

兴全绿色投资混合型证券投资基金  
(LOF)  
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 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：2024 年 3 月 29 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。本年度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 2024 年 03 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。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>17</b>
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 净资产变动表	19
7.4 报表附注	22
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>52</b>
8.1 期末基金资产组合情况	52

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	53
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	55
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	57
8.6 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 .....	57
8.7 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 .....	58
8.8 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 .....	58
8.9 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 .....	58
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	58
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	58
8.14 投资组合报告附注 .....	58
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>59</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	59
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	59
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	59
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	59
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	60
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>60</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>60</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	60
11.2 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
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	60
11.4 基金投资策略的改变 .....	60
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	60
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	60
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	61
11.8 其他重大事件 .....	62
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>63</b>
12.1 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 .....	63
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	63
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>63</b>
13.1 备查文件目录 .....	63
13.2 存放地点 .....	64
13.3 查阅方式 .....	64

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）
基金简称	兴全绿色投资混合（LOF）
场内简称	兴全绿色
基金主代码	163409
前端交易代码	163409
后端交易代码	163410
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2011 年 5 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	4,340,452,405.65 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011 年 7 月 7 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过挖掘绿色科技产业或公司，以及其他产业中积极履行环境责任公司的投资机会，力争实现当期投资收益与长期资本增值。
投资策略	本基金在大类资产配置上，采取定性与定量研究相结合，在股票与债券等资产类别之间进行资产配置。在宏观与微观层面对各类资产的价值增长能力展开综合评估，动态优化资产配置。在运用“绿色投资筛选策略”的基础上，采用环境因子与公司财务等基本面因子相结合，进行综合评估筛选，对那些表现相对突出的公司予以优先考虑。
业绩比较基准	80%×中证兴业证券 ESG 盈利 100 指数收益率+20%×中证国债指数收益率
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，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，属于中高预期风险、中高预期收益的基金产品。投资者可在二级市场买卖基金份额，受市场供需关系等各种因素的影响，投资者买卖基金份额有可能面临相应的折溢价风险。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		兴证全球基金管理有限公司	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	021-20398988	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 28-29 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	杨华辉	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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.xqfunds.com">http://www.xqfunds.com</a>
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市延安东路 222 号 30 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	-589,738,352.70	-1,807,992,487.70	1,044,061,298.95
本期利润	-945,152,127.85	-2,889,704,727.79	1,559,551,681.24
加权平均基金份额本期利润	-0.2459	-0.8195	0.5302
本期加权平均净值利润率	-17.18%	-41.47%	23.35%
本期基金份额净值增长率	-16.86%	-30.25%	29.91%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末

期末可供分配利润	474,926,716.35	2,157,328,339.98	5,507,001,744.54
期末可供分配基金份额利润	0.1094	0.7364	1.3142
期末基金资产净值	4,815,379,122.00	5,086,938,100.02	10,429,307,554.84
期末基金份额净值	1.109	1.736	2.489
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	226.51%	292.73%	463.08%

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率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
过去三个月	-6.96%	1.04%	-5.61%	0.67%	-1.35%	0.37%
过去六个月	-16.30%	1.00%	-8.08%	0.69%	-8.22%	0.31%
过去一年	-16.86%	0.97%	-10.19%	0.67%	-6.67%	0.30%
过去三年	-24.67%	1.19%	-32.02%	0.93%	7.35%	0.26%
过去五年	82.91%	1.25%	10.22%	0.99%	72.69%	0.26%
自基金合同生效起至今	226.51%	1.42%	17.79%	1.10%	208.72%	0.32%

注：本基金原业绩比较基准为：80%×沪深 300 指数收益率+20%×中证国债指数收益率，修改后的业绩比较基准为：80%×中证兴业证券 ESG 盈利 100 指数收益率+20%×中证国债指数收益率，

修改后的业绩比较基准生效日为 2020 年 9 月 10 日。

中证兴业证券 ESG 盈利 100 指数由中证指数有限公司发布，它从沪深 300 指数成分股中选取了在环境（E）、社会责任（S）和公司治理水平（G）方面处于行业前列，且盈利能力突出的 100 只上市公司股票。该指数成分股均为有代表性的绿色企业，能够反映国内绿色产业发展趋势，也与本基金的绿色投资方向高度契合，适合作为本基金股票投资业绩比较基准。中证国债指数由中证指数有限公司发布，该指数样本券由剩余年限 1 年及以上且在沪深交易所或银行间市场上市的国债构成，能够反映全市场相应期限国债的表现，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：

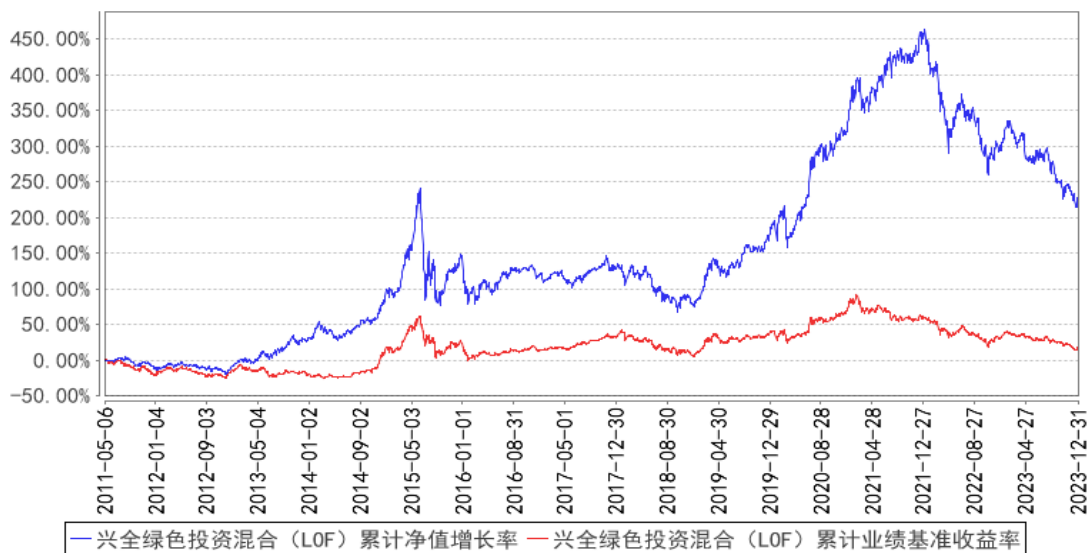
$$\text{Return } t = 80\% \times (\text{中证兴业证券 ESG 盈利 100 指数收益率 } t / \text{中证兴业证券 ESG 盈利 100 指数收益率 } t-1 - 1) + 20\% \times (\text{中证国债指数收益率 } t / \text{中证国债指数收益率 } t-1 - 1)$$

