

兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混 合型基金中基金（FOF） 2022 年中期报告

2022 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：2022 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 2022 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 2022 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
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	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
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	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 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
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	49
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	49

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	49
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	49
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	49
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12	本报告期投资基金情况	49
7.13	投资组合报告附注	错误!未定义书签。
§ 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情况	60
§ 9	开放式基金份额变动	60
§ 10	重大事件揭示	60
10.1	基金份额持有人大会决议	60
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	60
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
10.4	基金投资策略的改变	61
10.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件	61
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	63
10.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况	63
10.9	其他重大事件	66
§ 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	67
§ 12	备查文件目录	67
12.1	备查文件目录	67
12.2	存放地点	68
12.3	查阅方式	68

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）
基金简称	兴证全球安悦稳健养老一年持有混合 FOF
基金主代码	012509
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 9 月 17 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	6,356,270,478.61 份
基金合同存续期	不定期

注：本基金每份基金份额最短持有期为 1 年。

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的前提下，本基金主要通过成熟稳健的资产配置策略和公募基金精选策略进行投资，力求基金资产的长期稳健增值，满足投资者的养老资金理财需求。
投资策略	作为一只服务于投资者养老需求的基金，本基金定位为稳健型的目标风险策略基金，根据特定的风险偏好设定权益类和固定收益类资产的比例，来获取养老资金的长期稳健增值。具体投资策略包括：资产配置策略、优选基金策略、股票投资策略、存托凭证投资策略、港股投资策略、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、风险控制策略等。（详见本基金招募说明书）
业绩比较基准	中证偏股型基金指数收益率×20%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5%+中债综合（全价）指数收益率×75%。
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。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。

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 28-29 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	201204	518040
法定代表人	杨华辉	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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 号嘉里城办公楼 28-29 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(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	37,084,598.60
本期利润	-58,855,029.89
加权平均基金份额本期利润	-0.0093
本期加权平均净值利润率	-0.93%
本期基金份额净值增长率	-0.92%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	19,735,688.88
期末可供分配基金份额利润	0.0031
期末基金资产净值	6,376,006,167.49
期末基金份额净值	1.0031
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	0.31%

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

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

期末可分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：开放式基金的申购费

回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.31%	0.19%	2.06%	0.29%	-0.75%	-0.10%
过去三个月	1.66%	0.25%	2.36%	0.37%	-0.70%	-0.12%
过去六个月	-0.92%	0.28%	-1.61%	0.38%	0.69%	-0.10%
自基金合同生效起至今	0.31%	0.23%	-0.97%	0.32%	1.28%	-0.09%

注：本基金业绩比较基准为中证偏股型基金指数收益率×20%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5%+中债综合（全价）指数收益率×75%。采用该业绩比较基准主要基于以下考虑：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。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。本基金主要投资于公开募集的证券投资基金，且原则上会以 25% 的基金资产投资于权益类资产，因此本基金业绩比较基准中的 20% 选择了中证偏股型基金指数收益率，5% 选择了恒生指数收益率（使用估值汇率折算）。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，适合作为本基金债券投资业绩的比较基准。

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：

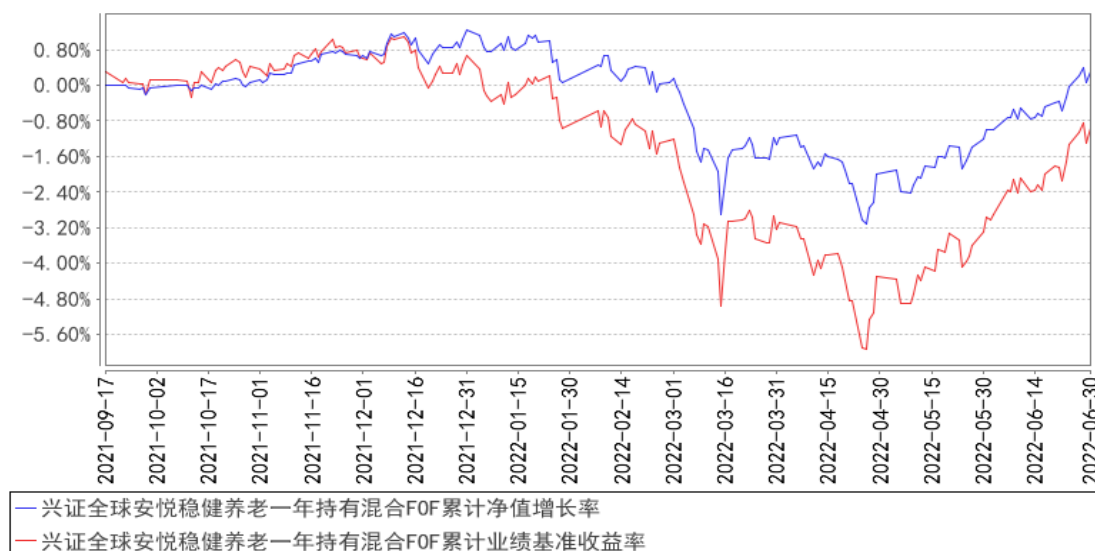
$$\text{Return } t = 20\% \times (\text{中证偏股型基金指数收益率 } t / \text{中证偏股型基金指数收益率 } t-1 - 1) + 5\% \times (\text{恒生指数收益率 } t / \text{恒生指数收益率 } t-1 - 1) + 75\% \times (\text{中债综合（全价）指数收益率 } t / \text{中债综合（全价）指数收益率 } t-1 - 1)$$

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

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

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

兴证全球安悦稳健养老一年持有混合FOF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、净值表现所取数据截至到 2022 年 6 月 30 日。

2、按照《兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》的规定，本基金建仓期为 2021 年 09 月 17 日起共计六个月。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

3.3 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“兴证全球基金管理有限公司”，注册资本增加为 1.5 亿元人民币，其中两股东出资比例不变。2016 年

12月28日，因公司发展需要，公司名称变更为“兴全基金管理有限公司”。2020年3月18日，公司名称变更为“兴证全球基金管理有限公司”。

截止2022年6月30日，公司旗下共50只基金，品种涵盖货币型、债券型、混合型、股票型、指数型、FOF等不同类型，建立了覆盖高中低等级的公募基金产品线，为各类风险偏好的投资者提供便捷、专业的投资理财服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
林国怀	FOF 投资与金融工程部总监、养老金管理部总监，兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）、兴全安泰稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、兴全安泰积极养老目标五年持有期混合型基金中基金	2021年9月17日	-	15年	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。

	(FOF)、 兴证全球 优选平衡 三个月持 有期混合 型基金中 基金 (FOF)、 兴证全球 安悦稳健 养老目标 一年持有 期混合型 基金中基 金(FOF)、 兴证全球 积极配置 三年封闭 运作混合 型基金中 基金 (FOF- LOF)、兴 证全球优 选稳健六 个月持有 期债券型 基金中基 金(FOF) 基金经理				
--	--	--	--	--	--

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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本报告期末，本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划的投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴证全球安悦稳健养老目标一年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，不存在本投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年上半年股票市场在快速下跌后 V 型反弹，1-4 月份相对热门的“新半军”板块出现了较大幅度的调整，5、6 月份前期跌幅相对较大的行业和板块又出现快速上涨，尤其是以新能源、汽车、军工等行业涨幅领先。从整个上半年来看，沪深 300 指数下跌 9.22%，上证 50 指数下跌 6.59%，中证 500 和中证 1000 指数分别下跌 12.30% 和 12.67%，创业板 50 下跌 15.41%；以高股息股票为主要标的的上证红利和中证红利指数表现相对较好，涨跌幅分别为 3.09% 和 -1.99%。从行业表现上来看，煤炭行业一枝独秀，上半年涨幅 31.38%，交通运输、综合、美容护理、房地产、有色、银行等行业跌幅相对较小，而电子、计算机、传媒、军工行业半年跌幅在 20% 以上；从风格指数上来看，低市盈率指数表现优于中、高市盈率指数，大盘指数表现优于中、小盘指数。有一个值得注意的现象是，自 4 月 27 日市场反弹以来，中、高市盈率指数表现大幅优于低市盈率指数，行业上分化也是非常明显，银行、地产涨幅不足 5%，而电力设备、汽车的区间涨幅在 50% 附近。

