指数增强（LOF）	契约型开放式	28,782,162.16	56,556,948.64	2.32	否
16	163412	兴全轻资产混合（LOF）	上市契约型开放式（LOF）	17,985,842.79	51,709,298.02	2.12	是
17	166005	中欧价值发现混合A	契约型、开放式	32,255,012.80	51,491,902.43	2.11	否
18	100032	富国中证红利指数增强	契约型开放式	50,799,098.74	50,291,107.75	2.06	否
19	001975	景顺长城环保优势股票	契约型开放式	18,458,872.16	45,999,509.42	1.88	否
20	163409	兴全绿色投资混合（LOF）	上市契约型开放式	19,193,857.97	45,028,790.80	1.84	是

			(LOF)				
21	206002	鹏华精选成长混合	契约型 开放式	17,093,447.29	38,955,966.37	1.60	否
22	001409	工银互联网加股票	契约型 开放式	73,108,829.71	38,382,135.60	1.57	否
23	160142	南方配售	上市型 开放式 (LOF)	35,074,151.00	37,003,229.31	1.52	否
24	161131	易基配售	契约型 开放式	35,103,411.00	36,507,547.44	1.50	否
25	166001	中欧新趋势混合 (LOF)	契约型 上市开 放式 (LOF)	24,059,360.12	35,504,397.73	1.45	否
26	166009	中欧新动力混合 (LOF)	契约型 上市开 放式 (LOF)	12,894,476.68	33,097,542.74	1.36	否
27	110023	易方达医疗 保健行业混 合	契约型 开放式	8,180,888.70	28,404,045.57	1.16	否
28	510300	300ETF	交易型 开放式	6,739,300.00	28,156,795.40	1.15	否
29	005062	博时中证 500指数增 强A	契约型 开放式	22,213,652.23	27,058,449.78	1.11	否
30	518880	黄金ETF	交易型 开放式 (ETF)	6,899,600.00	27,005,034.40	1.11	否
31	168103	九泰锐益	契约型	23,132,944.00	26,996,145.65	1.11	否
32	001330	鹏华弘实混 合C	契约型 开放式	20,078,770.56	26,407,599.04	1.08	否
33	501186	华夏配售	契约型 开放式	24,738,092.00	25,801,829.96	1.06	否
34	000083	汇添富消费 行业混合	契约型 开放式	4,078,099.51	25,292,373.16	1.04	否
35	001835	易方达瑞祥 混合I	契约型 开放式	20,490,983.61	25,060,472.96	1.03	否
36	001044	嘉实新消费 股票	契约型 开放式	12,642,164.44	23,552,352.35	0.96	否
37	169101	东方红睿丰 混合	契约型 开放式	13,642,016.97	23,396,059.10	0.96	否
38	159920	恒生ETF	交易型	17,016,700.00	23,210,778.80	0.95	否

			开放式				
39	161125	易方达标普500指数(QDII-LOF)	契约型、上市开放式(LOF)	16,558,205.00	22,863,569.46	0.94	否
40	005937	工银精选金融地产混合A	契约型开放式	16,346,664.59	20,134,186.78	0.82	否
41	501054	东证睿泽	契约型,定期开放式	10,106,264.00	12,511,554.83	0.51	否
42	007130	中庚小盘价值股票	契约型开放式	9,411,709.34	11,106,758.19	0.46	否
43	540010	汇丰晋信科技先锋股票	契约型开放式	3,045,029.80	9,953,897.91	0.41	否
44	501046	财通福鑫	上市契约型、定期开放	5,011,041.00	9,746,474.75	0.40	否
45	501073	科创混合	契约型开放式	9,422,448.00	9,516,672.48	0.39	否
46	168105	九泰泰富	契约型	6,466,925.00	8,251,796.30	0.34	否
47	168102	九泰锐富	契约型	5,706,073.00	6,014,200.94	0.25	否
48	166024	中欧恒利	契约型、开放式	6,204,322.00	5,763,815.14	0.24	否
49	001285	易方达新鑫混合I	契约型开放式	4,114,403.29	5,027,800.82	0.21	否
50	001817	易方达瑞兴混合I	契约型开放式	4,236,440.68	5,020,182.21	0.21	否
51	169105	东证睿华	契约型	2,405,163.00	3,814,588.52	0.16	否
52	501063	添富悦享	契约型开放式	3,053,992.00	3,454,064.95	0.14	否
53	168101	九泰锐智	契约型	2,120,276.00	3,214,338.42	0.13	否
54	501062	南方瑞合	契约型开放式	2,121,987.00	2,344,795.64	0.10	否
55	501076	科创基金	上市契约型开放式(LOF)	1,082,431.00	1,341,132.01	0.05	否
56	501075	科创主题	上市契约型开放式(LOF)	864,426.00	1,073,617.09	0.04	否
57	161728	招商配售	契约型	904,298.00	945,895.71	0.04	否

			开放式				
58	000251	工银金融地产混合	契约型 开放式	376,049.38	806,249.87	0.03	否

7.14 投资组合报告附注

7.14.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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。

7.14.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

7.14.3 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	193,364.30
2	应收证券清算款	11,619,837.49
3	应收股利	—
4	应收利息	43,402.13
5	应收申购款	17,630,975.96
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	29,487,579.88

7.14.4 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	110059	浦发转债	3,810,208.50	0.16
2	128085	鸿达转债	3,267,615.60	0.13
3	132018	G 三峡 EB1	2,554,299.20	0.10
4	110047	山鹰转债	2,183,152.50	0.09
5	113026	核能转债	2,072,755.60	0.08
6	110053	苏银转债	1,921,388.80	0.08
7	128063	未来转债	1,012,245.20	0.04
8	110064	建工转债	934,806.80	0.04