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

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

兴全绿色投资混合（LOF）累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、净值表现所取数据截至到 2023 年 12 月 31 日。

2、按照《兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）基金合同》的规定，本基金建仓期为 2011 年 5 月 6 日至 2011 年 8 月 5 日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

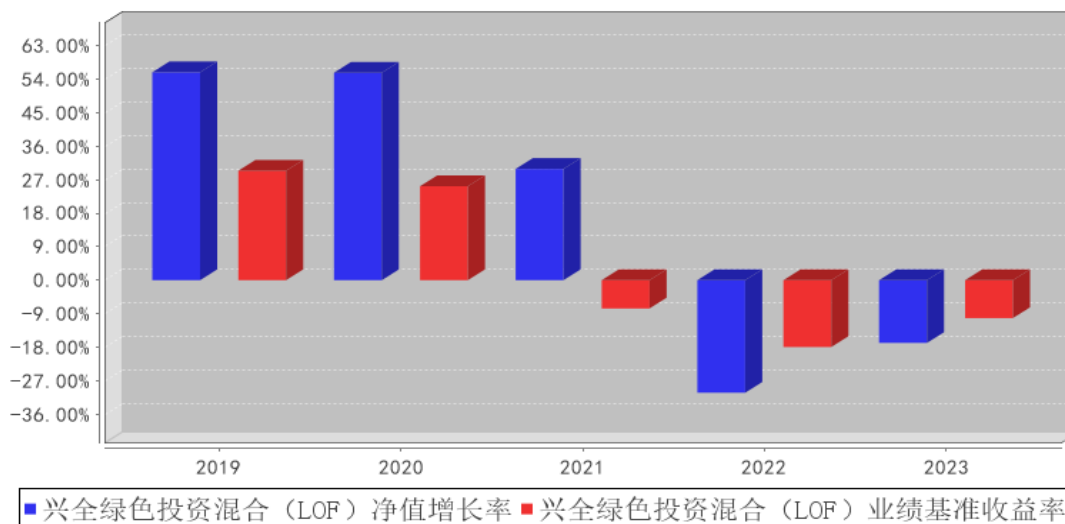
3、本基金原业绩比较基准为：80%×沪深 300 指数收益率+20%×中证国债指数收益率，修改



后的业绩比较基准为： $80\% \times$  中证兴业证券 ESG 盈利 100 指数收益率  $+ 20\% \times$  中证国债指数收益率，修改后的业绩比较基准生效日为 2020 年 9 月 10 日。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴全绿色投资混合（LOF）基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金原业绩比较基准为： $80\% \times$  沪深 300 指数收益率  $+ 20\% \times$  中证国债指数收益率，修改后的业绩比较基准为： $80\% \times$  中证兴业证券 ESG 盈利 100 指数收益率  $+ 20\% \times$  中证国债指数收益率，修改后的业绩比较基准生效日为 2020 年 9 月 10 日。

### 3.3 其他指标

注：无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2023 年	3.9351	1,310,971,117.96	350,943,861.73	1,661,914,979.69	
合计	3.9351	1,310,971,117.96	350,943,861.73	1,661,914,979.69	

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

兴证全球基金管理有限公司（成立时名为“兴业基金管理有限公司”，以下简称“公司”）经证监基金字[2003]100 号文批准于 2003 年 9 月 30 日成立。2008 年 1 月，中国证监会批复（证监许可[2008]6 号），同意全球人寿保险国际公司（AEGON International B.V）受让公司股权并成

为公司股东。2008 年 4 月 9 日，公司完成股权转让、变更注册资本等相关手续后，公司注册资本由 9800 万元变更为人民币 1.2 亿元，其中兴业证券股份有限公司的出资占注册资本的 51%，全球人寿保险国际公司的出资占注册资本的 49%。2008 年 7 月，经中国证监会批准（证监许可[2008]888 号），公司于 2008 年 8 月 25 日完成变更公司名称、注册资本等相关手续后，公司名称变更为“兴业全球基金管理有限公司”，注册资本增加为 1.5 亿元人民币，其中两股东出资比例不变。2016 年 12 月 28 日，因公司发展需要，公司名称变更为“兴全基金管理有限公司”。2020 年 3 月 18 日，公司名称变更为“兴证全球基金管理有限公司”。

截至 2023 年 12 月 31 日，公司旗下已管理兴全可转债混合型证券投资基金等共 65 只基金，包括股票型、混合型、债券型、货币型、指数型、FOF 等类型。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邹欣	兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理	2017 年 6 月 29 日	-	14 年	硕士，历任富国基金管理有限公司研究员，泰达宏利基金管理有限公司研究员，兴证全球基金管理有限公司研究员、兴全社会责任混合型证券投资基金基金经理助理、兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理、研究部总监助理。

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

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

3、证券从业的涵义遵从行业的相关规定，包括资管相关行业从业经历。

#### 4.1.3 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。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本报告期末，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人制定了《兴证全球基金管理有限公司公平交易办法》，并将不时进行修订。本基金管理人主要从研究的公平、决策的公平、交易的公平、公平交易的监控评估、公平交易的报告和信息披露等方面对公平交易行为进行规范，从而达到保证本基金管理人管理的不同投资组合得到公平对待、保护投资者合法权益的目的。

#### 4.3.2 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。

##### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本报告期末，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

#### 4.3.3 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

23 年本基金相对收益略有改善，得益于我们的行业配置框架的调优，把以往的经验 and 更多的教训沉淀在对多种风险的刻画和分析中。下半年进一步扩大了中试的规模，从更加全面的、风险的角度审视现有组合来剔除一些标的相对容易一些，但是反过来将新的标的经过风险验证后进入持仓序列，这一产出速度还没有提升到批量影响我们重仓股配置的水平，所以改善尚不明显。