债券市场方面，上半年债市总体呈现震荡走势，十年国债收益率在 2.70-2.90 的狭窄区间内震荡。同时，疫情背景下央行维持宽松货币政策，收益率曲线呈陡峭化态势，短端收益率下行明显，1 年期国债收益率由 2.24 下降到 1.95。信用债走势整体强于利率债，中低资质信用债收益率下行更多，信用利差已被压缩至历史极低位置。

上半年，中证偏股基金指数下跌 10.02%，中长期纯债基金指数上涨 1.41%，标普 500ETF 下跌 16.43%，黄金 ETF 上涨 4.49%。

资产配置层面，本基金坚持 25%的权益类资产和 75%的固定收益类资产的战略资产配置；在战术资产配置上，在前期的市场快速下跌过程中，不断通过再平衡保持组合维持在一个相对稳定的权益仓位，4月下旬以后随着市场逐步进入相对低估区间，逢低增加组合的权益配置比例，降低欠配幅度至平配。

品种选择层面，本基金的基金选择思路更侧重于从基金经理的投资风格和盈利模式角度出发，所以更加倾向于对风格稳定的基金经理长期持有。目前组合在风格配置上，以追求安全边际的价值型基金和追求性价比的 GARP 型基金配置为主，场内封闭式基金随着开放赎回进行逐步减持；同时，4月份以后积极参与股票定增和大宗交易，通过有折价的方式参与部分成长股的投资。

上半年整体组合小幅跑赢业绩比较基准，组合的波动率、最大回撤方面整体控制依然相对良好。

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 1.0031 元；本报告期基金份额净值增长率为-0.92%，业绩比较基准收益率为-1.61%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前国内、外宏观形势均处于比较复杂的阶段，海外通胀水平维持高位，俄乌战争仍在继续，IMF 不断下调全球的经济预期，美国市场预期未来经济衰退的概率上升。国内的经济数据在货币宽松、财政发力的政策作用下逐步从四、五月份的疫情中逐步复苏，但后续的经济增长情况仍需进一步的观察。

自 2019 年以来的市场大幅上涨，市场分化尤为显著，资金对于成长性的追逐已处于一个相对“白热化”阶段，2019、2020 年对于盈利质量的长期成长逻辑的过分追捧，2021 年以及今年 4 月底反弹以来对于短期景气度的高度关注，说明当前市场在存量资金博弈的过程中，相对看重短期的景气数据，而对于安全边际、长期配置方面的考量相对较少，从而可能会导致股票市场出现较大幅度的波动和快速轮动。

基于中长期的角度来看，我们依然看好 A 股市场的长期震荡上行的方向，但从中短期而言，目前新增资金相对缺乏，在存量资金博弈的背景下，我们更加倾向于重视“安全边际”和“性价比”，对于高估值的领域和板块保持适度谨慎，同时做好板块之间的再平衡，始终把组合的安全边际作为重要考量，积极把握市场上确定性较高的相对收益或绝对收益的投资机会。此外，我们将继续按照“多资产、多策略”的方式来构建组合，随着海外市场的大幅下跌，也将逢低增加海外

QDII 基金的配置比例，从而增加组合的收益来源，进一步平滑未来的组合的业绩波动率。

目前债券市场收益率处于一个相对偏低的水平，考虑到未来的收益率预期和费率情况，目前组合会将小部分的固定收益类资产配置于货币市场基金。

本基金是一只稳健策略的养老目标基金，权益类资产的配置中枢为 25%，我们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，努力兼顾长期收益率和改善持有人体验，从而陪伴投资者实现财富增值和养老储备。

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重大事件等可能对给估值造成影响的因素，并就可能带来的影响提出建议和意见；5、监察稽核人员参与估值方案的制定，确保估值方案符合相关法律法规及基金合同的约定，定期对估值流程、系统估值模型及估值结果进行检查，确保估值委员会决议的有效执行，负责基金估值业务的定期和临时信息披露。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《兴证全球安悦稳健养老目标一年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

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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

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

本年度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：兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	80,447,469.66	84,430,202.34
结算备付金		158,747.99	1,502,612.56
存出保证金		32,855.03	81,823.38
交易性金融资产	6.4.7.2	6,276,188,744.28	6,340,041,818.87
其中：股票投资		149,011,906.12	178,863,882.69
基金投资		5,771,860,203.80	5,809,985,667.88
债券投资		355,316,634.36	351,192,268.30
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-

其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		22,566,510.17	1,252,033.48
应收股利		78,942.74	-
应收申购款		24,965.15	309,970.16
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	614.52	2,852,787.73
资产总计		6,379,498,849.54	6,430,471,248.52
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,662,896.94	2,810,844.50
应付托管费		711,103.50	744,178.31
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		39.82	77.07
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	118,641.79	129,037.68
负债合计		3,492,682.05	3,684,137.56
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	6,356,270,478.61	6,348,186,797.73
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	19,735,688.88	78,600,313.23
净资产合计		6,376,006,167.49	6,426,787,110.96
负债和净资产总计		6,379,498,849.54	6,430,471,248.52

注：1. 报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0031 元，基金份额总额 6,356,270,478.61 份。

2. 本基金合同于 2021 年 9 月 17 日生效，本期财务报表的实际编制期间为 2022 年上半年度和 2021 年 9 月 17 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间。

3. 以上比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号（年度报告和中期报告）》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年度末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年度末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合

并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

6.2 利润表

会计主体：兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-38,358,287.18
1. 利息收入		179,550.82
其中：存款利息收入	6.4.7.13	150,249.47
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		29,301.35
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		57,399,257.75
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-6,042,373.58
基金投资收益	6.4.7.15	-4,205,570.30
债券投资收益	6.4.7.16	4,178,853.36
资产支持证券投资收益	6.4.7.17	-
贵金属投资收益	6.4.7.18	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-
股利收益	6.4.7.20	63,468,348.27
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-95,939,628.49
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	2,532.74
减：二、营业总支出		20,496,742.71
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	16,111,148.11
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,282,062.95
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 投资顾问费	6.4.10.2.1.1	-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.23	-
7. 税金及附加		59.44
8. 其他费用	6.4.7.24	103,472.21

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-58,855,029.89
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-58,855,029.89
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-58,855,029.89

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	6,348,186,797.73	-	78,600,313.23	6,426,787,110.96
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	6,348,186,797.73	-	78,600,313.23	6,426,787,110.96
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	8,083,680.88	-	-58,864,624.35	-50,780,943.47
（一）、综合收益总额	-	-	-58,855,029.89	-58,855,029.89
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减	8,083,680.88	-	-9,594.46	8,074,086.42

少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	8,083,680.88	-	-9,594.46	8,074,086.42
2. 基金赎回款	-	-	-	-
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值)	6,356,270,478.61	-	19,735,688.88	6,376,006,167.49

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

兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）（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》、《兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）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”）证监许可[2021]1694号文准予公开募集注册。本基金为契约型、开放式基金，存续期限为不定期。本基金首次设立募

集基金份额为 6,344,209,810.91 份，经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具了验资报告。基金合同于 2021 年 9 月 17 日正式生效。本基金的基金管理人为兴证全球基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

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及存托凭证（包括中小板、创业板以及其他中国证监会核准或注册发行的股票及存托凭证）、港股通标的股票、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的纯债部分）、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、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。