9	113547	索发转债	159,837.90	0.01
10	113508	新风转债	63,258.30	0.00

7.14.5 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	603486	科沃斯	8,502,000.00	0.35	大宗交易购入流通受限
2	300629	新劲刚	7,521,649.87	0.31	非公开发行流通受限
3	002624	完美世界	6,668,400.00	0.27	大宗交易购入流通受限
4	000710	贝瑞基因	5,468,000.00	0.22	大宗交易购入流通受限

7.14.6 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
65,353	33,613.79	113,731,467.66	5.18%	2,083,030,666.21	94.82%

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	6,406,393.82	0.2916%

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的情况

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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	>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

基金合同生效日（ 2020 年 3 月 6 日 ）基金份额总额	1, 978, 308, 637. 71
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	495, 858, 808. 26
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	277, 405, 312. 10
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	2, 196, 762, 133. 87

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 本报告持有的基金发生的重大影响事件

无。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为本基金提供审计服务的审计机构——德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.7 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。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
兴业证券	3	163,071,101.61	100.00%	113,852.05	100.00%	-

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

10.8.2 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
兴业证券	21,908,881.03	100.00%	600,000,000.00	100.00%	-	-	1,083,870,194.63	100.00%

10.9 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	兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同	中国证券报及规定互联网网站	2020 年 2 月 11 日
2	兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议	中国证券报及规定互联网网站	2020 年 2 月 11 日
3	兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）招募说明书	中国证券报及规定互联网网站	2020 年 2 月 11 日
4	兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）份额发售公告	中国证券报及规定互联网网站	2020 年 2 月 11 日
5	关于增加兴全优选进取三个月持有期 FOF 销售机构的公告	中国证券报及规定互联网网站	2020 年 2 月 22 日
6	关于开展兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）网上直销认购费率优惠活动的公告	中国证券报及规定互联网网站	2020 年 2 月 26 日
7	关于增加兴全优选进取三个月持有期 FOF 销售机构的公告	中国证券报及规定互联网网站	2020 年 2 月 27 日
8	关于增加兴全优选进取三个月持有期 FOF 销售机构的公告	中国证券报及规定互联网网站	2020 年 2 月 29 日
9	关于兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）提前结束募集的公告	中国证券报及规定互联网网站	2020 年 3 月 2 日
10	关于兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）认购申请确认比例结果的公告	中国证券报及规定互联网网站	2020 年 3 月 3 日
11	兴全优选进取三个月持有期混合	中国证券报及规定	2020 年 3 月 7 日

	型基金中基金（FOF）基金合同生效公告	互联网网站	
12	关于兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）可投资科创板股票及相关风险揭示的公告	中国证券报及规定 互联网网站	2020 年 3 月 17 日
13	关于公司法定名称变更的公告	中国证券报及规定 互联网网站	2020 年 3 月 19 日
14	关于兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）参加部分销售机构申购费率、定投费率优惠活动的公告	中国证券报及规定 互联网网站	2020 年 3 月 19 日
15	兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）开放日常申购（含定期定额投资）业务的公告	中国证券报及规定 互联网网站	2020 年 3 月 19 日
16	关于增加东兴证券、国联证券、华安证券、九州证券为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报及规定 互联网网站	2020 年 3 月 20 日
17	关于调整网上直销汇款交易优惠费率的公告	中国证券报及规定 互联网网站	2020 年 3 月 26 日
18	关于增加腾安基金销售为兴全优选进取三个月持有期 FOF 销售机构的公告	中国证券报及规定 互联网网站	2020 年 4 月 7 日
19	关于调整旗下部分基金在招商银行最低定期定额投资金额的公告	中国证券报及规定 互联网网站	2020 年 5 月 12 日
20	关于旗下部分基金投资国网英大（600517）非公开发行股票的公告	中国证券报及规定 互联网网站	2020 年 5 月 21 日
21	关于变更网上直销汇款交易账户的公告	中国证券报及规定 互联网网站	2020 年 5 月 22 日
22	关于变更直销中心银行账户信息的公告	中国证券报及规定 互联网网站	2020 年 5 月 25 日
23	关于旗下部分基金投资新劲刚（300629）非公开发行股票的公告	中国证券报及规定 互联网网站	2020 年 5 月 26 日
24	兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）开放日常赎回业务的公告	中国证券报及规定 互联网网站	2020 年 6 月 3 日
25	关于旗下部分基金投资汇纳科技（300609）非公开发行股票的公告	中国证券报及规定 互联网网站	2020 年 6 月 5 日
26	关于增加中信证券华南为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报及规定 互联网网站	2020 年 6 月 10 日
27	关于旗下部分基金投资大千生态（603955）非公开发行股票的公告	中国证券报及规定 互联网网站	2020 年 6 月 11 日
28	关于增加旗下部分基金销售机构	中国证券报及规定	2020 年 6 月 12 日

	的公告	互联网网站	
29	关于旗下部分基金投资旭升股份(603305)非公开发行股票的公告	中国证券报及规定 互联网网站	2020 年 6 月 13 日
30	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	中国证券报及规定 互联网网站	2020 年 6 月 19 日
31	关于增加兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金销售机构的公告	中国证券报及规定 互联网网站	2020 年 6 月 19 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。							

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

本基金每份基金份额最短持有期为三个月。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- （一）中国证监会关于准予兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）注册的批复文件
- （二）《兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》
- （三）《兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议》
- （四）法律意见书
- （五）基金管理人业务资格批件和营业执照
- （六）基金托管人业务资格批件和营业执照
- （七）中国证监会规定的其它文件

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

2020 年 8 月 31 日