下半年的工作可以进一步验证我们中报提出的本基金投资策略，在此也做一下强调和明确：

1. 以布局产业升级的优质公司为主线。
2. 以产业周期和驱动要素认知为组合参数。
3. 深入认知产业规律构建核心标的。

以下我们对于持续学习和方法迭代做个汇报：

23 年新工艺的开发在以下迭代后即将结束：

1. 类似 sora 的思路，我们也将变量、预测、控制计算分成了三个模块，从而大幅减少了过于精细的步进计算，提高了运行效率。

2. 由于运算的减少和随之而来存储需求的下降，模块之间建立了类似总线的对齐联系，对使用体验有极大的优化。

3. 对个股、分级行业的使用过程进行了优化。

这些工艺有助于弥补我们以往在中短期问题应对上的短板，提高逆风期的应对灵活性。

最后是一些持续性的研究工作：

1. 在产业深度认知层面，我们仍然在学习半导体工艺和器件，目前来看逐渐入门，3 年的预期时间表仍然适用。

2. 在上市公司业务层面，过去一年 312 家新股的招股书我们基本都有泛读，但是精读的时间还是很少，然后也会需要读一些开始多起来的重组报告。

3. 我们继续补了一些物理化学和计算机方面的知识。

以上心路历程和总结，供本基金的持有人参阅批评，过去两年，主动权益投资的逆风期得到了很多的质疑，在艰难的过程里，有一部电视剧《我们与恶的距离》同时从理性和感性的角度给了我很大的启发，也推荐给本报告的读者。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，兴全绿色投资混合（LOF）的基金份额净值为 1.109 元，本报告期基金份额净值增长率为-16.86%，同期业绩比较基准收益率为-10.19%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

过往的几个月中，伴随着国际国内经济形式的变化，我们欣喜地看到几个向好的趋势，和大家分享一下。

1. 我们国家提出了“发展战略性新兴产业和未来产业，发展新质生产力”，以科技创新推动产业创新，这一发展方向会使得我们主线策略有更好的实践基础。

2. 我们观察到大多数的制造业门类正在近期的一两个季度经历库存周期的低点，从 21 年底创历史的周期高点迅速调整成了创历史的低点位置，这一通缩性的影响，在未来的一段时间可能将重新回摆和再平衡。

3. 产能过剩一直是困扰我们的一个重要问题，而在经济的低点，我们看到了一些融资政策的调整和产业整合的迹象，这些变化有利于我们一些规模较大的产业在未来更加健康地发展，资本市场的估值也将获得更稳定的基础。

在经济和股市的双重低点，主动权益着力挖掘社会和产业变化带来的投资机会，我们的信心

是越来越强的。

关于这一年最大的话题 AI，我们还是有一些研究后的想法供参考，我们仍将继续关注并提高认识水平：

1. AI 是大规模发现相关关系，特别是既定目标寻找最优解的利器，但是仍然属于提高效率的工具范畴，是创新的基础，而不是创新本身。
2. AI 可能有类似于印刷术、Internet 的极大社会价值。
3. AI 的直接应用可能还需要安全、文化、社会层面的多重检查机制，不一定能迅速大规模落地。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人通过以下工作的开展，有力地保证了本基金整体运作的合法合规，从而最大程度地保护了基金份额持有人和其他相关当事人的合法权益：

1、实时风险监控：通过风控系统对本基金的运作进行实时监控，每日撰写监控日志，在此基础上每周撰写信息周报，对本基金遵守风控指标的情况进行汇总、分析和提示。

2、加强事后人工分析，并定期撰写风险管理报告。除系统控制外，公司风险管理部还对一些无法嵌入系统的风控指标进行了事后人工计算分析和复核，并同样反映在监控日志和信息周报中。此外，在每个季度结束之后，公司风险管理部会对基金的流动性进行压力测试并出具书面报告，对旗下每只基金进行全面的风险评价并形成风险分析报告，并提交公司领导和基金经理审阅。

3、进一步加强对公平交易的监控。根据监管部门的要求以及公司公平交易相关工作的不断深入开展，公司进一步明确了公平交易执行和分析中的具体标准，将公平交易问题分为交易的公平和投资策略的公平，主要包括：（1）明确交易部的分单规则及其识别异常下单行为的职责，保证交易的公平；（2）通过 T 检验、模拟利益输送金额、具体可疑交易分析等方法，对以往的下单及交易记录进行分析，保证投资策略的公平。

4、季度监察稽核和专项稽核：根据中国证监会《关于基金管理公司报送监察稽核报告的通知》以及《证券投资基金管理有限公司监察稽核报告内容与格式指引（试行）》等规定，认真做好公司各季度监察稽核工作。对照中国证监会的季度监察稽核项目表，对本基金的守法合规情况进行逐条检视。此外，在公司审计部对投研部门展开的专项稽核中，也会对本基金的业务进行全面检查。

#### 4.7 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、合规管理人员参与估值方案的制定，确保估值方案符合相关法律法规及基金合同的约定；负责基金估值业务的定期和临时信息披露。6、审计部对估值流程、估值结果等进行检查，确保估值委员会决议的有效执行。

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）基金合同》及其他相关法律法规的规定，本报告期内，本基金实施利润分配 1 次，共分配利润 1,661,914,979.69 元，符合本基金基金合同的相关规定。

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

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人中国工商银行股份有限公司在对兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

### 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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(24)第 P00148 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	兴全绿色投资混合型证券投资基金(LOF)全体持有人
审计意见	我们审计了兴全绿色投资混合型证券投资基金(LOF)的财务报表,包括2023年12月31日的资产负债表,2023年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,公允反映了兴全绿色投资混合型证券投资基金(LOF)2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于兴全绿色投资混合型证券投资基金(LOF),并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	兴证全球基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括兴全绿色投资混合型证券投资基金(LOF)年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责	基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督

任	<p>管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>



会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	吴凌志	冯适
会计师事务所的地址	上海市黄浦区延安东路 222 号外滩中心 30 楼	
审计报告日期	2024 年 3 月 27 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	58,372,939.10	254,821,043.37
结算备付金		4,119,295.28	8,829,995.52
存出保证金		1,365,230.15	2,103,891.73
交易性金融资产	7.4.7.2	4,779,143,205.81	4,987,885,020.53
其中：股票投资		4,527,370,938.05	4,656,322,314.48
基金投资		-	-
债券投资		251,772,267.76	331,562,706.05
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		35,052,914.05	-
应收股利		-	-
应收申购款		544,033.93	977,323.94
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		4,878,597,618.32	5,254,617,275.09
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-

衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		10,128,666.29	132,519,780.33
应付赎回款		42,890,661.71	22,662,811.38
应付管理人报酬		5,001,459.66	6,657,570.93
应付托管费		833,576.58	1,109,595.15
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	132.67
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	4,364,132.08	4,729,284.61
负债合计		63,218,496.32	167,679,175.07
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	4,340,452,405.65	2,929,609,760.04
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	474,926,716.35	2,157,328,339.98
净资产合计		4,815,379,122.00	5,086,938,100.02
负债和净资产总计		4,878,597,618.32	5,254,617,275.09

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.109 元，基金份额总额 4,340,452,405.65 份。

## 7.2 利润表

会计主体：兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-857,677,126.17	-2,766,670,597.47
1. 利息收入		1,135,528.58	1,315,345.84
其中：存款利息收入	7.4.7.13	1,135,528.58	1,315,345.84
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-504,069,588.44	-1,690,289,865.07
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-559,737,604.44	-1,827,054,267.12
基金投资收益		-	-

债券投资收益	7.4.7.15	12,603,489.34	24,702,858.02
资产支持证券投资 投资收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收 益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	43,064,526.66	112,061,544.03
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）	7.4.7.20	-355,413,775.15	-1,081,712,240.09
4. 汇兑收益（损失以 “-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以 “-”号填列）	7.4.7.21	670,708.84	4,016,161.85
<b>减：二、营业总支出</b>		87,475,001.68	123,034,130.32
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	74,786,968.52	105,255,276.65
其中：暂估管理人报 酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	12,464,494.73	17,542,546.00
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融 资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		86.19	44.79
8. 其他费用	7.4.7.23	223,452.24	236,262.88
<b>三、利润总额（亏损 总额以“-”号填列）</b>		-945,152,127.85	-2,889,704,727.79
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损 以“-”号填列）</b>		-945,152,127.85	-2,889,704,727.79
<b>五、其他综合收益的 税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-945,152,127.85	-2,889,704,727.79

### 7.3 净资产变动表

会计主体：兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	2,929,609,760.04	-	2,157,328,339.98	5,086,938,100.02
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,929,609,760.04	-	2,157,328,339.98	5,086,938,100.02
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,410,842,645.61	-	1,682,401,623.63	-271,558,978.02
（一）、综合收益总额	-	-	945,152,127.85	-945,152,127.85
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	1,410,842,645.61	-	924,665,483.91	2,335,508,129.52
其中：1. 基金申购款	2,088,807,257.86	-	1,239,694,393.46	3,328,501,651.32
2. 基金赎回款	-677,964,612.25	-	-315,028,909.55	-992,993,521.80
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	1,661,914,979.69	1,661,914,979.69
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	4,340,452,405.	-	474,926,716.35	4,815,379,122.0

	65			0
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	4,190,469,914. 39	-	6,238,837,640. 45	10,429,307,554. 84
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	4,190,469,914. 39	-	6,238,837,640. 45	10,429,307,554. 84
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	- 1,260,860,154. 35	-	- 4,081,509,300. 47	- 5,342,369,454.8 2
(一)、综合收益总额	-	-	- 2,889,704,727. 79	- 2,889,704,727.7 9
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	- 1,260,860,154. 35	-	- 1,191,804,572. 68	- 2,452,664,727.0 3
其中：1. 基金申购款	686,514,543.49	-	735,378,149.50	1,421,892,692.9 9
2. 基金赎回款	- 1,947,374,697. 84	-	- 1,927,182,722. 18	- 3,874,557,420.0 2
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-

（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	2,929,609,760.04	-	2,157,328,339.98	5,086,938,100.02

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>杨华辉</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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）（原名兴全绿色投资股票型证券投资基金（LOF））（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2011]241号《关于准予兴全绿色投资股票型证券投资基金（LOF）注册的批复》的核准，由基金管理人兴证全球基金管理有限公司自 2011 年 4 月 6 日至 2011 年 4 月 29 日止期间向社会公开募集，基金合同于 2011 年 5 月 6 日正式生效，首次设立募集规模为 2,022,398,091.00 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兴证全球基金管理有限公司，本基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。本基金于 2015 年 8 月 7 日起更名为兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括依法公开发行上市的股票及存托凭证（包括创业板、中小板以及其他经中国证监会批准上市的股票及存托凭证）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：股票投资比例为基金资产的 60%-95%，其中，符合绿色投资理念的股票合计投资比例不低于股票资产的 80%；债券投资比例为基金资产的 5%-40%，其中本基金保留不低于基金资产净值的 5%的现金或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。如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

本基金的业绩比较基准为：80%×中证兴业证券 ESG 盈利 100 指数收益率+20%×中证国债指数

收益率。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的关于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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 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。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时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和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

###### (2) 金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分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。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金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。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然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，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平



均法于交易日结转。若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风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 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基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值原则如下：

(1) 对存在活跃市场的投资品种，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。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当投资品种不存在活跃市场，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。

(3) 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，对估值进行调整，确定公允价值。

#### 7.4.4.6 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，且目前可执行该种法定权利，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。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。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。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配（未分配利润）已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配（未分配利润）。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### (1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

##### (2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

#### (3) 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

#### (4) 信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

(5) 其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

(1) 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 7 月 9 日止期间，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。根据《兴证全球基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 7 月 10 日起，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.20% 的年费率计提；

(2) 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 7 月 9 日止期间，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。根据《兴证全球基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 7 月 10 日起，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提；

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。

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。

### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 60%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 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；投资者在不同销售代理人处或者在同一销售代理人处不同交易账号下的基金份额可以设定不同的分红方式，基金注册登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；

(3) 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；

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 外币交易

本基金本报告期内无外币交易。

#### 7.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.14 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。

(2) 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。

(3) 对于中国证券投资基金业协会《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》（中基协字[2022]566 号）所规定的固定收益品种，本基金按照相关规定，对以公允价值计量的固定收益品种选取第三方估值基准服务机构提供估值全价进行估值；对以摊余成本计量的固定收益品种用自建或由第三方估值基准服务机构提供的预期信用损失模型参数或减值计量结果。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税；2018 年 1 月 1 日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