本基金的业绩比较基准为：中证偏股型基金指数收益率×20%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5%+中债综合（全价）指数收益率×75%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日和 2021 年 12 月 31 日的财务状况、自 2021 年 9 月 17 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

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

本基金自 2022 年度起执行了财政部发布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量（修订）》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移（修订）》、《企业会计准则第 24 号——套期会计（修订）》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报（修订）》（统称“新金融工具准则”）和 2022 年中国证监会发布的修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》。

(a) 新金融工具准则

根据财政部发布的新金融工具准则相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，本基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

新金融工具准则修订了财政部于 2006 年颁布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》和《企业会计准则第 24 号——套期保值》以及财政部于 2014 年修订的《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“原金融工具准则”）。

新金融工具准则将金融资产划分为三个基本分类：（1）以摊余成本计量的金融资产；（2）以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产；及（3）以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在新金融工具准则下，金融资产的分类是基于本基金管理金融资产的业务模式及该资产的合同现金流量特征而确定。新金融工具准则取消了原金融工具准则中规定的持有至到期投资、贷款和应收款项及可供出售金融资产三个分类类别。根据新金融工具准则，嵌入衍生工具不再从金融资产的主合同中分拆出来，而是将混合金融工具整体适用关于金融资产分类的相关规定。

新金融工具准则以“预期信用损失”模型替代了原金融工具准则中的“已发生损失”模型。“预期信用损失”模型要求持续评估金融资产的信用风险，因此在新金融工具准则下，本基金信用损失的确认时点早于原金融工具准则。

本基金按照新金融工具准则的衔接规定，对新金融工具准则施行日（即 2022 年 1 月 1 日）未终止确认的金融工具的分类和计量（含减值）进行追溯调整。本基金未调整比较财务报表数据，将金融工具的原账面价值和在新金融工具准则施行日的新账面价值之间的差额计入 2022 年年初留存收益或其他综合收益。

执行新金融工具准则对 2022 年 1 月 1 日本基金资产负债表各项目的的影响汇总如下：

(i) 金融工具的分类影响

以摊余成本计量的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金和应收利息，对应的账面价值分别为人民币 84,430,202.34 元、1,502,612.56 元、81,823.38 元和 2,852,565.82 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金和存出保证金，对应的账面价值分别为人民币 84,439,516.02 元、1,503,356.38 元和 81,863.86 元。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币 6,340,041,818.87 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币 6,342,884,286.71 元。

以摊余成本计量的金融负债

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为应付交易费用和其他负债，对应的账面价值分别为人民币 29,037.68 元和 100,000.00 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为其他负债，对应的账面价值分别为人民币 129,037.68 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等对应的应计利息余额均列示在应收利息或应付利息科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则，将上述应计利息分别转入银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》

本基金根据修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》编制财务报表时，调整了部分财务报表科目的列报和披露，未对财务报表列报和披露产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号）、财税[2014]81号文《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

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

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，其股息红利所得暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(e) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。对于基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	80,447,469.66
等于：本金	80,438,726.95
加：应计利息	8,742.71
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	80,447,469.66

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	153,661,365.79	-	149,011,906.12	-4,649,459.67
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	18,780.21	8,780,513.81	325,916.41
	银行间市场	339,110,880.00	6,336,120.55	346,536,120.55
	合计	347,546,697.19	6,354,900.76	355,316,634.36
资产支持证券	-	-	-	-
基金	5,816,471,780.41	-	5,771,860,203.80	44,611,576.61
其他	-	-	-	-
合计	6,317,679,843.39	6,354,900.76	6,276,188,744.28	47,845,999.87

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末各项买入返售金融资产余额为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未通过买断式逆回购交易取得债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本报告期末本基金无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本报告期内本基金未发生债权投资减值准备。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应收利息	-
其他应收款	614.52
待摊费用	-
合计	614.52

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	29,381.64
其中：交易所市场	29,381.64
银行间市场	-
应付利息	-
预提信息披露费	59,507.37
预提审计费用	29,752.78
合计	118,641.79

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,348,186,797.73	6,348,186,797.73
本期申购	8,083,680.88	8,083,680.88
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
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	6,356,270,478.61	6,356,270,478.61

注：申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	30,484,113.30	48,116,199.93	78,600,313.23
本期利润	37,084,598.60	-95,939,628.49	-58,855,029.89
本期基金份额交易产生的变动数	52,367.08	-61,961.54	-9,594.46
其中：基金申购款	52,367.08	-61,961.54	-9,594.46
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	67,621,078.98	-47,885,390.10	19,735,688.88

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	146,498.12
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	2,917.57
其他	833.78
合计	150,249.47

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-6,042,373.58
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	-6,042,373.58

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	36,890,786.82
减：卖出股票成本总额	42,831,322.12
减：交易费用	101,838.28
买卖股票差价收入	-6,042,373.58

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无证券出借差价收入。

6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	1,093,741,735.82
减：卖出/赎回基金成本总额	1,097,406,250.50
减：买卖基金差价收入应缴纳增值 税额	312.45
减：交易费用	540,743.17
基金投资收益	-4,205,570.30

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	3,571,126.23
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券 到期兑付）差价收入	607,727.13
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	4,178,853.36

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总 额	9,120,816.90
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成 本总额	8,497,354.31
减：应计利息总额	15,686.82
减：交易费用	48.64
买卖债券差价收入	607,727.13

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,147,371.57
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	62,320,976.70
合计	63,468,348.27

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	-95,939,628.49
股票投资	-17,426,344.76
债券投资	732,288.92
资产支持证券投资	-
基金投资	-79,245,572.65
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	-95,939,628.49

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	-
其他	2,532.74
合计	2,532.74

6.4.7.23 持有基金产生的费用

项目	本期费用 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期持有基金产生的应支付销售服务费(元)	128,086.83
当期持有基金产生的应支付管理费(元)	14,103,637.17
当期持有基金产生的应支付托管费(元)	3,462,131.91

6.4.7.24 信用减值损失

注：无。

6.4.7.25 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	6,712.06
账户维护费用	7,500.00
合计	103,472.21

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明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（“兴证全球基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金销售机构
兴业证券股份有限公司（“兴业证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：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 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
兴业证券	53,810,225.98	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 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
兴业证券	9,751,373.93	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 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
兴业证券	119,500,000.00	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 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期基金 成交总额的比例（%）
兴业证券	90,841,477.01	100.00

6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期内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 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
兴业证券	37,696.15	100.00	29,381.64	100.00

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	16,111,148.11
其中：支付销售机构的客户维护费	9,037,007.93

注：支付基金管理人兴证全球基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值（扣除投资于本基金管理人所管理的基金的部分）的 0.6%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金管理费} = \frac{\text{前一日基金资产净值} (\text{扣除投资于本基金管理人所管理的基金的部分}) \times 0.6\%}{\text{当年天数}}$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,282,062.95

注：支付基金托管人招商银行的基金托管费按前一日基金资产净值（扣除投资于本基金管理人所托管的基金的部分）的 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \frac{\text{前一日基金资产净值} (\text{扣除投资于本基金管理人所托管的基金的部分}) \times 0.15\%}{\text{当年天数}}$$

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：本基金在本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：本基金在本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

注：本基金在本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金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

注：除基金管理人之外的其他关联方在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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	80,447,469.66	146,498.12

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

注：本基金在本报告期内未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

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

于本报告期末，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人民币 926,851,198.49 元，占本基金资产净值的比例为 14.54%。

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

项目	本期费用 2022 年 1 月 1 日至 2022 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）	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	2,552.06
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	2,193,742.16
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	541,904.55

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。

根据本基金合同的约定，本基金管理人运用本基金基金财产申购自身管理的基金的（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不得收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并记入基金财产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金在本报告期内未进行过利润分配。

6.4.12 期末(2022 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300383	光环新网	2021 年 12 月 29 日	6 个月	非公开发行流通受限	11.79	10.42	678,541	7,999,998.39	7,070,397.22	-
300769	德方纳米	2022 年 5 月 17 日	6 个月	大宗交易购入流通受限	246.95	372.35	22,000	5,432,900.00	8,191,700.00	-
300834	星辉环材	2022 年 1 月 6 日	6 个月	新股流通受限	55.57	30.03	635	35,286.95	19,069.05	-
301102	兆讯传媒	2022 年 3 月 15 日	6 个月	新股流通受限	39.88	31.09	642	25,602.96	19,959.78	-
301103	何氏眼科	2022 年 3 月 14 日	6 个月	新股流通受限	42.50	32.02	390	16,575.00	12,487.80	-
301103	何氏眼科	2022 年 6 月 1 日	3-4 个月	新股流通受限-转增	-	32.02	117	-	3,746.34	注 1
301116	益客食品	2022 年 1 月 10 日	6 个月	新股流通受限	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-
301117	佳缘科技	2022 年 1 月 7 日	6 个月	新股流通受限	46.80	54.44	262	12,261.60	14,263.28	-
301181	标榜	2022 年	6 个月	新股流	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63	-

	股份	2月11日		通受限							
301196	唯科科技	2022年1月4日	6个月	新股流通受限	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92	-	
301200	大族数控	2022年2月18日	6个月	新股流通受限	76.56	51.92	857	65,611.92	44,495.44	-	
301207	华兰疫苗	2022年2月10日	6个月	新股流通受限	56.88	56.42	569	32,364.72	32,102.98	-	
301215	中汽股份	2022年2月28日	6个月	新股流通受限	3.80	6.39	4,743	18,023.40	30,307.77	-	
301233	盛帮股份	2022年6月24日	6个月	新股流通受限	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16	-	
301233	盛帮股份	2022年6月24日	1个月内(含)	新股流通受限	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36	-	
301237	和顺科技	2022年3月16日	6个月	新股流通受限	56.69	41.86	261	14,796.09	10,925.46	-	
301238	瑞泰新材	2022年6月10日	6个月	新股流通受限	19.18	32.07	3,497	67,072.46	112,148.79	-	
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	6个月	新股流通受限	33.65	33.65	575	19,348.75	19,348.75	-	
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	1个月内(含)	新股流通受限	33.65	33.65	5,172	174,037.80	174,037.80	-	
301256	华融化学	2022年3月14日	6个月	新股流通受限	8.05	10.08	1,831	14,739.55	18,456.48	-	
301286	侨源股份	2022年6月6日	6个月	新股流通受限	16.91	19.79	784	13,257.44	15,515.36	-	
600938	中国海油	2022年4月14日	6个月	新股流通受限	10.80	15.86	84,004	907,243.20	1,332,303.44	-	
688083	中望软件	2022年6月17日	6个月	询价转让流通受限	168.01	190.42	21,843	3,669,842.43	4,159,344.06	-	

688267	中触媒	2022 年 2 月 9 日	6 个月	新股流 通受限	41.90	31.90	3,390	142,041.00	108,141.00	-
688663	新风光	2022 年 6 月 8 日	6 个月	大宗交 易购入 流通受 限	29.88	30.36	140,000	4,183,200.00	4,250,400.00	-

注：1、本基金持有的新股流通受限股票何氏眼科，于 2022 年 6 月 1 日实施 2021 年年度权益分派方案，向全体股东每 10 股派发现金股利人民币 6.00 元（含税），同时，以资本公积金向全体股东每 10 股转增 3 股。本基金新增 117 股。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有临时停牌等流通受限证券。

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：本基金本报告期末无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、风险管理部和合规管理部以及审计部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

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（不含证券投资基金）市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券（不含证券投资基金），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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	8,780,513.81	11,537,754.10
AAA 以下	-	28,514.20
未评级	-	-
合计	8,780,513.81	11,566,268.30

注：此处的信用证券不包括国债、央票、政策性金融债券等非信用债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

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

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

本基金所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易。因此，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金为具有一定持有期的开放式基金，符合条件的其他投资者可在合同规定的开放日进行基金申购与赎回业务，本基金管理人针对基金特定的运作方式，建立了相应的流动性风险监控与预警机制。本基金管理人每日预测基金的流动性需求，通过独立的风险管理部门设置流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，并按照基金类型建立并定期开展专项的流动性压力测试工作，对流动性风险进行预警。本基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款及强制赎回费条款，同时控制每日确认的净赎回申请不超过本基金投资组合 7 个工作日可变现资产的可变现价值，减少赎回业务对本基金的流动性冲击，从而控制流动性风险。此外，本基金通过预留一定的现金头寸，并且可在需要时通过卖出回购金融资产方式借入短期资金，以缓解流动性风险。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 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	80,447,469.66	-	-	-	-	-	80,447,469.66
结算备付金	158,747.99	-	-	-	-	-	158,747.99
存出保证金	32,855.03	-	-	-	-	-	32,855.03
交易性金融资产	142,744,613.70	203,791,506.85	-	8,780,513.81	-	5,920,872,109.92	6,276,188,744.28

应收股利	-	-	-	-	-	78,942.74	78,942.74
应收申购款	1,799.82	-	-	-	-	23,165.33	24,965.15
应收清算款	-	-	-	-	-	22,566.51	22,566,510.17
其他资产	-	-	-	-	-	614.52	614.52
资产总计	223,385,486.20	203,791,506.85	-	8,780,513.81	-	5,943,541,342.68	6,379,498,849.54
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,662,896.94	2,662,896.94
应付托管费	-	-	-	-	-	711,103.50	711,103.50
应交税费	-	-	-	-	-	39.82	39.82
其他负债	-	-	-	-	-	118,641.79	118,641.79
负债总计	-	-	-	-	-	3,492,682.05	3,492,682.05
利率敏感度缺口	223,385,486.20	203,791,506.85	-	8,780,513.81	-	5,940,048,660.63	6,376,006,167.49
上年度末 2021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	84,430,202.34	-	-	-	-	-	84,430,202.34
结算备付金	1,502,612.56	-	-	-	-	-	1,502,612.56
存出保证金	81,823.38	-	-	-	-	-	81,823.38
交易性金融资产	-	-	339,626,000.00	11,537,754.10	28,514.20	5,988,849,550.57	6,340,041,818.87
应收申购款	22,880.42	-	-	-	-	287,089.74	309,970.16
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,252,033.48	1,252,033.48
其他资产	-	-	-	-	-	2,852,787.73	2,852,787.73
资产总计	86,037,518.70	-	339,626,000.00	11,537,754.10	28,514.20	5,993,241,461.52	6,430,471,248.52
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,810,844.50	2,810,844.50
应付托管费	-	-	-	-	-	744,178.31	744,178.31
应交税费	-	-	-	-	-	77.07	77.07

其他负债	-	-	-	-	-	129,037.68	129,037.68
负债总计	-	-	-	-	-	3,684,137.56	3,684,137.56
利率敏感度缺口	86,037,518.70	-	339,626,000.00	11,537,754.10	28,514.20	5,989,557,323.96	6,426,787,110.96

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他影响债券公允价值的变量保持不变，仅利率发生变动；		
	假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化(即平移收益率曲线)。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	市场利率-1%	384,166.49	2,051,899.35
	市场利率+1%	-383,122.34	-2,027,234.47

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险，主要是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。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，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其他价格风险，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，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

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 2022年6月30日		上年度末 2021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	149,011,906.12	2.34	178,863,882.69	2.78