(2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股

息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不计缴企业所得税。

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。对基金通过港股通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(4) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税；自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。对于基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	58,372,939.10	254,821,043.37
等于：本金	58,364,729.15	254,796,082.69
加：应计利息	8,209.95	24,960.68
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	58,372,939.10	254,821,043.37
----	---------------	----------------

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		5,310,517,728.95	-	4,527,370,938.05	- 783,146,790.90
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	249,726,000.00	2,072,267.76	251,772,267.76	-26,000.00
	合计	249,726,000.00	2,072,267.76	251,772,267.76	-26,000.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		5,560,243,728.95	2,072,267.76	4,779,143,205.81	- 783,172,790.90
项目		上年度末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		5,083,838,454.13	-	4,656,322,314.48	- 427,516,139.65
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	20,791,700.00	8,139.68	22,887,363.58	2,087,523.90
	银行间市场	302,750,400.00	8,255,342.47	308,675,342.47	-2,330,400.00
	合计	323,542,100.00	8,263,482.15	331,562,706.05	-242,876.10
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		5,407,380,554.13	8,263,482.15	4,987,885,020.53	- 427,759,015.75

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债。

**7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况**

注：本基金本报告期末无期货合约。

**7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况**

注：本基金本报告期末无黄金衍生品。

**7.4.7.4 买入返售金融资产****7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

注：本基金本报告期末及上年度末均无买入返售金融资产。

**7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

注：本基金本报告期末及上年度末均未通过买断式逆回购交易取得债券。

**7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明**

无。

**7.4.7.5 债权投资****7.4.7.5.1 债权投资情况**

注：本基金本报告期末及上年度末均无债权投资。

**7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况**

注：本基金本报告期内无债权投资减值准备。

**7.4.7.6 其他债权投资****7.4.7.6.1 其他债权投资情况**

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他债权投资。

**7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况**

注：本基金本报告期内无其他债权投资减值准备。

**7.4.7.7 其他权益工具投资****7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他权益工具投资。

**7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况**

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他权益工具投资。

**7.4.7.8 其他资产**

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他资产。

**7.4.7.9 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------



	2023 年 12 月 31 日	2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	153,675.55	44,283.70
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	4,040,456.53	4,515,000.91
其中：交易所市场	4,039,906.53	4,514,600.91
银行间市场	550.00	400.00
应付利息	-	-
预提费用	170,000.00	170,000.00
合计	4,364,132.08	4,729,284.61

#### 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,929,609,760.04	2,929,609,760.04
本期申购	2,088,807,257.86	2,088,807,257.86
本期赎回（以“-”号填列）	-677,964,612.25	-677,964,612.25
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	4,340,452,405.65	4,340,452,405.65

注：申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末无其他综合收益。

#### 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,296,676,710.89	-139,348,370.91	2,157,328,339.98
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	2,296,676,710.89	-139,348,370.91	2,157,328,339.98
本期利润	-589,738,352.70	-355,413,775.15	-945,152,127.85
本期基金份额交易产生的变	1,051,546,388.91	-126,880,905.00	924,665,483.91

动数			
其中：基金申购款	1,405,026,644.83	-165,332,251.37	1,239,694,393.46
基金赎回款	-353,480,255.92	38,451,346.37	-315,028,909.55
本期已分配利润	-1,661,914,979.69	-	-1,661,914,979.69
本期末	1,096,569,767.41	-621,643,051.06	474,926,716.35

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	867,155.25	1,061,139.96
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	147,001.57	215,307.08
其他	121,371.76	38,898.80
合计	1,135,528.58	1,315,345.84

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-559,737,604.44	-1,827,054,267.12
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	-559,737,604.44	-1,827,054,267.12

##### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日

卖出股票成交总额	13,197,972,952.87	20,304,172,963.57
减：卖出股票成本总额	13,725,531,706.53	22,081,214,133.01
减：交易费用	32,178,850.78	50,013,097.68
买卖股票差价收入	-559,737,604.44	-1,827,054,267.12

#### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无股票投资收益证券出借差价收入。

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
债券投资收益——利息收入	6,245,345.59	13,899,339.43
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	6,358,143.75	10,803,518.59
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	12,603,489.34	24,702,858.02

##### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	777,507,661.14	745,483,586.01
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	755,229,480.00	714,982,487.49
减：应计利息总额	15,915,386.37	19,691,786.86
减：交易费用	4,651.02	5,793.07
买卖债券差价收入	6,358,143.75	10,803,518.59

**7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益赎回差价收入。

**7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益申购差价收入。

**7.4.7.16 资产支持证券投资收益****7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益买卖资产支持证券差价收入。

**7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益赎回差价收入。

**7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益申购差价收入。

**7.4.7.17 贵金属投资收益****7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

**7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益买卖贵金属差价收入。

**7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益赎回差价收入。

**7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益申购差价收入。

**7.4.7.18 衍生工具收益****7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益买卖权证差价收入。

**7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益其他投资收益。

**7.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月

	31 日	月 31 日
股票投资产生的股利收益	43,064,526.66	112,061,544.03
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	43,064,526.66	112,061,544.03

#### 7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-355,413,775.15	-1,081,712,240.09
股票投资	-355,630,651.25	-1,058,424,069.78
债券投资	216,876.10	-23,288,170.31
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-355,413,775.15	-1,081,712,240.09

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	658,640.45	3,988,625.91
基金转换费收入	12,068.39	27,535.94
合计	670,708.84	4,016,161.85

#### 7.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无信用减值损失。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	50,000.00

信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	16,252.24	29,062.88
账户维护费用	36,000.00	36,300.00
其他	1,200.00	900.00
合计	223,452.24	236,262.88

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要在财务报表附注中说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
全球人寿保险国际公司 (AEGON International B.V)	基金管理人的股东
兴证全球资本管理(上海)有限公司(“兴证全球资本”)	基金管理人的子公司
兴证全球基金管理有限公司(“兴证全球基金”)	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“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(“兴业证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	10,897,453,581.99	40.21	14,813,321,183.34	38.18

###### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	30,465,073.48	72.84	84,447,381.59	82.95

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31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	8,010,487.23	43.05	1,977,535.38	48.95
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	10,785,904.10	40.88	1,428,692.09	31.65