交易性金融资产—基金投资	5,771,860,203.80	90.52	5,809,985,667.88	90.40
交易性金融资产—债券投资	355,316,634.36	5.57	351,192,268.30	5.46
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	6,276,188,744.28	98.43	6,340,041,818.87	98.65

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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准+10%	465,639,344.21	397,541,300.46
	业绩比较基准-10%	-465,639,344.21	-397,541,300.46

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

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

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	5,902,007,808.33	5,953,567,315.13
第二层次	348,705,336.73	339,631,504.49
第三层次	25,475,599.22	46,842,999.25
合计	6,276,188,744.28	6,340,041,818.87

注：根据中国证监会 2022 年 5 月 26 日发布的证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号《年度报告和中期报告》模板，本基金对上年度末公允价值层次进行追溯调整。

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（2021 年 12 月 31 日：无）。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
----	----	----	------------------

1	权益投资	149,011,906.12	2.34
	其中：股票	149,011,906.12	2.34
2	基金投资	5,771,860,203.80	90.48
3	固定收益投资	355,316,634.36	5.57
	其中：债券	355,316,634.36	5.57
	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	80,606,217.65	1.26
8	其他各项资产	22,703,887.61	0.36
9	合计	6,379,498,849.54	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	5,152,008.44	0.08
C	制造业	99,284,266.08	1.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	251,050.80	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	1,591,698.00	0.02
H	住宿和餐饮业	3,189,030.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,262,050.56	0.35
J	金融业	6,903,099.00	0.11
K	房地产业	3,490,672.00	0.05
L	租赁和商务服务业	19,959.78	0.00
M	科学研究和技术服务业	3,014,820.77	0.05
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	1,779,580.69	0.03
R	文化、体育和娱乐业	2,073,670.00	0.03
S	综合	-	-
	合计	149,011,906.12	2.34

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300769	德方纳米	22,000	8,191,700.00	0.13
2	300383	光环新网	678,541	7,070,397.22	0.11
3	000568	泸州老窖	19,500	4,807,530.00	0.08
4	000858	五粮液	23,700	4,785,741.00	0.08
5	688663	新风光	140,000	4,250,400.00	0.07
6	688083	中望软件	21,843	4,159,344.06	0.07
7	002920	德赛西威	28,100	4,158,800.00	0.07
8	603799	华友钴业	34,320	3,281,678.40	0.05
9	600754	锦江酒店	50,700	3,189,030.00	0.05
10	300760	迈瑞医疗	9,800	3,069,360.00	0.05
11	603259	药明康德	28,700	2,984,513.00	0.05
12	002415	海康威视	81,700	2,957,540.00	0.05
13	600521	华海药业	122,700	2,785,290.00	0.04
14	000001	平安银行	180,400	2,702,392.00	0.04
15	600690	海尔智家	96,100	2,638,906.00	0.04
16	688099	晶晨股份	24,754	2,500,154.00	0.04
17	600519	贵州茅台	1,200	2,454,000.00	0.04
18	600309	万华化学	25,300	2,453,847.00	0.04
19	300316	晶盛机电	36,200	2,446,758.00	0.04
20	603816	顾家家居	41,990	2,377,893.70	0.04
21	600048	保利发展	135,700	2,369,322.00	0.04
22	002555	三七互娱	110,800	2,352,284.00	0.04
23	601899	紫金矿业	247,400	2,308,242.00	0.04
24	300207	欣旺达	72,900	2,303,640.00	0.04
25	600460	士兰微	43,200	2,246,400.00	0.04
26	601318	中国平安	47,300	2,208,437.00	0.03
27	000786	北新建材	62,900	2,177,598.00	0.03
28	603517	绝味食品	36,700	2,121,994.00	0.03
29	300327	中颖电子	42,600	2,121,906.00	0.03
30	600315	上海家化	47,900	2,047,725.00	0.03
31	600885	宏发股份	48,860	2,044,791.00	0.03
32	000739	普洛药业	96,100	1,983,504.00	0.03
33	300482	万孚生物	48,000	1,954,080.00	0.03
34	002036	联创电子	124,100	1,906,176.00	0.03
35	600882	妙可蓝多	40,600	1,900,080.00	0.03

36	300638	广和通	71,700	1,899,333.00	0.03
37	600570	恒生电子	43,200	1,880,928.00	0.03
38	300496	中科创达	13,600	1,774,528.00	0.03
39	688005	容百科技	13,200	1,708,608.00	0.03
40	002390	信邦制药	232,200	1,604,502.00	0.03
41	002120	韵达股份	93,300	1,591,698.00	0.02
42	002138	顺络电子	57,800	1,575,050.00	0.02
43	600763	通策医疗	9,000	1,569,960.00	0.02
44	600299	安迪苏	161,800	1,550,044.00	0.02
45	002508	老板电器	43,000	1,549,290.00	0.02
46	300188	美亚柏科	114,500	1,543,460.00	0.02
47	600161	天坛生物	63,300	1,536,924.00	0.02
48	600760	中航沈飞	25,400	1,535,430.00	0.02
49	300724	捷佳伟创	16,900	1,510,015.00	0.02
50	002250	联化科技	89,800	1,470,026.00	0.02
51	603486	科沃斯	12,000	1,462,680.00	0.02
52	300144	宋城演艺	93,800	1,439,830.00	0.02
53	600809	山西汾酒	4,300	1,396,640.00	0.02
54	600862	中航高科	49,500	1,390,950.00	0.02
55	600938	中国海油	84,004	1,332,303.44	0.02
56	601688	华泰证券	93,000	1,320,600.00	0.02
57	601857	中国石油	215,200	1,140,560.00	0.02
58	000002	万科 A	54,700	1,121,350.00	0.02
59	600398	海澜之家	224,400	1,065,900.00	0.02
60	600703	三安光电	32,200	791,476.00	0.01
61	002064	华峰化学	82,300	694,612.00	0.01
62	300454	深信服	6,400	664,192.00	0.01
63	300413	芒果超媒	19,000	633,840.00	0.01
64	603833	欧派家居	3,300	497,244.00	0.01
65	002182	云海金属	17,700	443,916.00	0.01
66	000983	山西焦煤	27,700	370,903.00	0.01
67	300059	东方财富	14,300	363,220.00	0.01
68	002402	和而泰	19,000	362,140.00	0.01
69	002049	紫光国微	1,800	341,496.00	0.01
70	300750	宁德时代	600	320,400.00	0.01
71	601166	兴业银行	15,500	308,450.00	0.00
72	600660	福耀玻璃	7,300	305,213.00	0.00
73	600941	中国移动	5,000	302,500.00	0.00
74	600426	华鲁恒升	10,300	300,760.00	0.00
75	603883	老百姓	7,410	251,050.80	0.00
76	301239	普瑞眼科	5,747	193,386.55	0.00
77	301238	瑞泰新材	3,497	112,148.79	0.00

78	688267	中触媒	3,390	108,141.00	0.00
79	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.00
80	301200	大族数控	857	44,495.44	0.00
81	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
82	301207	华兰疫苗	569	32,102.98	0.00
83	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.00
84	301102	兆讯传媒	642	19,959.78	0.00
85	300834	星辉环材	635	19,069.05	0.00
86	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
87	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
88	301286	侨源股份	784	15,515.36	0.00
89	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
90	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
91	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
92	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
93	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
94	301181	标榜股份	257	7,861.63	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	300769	德方纳米	5,432,900.00	0.08
2	688663	新风光	4,183,200.00	0.07
3	688083	中望软件	3,669,842.43	0.06
4	688220	翱捷科技	2,035,524.34	0.03
5	600938	中国海油	1,296,054.00	0.02
6	688223	晶科能源	1,065,000.00	0.02
7	000739	普洛药业	878,638.00	0.01
8	301238	瑞泰新材	670,647.88	0.01
9	301200	大族数控	655,812.96	0.01
10	688234	天岳先进	559,577.61	0.01
11	601857	中国石油	499,460.00	0.01
12	002064	华峰化学	498,867.00	0.01
13	002508	老板电器	497,525.00	0.01
14	300454	深信服	496,693.00	0.01
15	002415	海康威视	373,478.00	0.01
16	002402	和而泰	372,456.00	0.01
17	000001	平安银行	370,515.00	0.01
18	000983	山西焦煤	367,302.00	0.01
19	300059	东方财富	364,364.00	0.01
20	300327	中颖电子	357,022.00	0.01

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	300793	佳禾智能	7,823,381.45	0.12
2	002938	鹏鼎控股	5,538,704.00	0.09
3	300451	创业慧康	4,993,608.60	0.08
4	002607	中公教育	4,638,956.00	0.07
5	002851	麦格米特	3,288,119.00	0.05
6	688223	晶科能源	2,221,868.08	0.03
7	301238	瑞泰新材	1,055,404.38	0.02
8	688220	翱捷科技	1,032,097.25	0.02
9	600938	中国海油	580,160.11	0.01
10	688234	天岳先进	555,868.00	0.01
11	301200	大族数控	523,778.25	0.01
12	688110	东芯股份	505,930.72	0.01
13	301215	中汽股份	427,959.00	0.01
14	301207	华兰疫苗	385,876.24	0.01
15	688306	均普智能	304,576.54	0.00
16	300834	星辉环材	290,242.12	0.00
17	301256	华融化学	257,195.97	0.00
18	688270	臻镭科技	229,416.06	0.00
19	301102	兆讯传媒	201,544.00	0.00
20	301286	侨源股份	194,439.74	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	30,405,690.31
卖出股票收入（成交）总额	36,890,786.82

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	346,536,120.55	5.44
	其中：政策性金融债	346,536,120.55	5.44
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）	8,780,513.81	0.14
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	355,316,634.36	5.57

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	210211	21 国开 11	1,400,000	142,744,613.70	2.24
2	210407	21 农发 07	1,200,000	122,292,328.77	1.92
3	210306	21 进出 06	800,000	81,499,178.08	1.28
4	113044	大秦转债	32,240	3,516,032.57	0.06
5	132026	G 三峡 EB2	17,050	1,910,394.11	0.03

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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 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 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

本基金作为一只稳健型的养老目标 FOF 基金，在风控策略上将相对收益风险、子基金风格漂移风险及整体流动性风险进行重点控制。

相对收益风险方面，本基金将从持仓角度出发，根据所投资基金最新的定期报告数据，衡量本基金与业绩比较基准在底层资产配置、行业配置等维度上的偏离方向和幅度；同时从净值角度

出发，定期跟踪本基金净值相对于业绩比较基准的贝塔值、跟踪误差等指标，监控净值偏离风险。

子基金风格飘移风险方面，本基金不会持有风格不够清晰稳定的基金品种。若持仓基金因为基金经理变更或者其他原因导致基金投资风格的变化，则本基金将重新评估该基金品种或基金经理，从而决定是否继续持有该基金。

整体流动性风险方面，本基金将通过严格控制封闭运作的基金、定期开放基金等流动受限基金的投资比例，有效控制流动性风险。

7.12.2 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	003949	兴全稳泰债券 A	契约型开放式	623,010,898.64	696,401,582.50	10.92	是
2	000032	易方达信用债券 A	契约型开放式	207,921,873.05	232,061,602.51	3.64	否
3	040040	华安纯债债券 A	契约型开放式	213,672,667.90	230,766,481.33	3.62	否
4	002650	东方红稳添利纯债债券 A	契约型开放式	211,856,359.23	230,648,018.29	3.62	否
5	003327	万家鑫璟纯债债券 A	契约型开放式	191,155,399.22	229,979,060.80	3.61	否
6	040026	华安信用四季红债券 A	契约型开放式	210,844,608.31	222,567,568.53	3.49	否

7	002169	永赢稳益债券	契约 型开 放式	166,771,227.98	181,263,647.69	2.84	否
8	007321	鹏华金利债券	契约 型开 放式	134,407,839.12	139,085,231.92	2.18	否
9	006874	创金合信恒兴 中短债债券 A	契约 型开 放式	119,309,765.80	138,960,084.23	2.18	否
10	004200	博时富瑞纯债 债券 A	契约 型开 放式	132,277,779.25	138,878,440.43	2.18	否
11	006591	广发景明中短 债 A	契约 型开 放式	134,172,670.41	138,479,613.13	2.17	否
12	000305	中银中高等级 债券 A	契约 型开 放式	127,322,615.64	134,567,272.47	2.11	否
13	006884	添富 AAA 级信 用纯债 A	契约 型开 放式	113,140,334.99	127,520,471.57	2.00	否
14	519782	交银裕隆纯债 债券 A	契约 型开 放式	96,716,292.73	124,232,078.01	1.95	否
15	000191	富国信用债债 券 A	契约 型开 放式	86,146,623.02	103,341,488.97	1.62	否
16	159920	恒生 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	87,015,300.00	103,113,130.50	1.62	否
17	100058	富国产业债债 券 A	契约 型开 放式	87,443,983.30	103,061,478.72	1.62	否
18	513500	博时标普 500ETF(QDII)	交易 型开	84,491,500.00	100,967,342.50	1.58	否

			放式 (ETF)				
19	004705	南方祥元债券 A	契约 型开 放式	89,937,320.48	100,244,137.41	1.57	否
20	004042	华夏鼎茂债券 A	契约 型开 放式	76,516,748.85	92,868,378.08	1.46	否
21	007616	富国投资级信 用债债券 A	契约 型开 放式	90,012,084.49	92,811,460.32	1.46	否
22	003280	鹏华丰恒债券	契约 型开 放式	81,961,403.04	90,764,057.73	1.42	否
23	002245	泰康稳健增利 债券 A	契约 型开 放式	66,715,740.02	87,797,913.87	1.38	否
24	510900	易方达恒生国 企(QDII-ETF)	交易 型开 放式 (ETF)	97,769,500.00	84,668,387.00	1.33	否
25	000205	易方达投资级 信用债债券 A	契约 型开 放式	72,495,794.44	83,370,163.61	1.31	否
26	100032	富国中证红利 指数增强 A	契约 型开 放式	72,244,448.18	76,868,092.86	1.21	否
27	004388	鹏华丰享债券	契约 型开 放式	64,019,245.97	74,806,488.92	1.17	否
28	164808	工银四季收益 债券(LOF)	上市 契约 型开 放式 (LOF)	67,884,372.57	74,387,695.46	1.17	否
29	001235	中银国有企业	契约	64,259,584.38	69,734,500.97	1.09	否

		债 A	型开 放式				
30	004417	兴全货币 B	契约 型开 放式	65,446,040.87	65,446,040.87	1.03	是
31	000628	大成高新技术 产业股票 A	契约 型开 放式	17,006,519.27	60,594,228.16	0.95	否
32	450009	国富中小盘股 票	契约 型开 放式	22,952,945.68	59,861,282.33	0.94	否
33	166009	中欧新动力混 合(LOF)A	上市 契约 型开 放式 (LOF)	16,143,083.92	55,964,843.33	0.88	否
34	004127	鹏华丰康债券	契约 型开 放式	48,418,669.75	55,052,027.51	0.86	否
35	005577	交银丰晟收益 债券 A	契约 型开 放式	47,941,203.08	54,676,942.11	0.86	否
36	004027	广发景源纯债 A	契约 型开 放式	52,991,114.38	54,591,446.03	0.86	否
37	001040	新华策略精选 股票	契约 型开 放式	25,019,775.36	52,486,484.75	0.82	否
38	002186	国联安鑫享灵 活配置混合 C	契约 型开 放式	42,724,087.84	51,555,156.80	0.81	否
39	002462	中银珍利混合 C	契约 型开 放式	42,408,821.03	51,357,082.27	0.81	否
40	004761	国寿安保稳瑞 混合 C	契约 型开	40,201,925.15	51,257,454.57	0.80	否