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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	74,786,968.52	105,255,276.65
其中：应支付销售机构的客户维护费	18,901,811.71	28,979,486.67

应支付基金管理人的净管理费	55,885,156.81	76,275,789.98
---------------	---------------	---------------

注：2022 年 1 月 1 日至 2023 年 7 月 9 日本基金的管理费按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，管理费的计算方法如下：每日应支付的基金管理费=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。根据《兴证全球基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 7 月 10 日起，本基金的管理费按前一日基金资产净值 1.20%的年费率计提，管理费的计算方法如下：每日应支付的基金管理费=前一日基金资产净值×1.20%/当年天数。基金管理费每日计算，逐日累计至每月末，按月支付。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	12,464,494.73	17,542,546.00

注：2022 年 1 月 1 日至 2023 年 7 月 9 日本基金的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，托管费的计算方法如下：每日应支付的基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。根据《兴证全球基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 7 月 10 日起，本基金的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，托管费的计算方法如下：每日应支付的基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。基金托管费每日计算，逐日累计至每月末，按月支付。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 7.4.10.4 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

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均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。

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均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。



#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2011 年 5 月 6 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	18,879,071.06	7,522,455.50
报告期间申购/买入总份额	5,714,694.81	11,356,615.56
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	24,593,765.87	18,879,071.06
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.5666%	0.6444%

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

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

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

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基金。

#### 7.4.10.6 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		上年度可比期间	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	58,372,939.10	867,155.25	254,821,043.37	1,061,139.96

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登	除息日		每 10 份基金份	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					

	记 日			额分 红数				
1	202 3 年 6 月 28 日	202 3 年 6 月 29 日	202 3 年 6 月 28 日	3.935 1	1,310,971,117.9 6	350,943,861.7 3	1,661,914,979.6 9	-
合 计	-	-	-	3.935 1	1,310,971,117.9 6	350,943,861.7 3	1,661,914,979.6 9	-

#### 7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

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

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末未持有因债券正回购交易而作为抵押的银行间市场债券。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因债券正回购交易而作为抵押的交易所市场债券。

##### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。本基金管理人制定了政策和程序以识别及分析相关风险，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、风险管理部和审计部及合规管理部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

##### 7.4.13.2 信用风险

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

证券，不得超过该证券的 10% 。

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

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的信用债。

#### 7.4.13.2.2 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。

#### 7.4.13.2.3 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。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	22,887,363.58
未评级	-	-
合计	-	22,887,363.58

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。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 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。

### 7.4.13.3 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。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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货币资金、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 202 3 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						
货币资金	58,372,939.10	-	-	-	-	58,372,939.10
结算备付金	4,119,295.28	-	-	-	-	4,119,295.28
存出保证金	1,365,230.15	-	-	-	-	1,365,230.15
交易性金融资产	-	-	251,772,267.76	-	4,527,370,938.05	4,779,143,205.81
应收申购款	16,174.12	-	-	-	527,859.81	544,033.93
应收清算款	-	-	-	-	35,052,914.05	35,052,914.05
资产总计	63,873,638.65	-	251,772,267.76	-	4,562,951,711.91	4,878,597,618.32
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	42,890,661.71	42,890,661.71
应	-	-	-	-	5,001,459.66	5,001,459.66

付管理人报酬							
应付托管费	-	-	-	-	833,576.58	833,576.58	
应付清算款	-	-	-	-	10,128,666.29	10,128,666.29	
其他负债	-	-	-	-	4,364,132.08	4,364,132.08	
负债总计	-	-	-	-	63,218,496.32	63,218,496.32	
利率敏感度缺口	63,873,638.65	-	251,772,267.76	-	4,499,733,215.59	4,815,379,122.00	
上年度末2022年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币	254,821,043.37	-	-	-	-	-254,821,043.37	

资金						
结算备付金	8,829,995.52	-	-	-	-	8,829,995.52
存出保证金	2,103,891.73	-	-	-	-	2,103,891.73
交易性金融资产	-	308,675,342.47	-	22,887,363.58	4,656,322,314.48	4,987,885,020.53
应收申购款	42,303.86	-	-	-	935,020.08	977,323.94
资产总计	265,797,234.48	308,675,342.47	-	22,887,363.58	4,657,257,334.56	5,254,617,275.09
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	22,662,811.38	22,662,811.38
应付管理人报酬	-	-	-	-	6,657,570.93	6,657,570.93
应付托	-	-	-	-	1,109,595.15	1,109,595.15

管费						
应付清算款					-132,519,780.33	132,519,780.33
应交税费					132.67	132.67
其他负债					4,729,284.61	4,729,284.61
负债总计					-167,679,175.07	167,679,175.07
利率敏感度缺口	265,797,234.48	308,675,342.47			22,887,363.58	4,489,578,159.49
						5,086,938,100.02

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他影响债券公允价值的变量保持不变，仅利率发生变动；		
	假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化(即平移收益率曲线)。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	市场利率上升1%	-1,437,000.72	-483,197.03
	市场利率下降1%	1,453,736.43	484,756.21

注：上表反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。



#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净 值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	4,527,370,938.05	94.02	4,656,322,314.48	91.53
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	251,772,267.76	5.23	331,562,706.05	6.52
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	4,779,143,205.81	99.25	4,987,885,020.53	98.05

##### 7.4.13.4.3.2 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净资产的变化	
分析	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准+10%		617,987,776.95
业绩比较基准-10%		-617,987,776.95	-577,274,922.39

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

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由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决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	4,527,370,938.05	4,369,130,542.39
第二层次	251,772,267.76	314,852,260.69
第三层次	-	303,902,217.45
合计	4,779,143,205.81	4,987,885,020.53

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

## 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

## 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	303,902,217.45	303,902,217.45
当期购买	-	50,000,002.56	50,000,002.56
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	396,776,496.22	396,776,496.22
当期利得或损失总额	-	42,874,276.21	42,874,276.21
其中：计入损益的利得或损失	-	42,874,276.21	42,874,276.21
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	455,812,303.63	455,812,303.63
当期购买	-	359,393,303.67	359,393,303.67
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	419,034,680.57	419,034,680.57
当期利得或损失总额	-	-92,268,709.28	-92,268,709.28
其中：计入损益的利得或损失	-	-92,268,709.28	-92,268,709.28
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	303,902,217.45	303,902,217.45
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未	0.00	15,187,858.12	15,187,858.12