			放式				
41	004280	国寿安保稳荣混合 C	契约型开放式	44,297,849.68	50,938,097.35	0.80	否
42	007663	平安安享灵活配置混合 C	契约型开放式	38,798,722.04	50,578,014.05	0.79	否
43	006852	永赢迅利中高等级短债债券 A	契约型开放式	48,201,997.83	50,424,109.93	0.79	否
44	003223	广发景丰纯债债券	契约型开放式	45,756,529.86	50,236,094.13	0.79	否
45	002076	浙商中证 500 指数增强 A	契约型开放式	29,014,680.80	47,923,548.28	0.75	否
46	000186	华泰柏瑞季季红债券	契约型开放式	43,912,905.00	46,964,851.90	0.74	否
47	163417	兴全合宜混合 (LOF) A	上市契约型开放式 (LOF)	26,112,862.00	44,543,320.00	0.70	是
48	512800	华宝中证银行 ETF	交易型开放式 (ETF)	35,160,900.00	40,118,586.90	0.63	否
49	005313	万家中证 1000 指数 A	契约型开放式	29,595,350.23	38,163,204.12	0.60	否
50	003376	广发中债 7-10 年国开债指数 A	契约型开放式	30,683,406.57	37,400,004.27	0.59	否
51	005354	富国沪港深行业精选灵活配	契约型开	26,368,630.53	35,658,299.07	0.56	否

		置混合型发起式 A	开放式				
52	006567	中泰星元灵活配置混合 A	契约型开放式	13,211,291.68	32,843,271.12	0.52	否
53	090007	大成策略回报混合	契约型开放式	27,192,994.53	29,341,241.10	0.46	否
54	006039	国富估值优势混合	契约型开放式	11,301,313.90	25,494,634.03	0.40	否
55	000471	富国城镇发展股票	契约型开放式	8,978,469.82	22,383,325.26	0.35	否
56	260112	景顺长城能源基建混合	契约型开放式	11,172,625.69	20,043,690.49	0.31	否
57	007593	鹏扬中证 500 质量成长指数 A	契约型开放式	10,991,672.72	19,976,266.00	0.31	否
58	007143	国投瑞银沪深 300 指数量化增强 A	契约型开放式	13,459,167.38	19,264,106.27	0.30	否
59	515780	浦银安盛 MSCI 中国 A 股 ETF	交易型开放式 (ETF)	12,715,200.00	19,199,952.00	0.30	否
60	163412	兴全轻资产混合 (LOF)	上市契约型开放式 (LOF)	5,588,580.12	18,442,314.40	0.29	是
61	007449	兴全多维价值混合 A	契约型开放式	9,678,668.22	18,324,622.54	0.29	是
62	340006	兴全全球视野	契约	6,206,387.03	17,762,059.04	0.28	是

		股票	型开放式				
63	007149	南方初元中短债债券 A	契约型开放式	15,574,165.58	17,170,517.55	0.27	否
64	340007	兴全社会责任混合	契约型开放式	3,298,153.03	16,840,369.37	0.26	是
65	340008	兴全有机增长混合	契约型开放式	4,347,920.60	16,804,713.12	0.26	是
66	163415	兴全商业模式优选混合 (LOF)	上市契约型开放式 (LOF)	2,853,600.00	9,610,924.80	0.15	是
67	163409	兴全绿色投资混合 (LOF)	上市契约型开放式 (LOF)	4,471,395.00	9,220,016.49	0.14	是
68	512170	华宝中证医疗 ETF	交易型开放式 (ETF)	14,528,900.00	8,426,762.00	0.13	否
69	518880	华安黄金易 (ETF)	交易型开放式 (ETF)	1,848,800.00	7,058,718.40	0.11	否
70	001821	兴全天添益货币 B	契约型开放式	5,040,465.08	5,040,465.08	0.08	是
71	501079	大成科创主题 3 年封闭混合	契约型开放式	1,768,835.00	3,873,748.65	0.06	否
72	163417	兴全合宜	上市	1,986,800.00	3,343,784.40	0.05	是

			契约 型开 放式 (LOF)				
73	512720	国泰中证计算 机主题 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	3,050,200.00	3,321,667.80	0.05	否
74	169106	东证创优	上市 契约 型开 放式 (LOF)	3,128,421.00	3,037,696.79	0.05	否
75	510170	国联安商品 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	674,800.00	2,533,199.20	0.04	否
76	163409	兴全绿色	上市 契约 型开 放式 (LOF)	1,062,400.00	2,177,920.00	0.03	是
77	512160	MSCI 中国 A 股国际通 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	1,295,800.00	2,065,505.20	0.03	否
78	501085	财通科创主题 3 年封闭运作 灵活配置混合	契约 型开 放式	1,036,300.00	1,830,105.80	0.03	否
79	163415	兴全模式	上市 契约 型开 放式 (LOF)	526,863.00	1,759,195.56	0.03	是
80	160726	嘉实瑞享	上市 契约 型开	1,206,100.00	1,263,992.80	0.02	否

			放式 (LOF)				
81	163412	兴全轻资	上市 契约 型开 放式 (LOF)	323,600.00	1,060,760.80	0.02	是
82	513090	易方达中证香 港证券投资主 题 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	735,000.00	845,985.00	0.01	否
83	501095	中银证券科技 创新 3 年封闭 混合	契约 型开 放式	490,600.00	498,940.20	0.01	否
84	501083	银华科创主题 3 年封闭混合	上市 契约 型开 放式 (LOF)	285,914.00	478,334.12	0.01	否
85	501088	嘉实瑞虹三年 定期混合	上市 契约 型开 放式 (LOF)	202,788.00	247,806.94	0.00	否
86	501080	中金科创主题 混合	上市 契约 型开 放式 (LOF)	112,300.00	193,492.90	0.00	否
87	163407	兴全沪深 300 指数(LOF)A	上市 契约 型开 放式 (LOF)	30,600.00	73,109.52	0.00	是

7.13 投资组合报告附注

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

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

7.13.2 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。

7.13.3 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	32,855.03
2	应收清算款	22,566,510.17
3	应收股利	78,942.74
4	应收利息	-
5	应收申购款	24,965.15
6	其他应收款	614.52
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,703,887.61

7.13.4 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	113044	大秦转债	3,516,032.57	0.06
2	128129	青农转债	1,687,378.62	0.03
3	110053	苏银转债	1,666,708.51	0.03

7.13.5 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	300769	德方纳米	8,191,700.00	0.13	大宗交易购入流通受限
2	300383	光环新网	7,070,397.22	0.11	非公开发行流通受限
3	688663	新风光	4,250,400.00	0.07	大宗交易购入流通受限
4	688083	中望软件	4,159,344.06	0.07	询价转让流通受限

7.13.6 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（%）
53,907	117,911.78	69,298,800.43	1.09	6,286,971,678.18	98.91

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	298,596.08	0.0047

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021年9月17日）基金份额总额	6,344,209,810.91
本报告期期初基金份额总额	6,348,186,797.73
本报告期基金总申购份额	8,083,680.88
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	6,356,270,478.61

§ 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重大人事变动。

2022 年 1 月 21 日起，董承非先生离任公司副总经理；2022 年 1 月 28 日起，谢治宇先生任职公司副总经理；2022 年 6 月 30 日起，秦杰先生任职公司副总经理，郑文惠女士离任公司副总经理。

(2) 报告期内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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