实现利得或损失的变动— —公允价值变动损益			
--------------------------	--	--	--

## 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	303,902,217.45	平均价格 亚式期权 模型	股票在剩余限售 期内的股价的预 期年化波动率	0.2947- 0.6412	负相关

## 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。（2022 年 12 月 31 日：无。）

## 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

## 7.4.15 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。

## § 8 投资组合报告

## 8.1 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	4,527,370,938.05	92.80
	其中：股票	4,527,370,938.05	92.80
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	251,772,267.76	5.16
	其中：债券	251,772,267.76	5.16
	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	62,492,234.38	1.28
8	其他各项资产	36,962,178.13	0.76
9	合计	4,878,597,618.32	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	251,977,168.80	5.23
C	制造业	2,971,305,022.85	61.70
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	23,915,188.00	0.50
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	645,848,687.22	13.41
J	金融业	47,751,228.00	0.99
K	房地产业	276,770,874.63	5.75
L	租赁和商务服务业	49,171,306.29	1.02
M	科学研究和技术服务业	60,927,388.46	1.27
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	199,704,073.80	4.15
S	综合	-	-
	合计	4,527,370,938.05	94.02

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 8.3 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
----	------	------	-------	---------	-----------

	码				(%)
1	300750	宁德时代	2,703,594	441,388,756.44	9.17
2	688012	中微公司	2,116,806	325,141,401.60	6.75
3	000683	远兴能源	43,748,853	256,805,767.11	5.33
4	600777	新潮能源	82,345,480	251,977,168.80	5.23
5	002465	海格通信	15,475,900	198,865,315.00	4.13
6	300769	德方纳米	3,096,190	188,960,475.70	3.92
7	001979	招商蛇口	18,038,121	171,903,293.13	3.57
8	600536	中国软件	4,240,786	153,770,900.36	3.19
9	002068	黑猫股份	11,839,807	137,341,761.20	2.85
10	300451	创业慧康	18,530,210	121,372,875.50	2.52
11	002368	太极股份	4,074,429	120,317,888.37	2.50
12	002739	万达电影	9,123,255	118,784,780.10	2.47
13	600048	保利发展	10,592,685	104,867,581.50	2.18
14	300285	国瓷材料	4,061,956	93,912,422.72	1.95
15	300144	宋城演艺	8,198,510	80,919,293.70	1.68
16	688008	澜起科技	1,349,836	79,316,363.36	1.65
17	002273	水晶光电	5,747,500	77,821,150.00	1.62
18	002182	宝武镁业	3,242,206	63,741,769.96	1.32
19	002415	海康威视	1,825,500	63,381,360.00	1.32
20	300887	谱尼测试	5,158,966	60,927,388.46	1.27
21	600570	恒生电子	2,109,112	60,658,061.12	1.26
22	002353	杰瑞股份	2,137,500	60,085,125.00	1.25
23	603997	继峰股份	4,432,312	59,703,242.64	1.24
24	688122	西部超导	1,064,206	56,647,685.38	1.18
25	300308	中际旭创	500,300	56,488,873.00	1.17
26	600435	北方导航	4,615,100	54,181,274.00	1.13
27	600416	湘电股份	3,370,800	53,528,304.00	1.11
28	600873	梅花生物	5,604,200	53,520,110.00	1.11
29	603255	鼎际得	1,374,600	51,272,580.00	1.06
30	300017	网宿科技	6,447,429	50,612,317.65	1.05
31	300456	赛微电子	2,054,600	49,392,584.00	1.03
32	601888	中国中免	587,541	49,171,306.29	1.02
33	603816	顾家家居	1,378,400	48,244,000.00	1.00
34	603187	海容冷链	3,150,336	47,759,093.76	0.99
35	300033	同花顺	304,400	47,751,228.00	0.99
36	688601	力芯微	886,744	46,456,518.16	0.96
37	600893	航发动力	1,213,700	45,368,106.00	0.94
38	002624	完美世界	3,760,600	44,525,504.00	0.92
39	688087	英科再生	1,697,305	40,871,104.40	0.85
40	600160	巨化股份	2,388,350	39,383,891.50	0.82
41	002558	巨人网络	3,158,200	35,182,348.00	0.73
42	301061	匠心家居	656,199	32,645,900.25	0.68

43	000858	五粮液	226,800	31,822,308.00	0.66
44	605020	永和股份	1,125,860	28,157,758.60	0.58
45	688722	同益中	1,674,869	25,625,495.70	0.53
46	600131	国网信通	1,675,941	25,390,506.15	0.53
47	603699	纽威股份	1,829,077	25,351,007.22	0.53
48	688550	瑞联新材	622,201	24,688,935.68	0.51
49	601111	中国国航	3,258,200	23,915,188.00	0.50
50	300850	新强联	738,439	23,504,513.37	0.49
51	600085	同仁堂	437,100	23,472,270.00	0.49
52	688099	晶晨股份	348,729	21,840,897.27	0.45
53	688261	东微半导	260,895	21,808,213.05	0.45
54	688143	长盈通	437,123	15,452,298.05	0.32
55	300228	富瑞特装	2,056,280	14,599,588.00	0.30
56	002179	中航光电	374,300	14,597,700.00	0.30
57	688088	虹软科技	296,720	12,177,388.80	0.25

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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	688012	中微公司	566,082,749.59	11.13
2	300769	德方纳米	530,826,480.83	10.44
3	002368	太极股份	432,289,710.14	8.50
4	000683	远兴能源	427,819,431.85	8.41
5	600536	中国软件	422,365,965.86	8.30
6	300750	宁德时代	400,491,771.80	7.87
7	300451	创业慧康	287,798,419.30	5.66
8	600777	新潮能源	261,055,004.20	5.13
9	002475	立讯精密	254,857,276.05	5.01
10	001979	招商蛇口	246,952,987.62	4.85
11	300454	深信服	241,456,036.57	4.75
12	601689	拓普集团	228,499,635.56	4.49
13	001269	欧晶科技	204,589,423.23	4.02
14	601318	中国平安	201,474,073.07	3.96
15	000651	格力电器	201,046,816.02	3.95
16	603799	华友钴业	195,672,866.90	3.85
17	600938	中国海油	187,309,242.80	3.68
18	002068	黑猫股份	182,171,479.67	3.58
19	002465	海格通信	180,185,633.60	3.54
20	600048	保利发展	174,261,969.79	3.43
21	301155	海力风电	168,637,421.46	3.32
22	600760	中航沈飞	164,064,699.77	3.23
23	300682	朗新集团	146,057,177.09	2.87