1、报告期内，本基金持有的华安智联混合型证券投资基金（LOF）由华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金封闭运作期届满转型而成。根据该基金基金合同约定，该基金的封闭运作期于 2022 年 6 月 13 日届满，该基金自 2022 年 6 月 14 日起自动转为上市开放式基金（LOF），并接受场外、场内申购赎回，基金名称变更为“华安智联混合型证券投资基金（LOF）”。该基金更名后，场内简称变更为“华安智联”，场内扩位简称变更为“华安智联 LOF”，场外简称变更为“华安智联混合（LOF）”，基金代码仍为 501073。

2、报告期内，本基金持有的万家科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）由万家科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金封闭运作期届满后更名而来。该基金更名后，场内简称仍为“科创主题”，扩位证券简称变更为“科创主题 LOF”，场外简称变更为“万家科创主题灵活配置混合（LOF）”，A 类基金代码仍为 501075，C 类基金代码仍为 007501。

3、报告期内，本基金持有的鹏华创新动力灵活配置混合型证券投资基金（LOF），根据《鹏华科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的约定，鹏华科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的封闭运作期为基金合同生效日（包括基金合同生效日）起至三年后的年度对日前一日止，封闭运作期于 2022 年 6 月 9 日届满，自 2022 年 6 月 10 日起自动转为上市开放式基金（LOF）并开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务，二级市场交易仍照常办理，基金名称变更为“鹏华创新动力灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”，场外简称变更为“鹏华创新动力混合（LOF）”，场内简称变更为“创新动力”，场内扩位证券简称变更为“鹏华创新动力 LOF”，基金代码仍为 501076。

4、报告期内，本基金持有的富国创新企业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）由富国科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金封闭运作期届满后更名而来。根据该基金基金合

同约定，该基金的封闭运作期于 2022 年 6 月 12 日届满，自 2022 年 6 月 13 日起自动转为上市开放式基金（LOF），并开始接受场外、场内申购赎回，基金名称变更为“富国创新企业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”。该基金更名后，场内简称仍为“科创富国”，场外简称变更为“富国创新企业灵活配置混合（LOF）”，A 类基金份额（即新增 C 类基金份额后由原本基金的基金份额全部自动延续而来）代码仍为 501077。自 2022 年 6 月 13 日起增加 C 类基金份额，C 类基金份额的基金代码为 015849。

5、报告期内，本基金持有的广发科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）由广发科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金封闭运作期届满开放后更名而来。根据《广发科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的约定，基金合同生效后前三年为封闭运作期，封闭运作期于 2022 年 6 月 12 日届满，自 2022 年 6 月 13 日起进入开放期，开放日常申购、赎回、转换和定投业务，二级市场交易和跨系统转托管业务仍照常办理，基金名称变更为“广发科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”，基金简称变更为“广发科创主题灵活配置混合（LOF）”，场内简称仍为“科创配置”，扩位证券简称仍为“科创配置 LOF”，基金代码仍为 501078。

6、报告期内，本基金持有的中欧科创主题混合型证券投资基金（LOF）由中欧科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金封闭运作期届满开放后更名而来。根据《中欧科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的约定，基金合同生效后的前三年为封闭运作期，封闭运作期于 2022 年 6 月 27 日届满，自 2022 年 6 月 28 日起进入开放期，开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务，二级市场交易仍照常办理，基金名称变更为“中欧科创主题混合型证券投资基金（LOF）”，基金场外简称变更为“中欧科创主题混合（LOF）”，场内简称仍为“科创中欧”，扩位证券简称变更为“科创中欧 LOF”，基金代码仍为 501081。

7、报告期内，本基金持有的博时科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金，按照该基金基金合同及招募说明书的约定，其封闭期自 2019 年 06 月 27 日至 2022 年 06 月 26 日止，自 2022 年 06 月 27 日起转换为上市开放式基金（LOF），转换后更名为“博时科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”，场外简称变更为“博时科创主题灵活配置混合 A”，场内简称、场内扩位简称与基金代码不变，场内简称为“科创投资”，场内扩位简称为“科创投资 LOF”，基金代码为 501082。

10.6 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。

10.7 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	4	53,810,225.98	100.00	37,696.15	100.00	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	4	-	-	-	-	-
国都证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
摩根大通证券	2	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-

中国中金 财富证券	4	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	4	-	-	-	-	-
中信建投 证券	5	-	-	-	-	-
中信证券	5	-	-	-	-	-

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	9,751,373.93	100.00	119,500,000.00	100.00	-	-	90,841,477.01	100.00
安信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
渤海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方 财富	-	-	-	-	-	-	-	-
东方 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国都 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰	-	-	-	-	-	-	-	-

君安								
国信 证券								
华创 证券								
华福 证券								
华泰 证券								
华西 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								
银河 证券								
招商 证券								
中国 中金 财富 证券								
中金 公司								
中泰 证券								
中信 建投								

证券								
中信 证券								

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	关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则工作的公告	证券日报、规定互联网网站	2022-01-05
2	关于调整旗下部分基金单笔最低交易限额的公告	证券日报、规定互联网网站	2022-01-06
3	关于副总经理离任的公告	证券日报、规定互联网网站	2022-01-21
4	关于我司旗下基金参与腾安基金销售赎回费率优惠活动的公告	证券日报、规定互联网网站	2022-01-26
5	关于使用自有资金自购旗下偏股型公募基金壹亿元的公告	证券日报、规定互联网网站	2022-01-27
6	关于公司副总经理任职的公告	证券日报、规定互联网网站	2022-01-28
7	关于增加德邦证券为旗下部分基金销售机构的公告	证券日报、规定互联网网站	2022-03-15
8	关于增加财达证券为旗下部分基金销售机构的公告	证券日报、规定互联网网站	2022-04-11
9	关于增加兴业银行为旗下部分基金销售机构的公告	证券日报、规定互联网网站	2022-05-06
10	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	证券日报、规定互联网网站	2022-06-17
11	关于公司副总经理变更的公告	证券日报、规定互联网网站	2022-06-30

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，故不涉及本项特有风险。
--

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

2、“赎回份额”包含份额赎回、转换转出等导致投资者持有份额减少的情形。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金为养老目标基金，致力于满足投资者的养老资金理财需求，但养老目标基金并不代表收益保障或其他任何形式的收益承诺，存在投资者承担亏损的可能性。

2、本基金每份基金份额的最短持有期限为 1 年。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 1 年（1 年指 365 天，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 1 年内无法赎回的风险。

3、本基金投资范围包括北交所上市的股票。基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于北交所上市股票或选择不将基金资产投资于北交所上市股票，基金资产并非必然投资北交所上市股票。基金管理人提醒投资者注意基金因投资北交所上市股票所带来的风险：北交所上市企业为创新型中小企业，普遍具有初创性、技术新、研发投入大、前景不确定、业绩波动大、风险高等特征，相对于沪深交易所上市企业，北交所上市企业的经营风险、盈利风险、技术风险、流动性风险、退市风险、股价大幅波动风险等整体上更为突出，且在北交所投资还存在市场制度、交易规则等差异可能带来的风险。基金投资北交所上市股票的特有风险包括但不限于流动性风险、转板风险、投资集中风险、退市风险、股价大幅波动风险、投资战略配售股票风险、政策风险等。

4、根据《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》（财会〔2020〕22 号）等有关规定，兴证全球基金管理有限公司（以下简称“本公司”）旗下管理的公开募集证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具相关会计准则。执行新会计准则后，本公司旗下公开募集证券投资基金将按照新金融工具相关会计准则的规定进行会计计量。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会准予兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）募集注

册的文件；

- 2、《兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》；
- 3、《兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议》；
- 4、关于申请募集注册兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）的法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

12.3 查阅方式

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

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

兴证全球基金管理有限公司

2022 年 8 月 31 日