24	600703	三安光电	144,455,494.74	2.84
25	300308	中际旭创	134,955,098.36	2.65
26	688772	珠海冠宇	122,657,518.46	2.41
27	002011	盾安环境	122,231,215.44	2.40
28	002739	万达电影	121,797,957.80	2.39
29	300285	国瓷材料	120,220,643.82	2.36
30	300118	东方日升	119,536,095.89	2.35
31	300887	谱尼测试	117,870,461.76	2.32
32	002558	巨人网络	113,951,465.71	2.24
33	300820	英杰电气	109,767,386.13	2.16
34	603069	海汽集团	108,837,998.27	2.14
35	688008	澜起科技	105,768,669.19	2.08
36	000975	银泰黄金	105,620,906.00	2.08
37	603859	能科科技	104,499,566.47	2.05

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。

#### 8.4.2 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	002475	立讯精密	512,576,239.47	10.08
2	300413	芒果超媒	307,864,866.25	6.05
3	600048	保利发展	303,596,313.33	5.97
4	601689	拓普集团	291,560,918.96	5.73
5	688012	中微公司	282,577,620.56	5.55
6	002120	韵达股份	276,441,667.87	5.43
7	600703	三安光电	255,762,880.17	5.03
8	000651	格力电器	237,242,180.52	4.66
9	000683	远兴能源	218,284,428.92	4.29
10	002368	太极股份	210,157,108.26	4.13
11	300454	深信服	201,821,687.52	3.97
12	600536	中国软件	200,281,907.51	3.94
13	600938	中国海油	192,281,347.36	3.78
14	601318	中国平安	190,952,561.41	3.75
15	001269	欧晶科技	184,244,657.15	3.62
16	603799	华友钴业	183,559,709.84	3.61
17	603833	欧派家居	166,257,016.41	3.27
18	300750	宁德时代	164,230,892.38	3.23
19	002648	卫星化学	158,870,320.04	3.12
20	300769	德方纳米	157,379,899.12	3.09
21	600009	上海机场	156,865,425.14	3.08
22	300496	中科创达	155,269,266.29	3.05
23	002645	华宏科技	152,599,645.02	3.00
24	600760	中航沈飞	152,539,027.96	3.00



25	600011	华能国际	138,314,164.59	2.72
26	002607	中公教育	131,867,636.32	2.59
27	600309	万华化学	126,015,101.16	2.48
28	301155	海力风电	125,957,956.07	2.48
29	000921	海信家电	122,012,123.45	2.40
30	688772	珠海冠宇	120,679,307.52	2.37
31	300682	朗新集团	115,379,789.62	2.27
32	300820	英杰电气	113,467,101.74	2.23
33	000975	银泰黄金	113,051,580.60	2.22
34	601888	中国中免	108,852,772.52	2.14
35	002011	盾安环境	108,796,078.26	2.14
36	603069	海汽集团	107,521,280.45	2.11
37	688099	晶晨股份	105,542,239.42	2.07
38	300118	东方日升	102,056,826.68	2.01

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。

#### 8.4.3 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	13,952,210,981.35
卖出股票收入（成交）总额	13,197,972,952.87

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。

#### 8.5 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	251,772,267.76	5.23
	其中：政策性金融债	251,772,267.76	5.23
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	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	251,772,267.76	5.23

#### 8.6 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	230411	23 农发 11	2,500,000	251,772,267.76	5.23

**8.7 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。

**8.8 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：本基金本报告期末未持有贵金属。

**8.9 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。

**8.10 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。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****8.11.1 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。

**8.11.2 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**8.12 投资组合报告附注****8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形**

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

**8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库**

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

**8.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,365,230.15
2	应收清算款	35,052,914.05
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	544,033.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	36,962,178.13

**8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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（%）
226,817	19,136.36	1,996,994,984.17	46.01	2,343,457,421.48	53.99

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	兴全基金管理有限公司企业年金计划-交通银行股份有限公司	5,433,567.00	6.41
2	陈美月	3,000,000.00	3.54
3	林红玉	1,832,305.00	2.16
4	林恩平	1,046,785.00	1.24
5	林春辉	961,719.00	1.14
6	万冠华	898,397.00	1.06
7	吴嫣	796,382.00	0.94
8	胡洪玲	775,200.00	0.92
9	洪文伟	727,238.00	0.86
10	丁金灿	578,361.00	0.68

注：上表所列持有人为本基金场内持有人。

### 9.3 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	4,605,634.37	0.1061

注：上表所列持有人为本基金场内持有人。

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

## 9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产情况

注：本报告期末，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年5月6日） 基金份额总额	2,022,398,091.00
本报告期期初基金份额总额	2,929,609,760.04
本报告期基金总申购份额	2,088,807,257.86
减：本报告期基金总赎回份额	677,964,612.25
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,340,452,405.65

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。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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) 报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。
- (2) 报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自 2015 年起连续 9 年聘请德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。本年度应支付给所聘任的会计师事务所 50,000.00 元人民币。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
兴业证券	3	10,897,453,581.99	40.21	8,010,487.23	43.05	-
中信证券	2	6,553,226,404.45	24.18	4,149,847.05	22.30	-
光大证券	2	3,911,235,021.02	14.43	2,482,556.74	13.34	-
瑞银证券	2	1,812,912,334.46	6.69	1,333,131.48	7.16	-
银河证券	2	1,488,546,385.85	5.49	979,800.57	5.27	-
野村证券	1	1,253,176,997.37	4.62	797,701.62	4.29	-
国海证券	1	1,025,733,438.72	3.79	755,915.34	4.06	-
长城证券	1	157,571,794.03	0.58	99,476.78	0.53	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	1	-	-	-	-	-

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

#### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
兴业证券	30,465,073.48	72.84	-	-	-	-

中信证 券	2,857,910. 99	6.83	-	-	-	-
光大证 券	3,071,152. 89	7.34	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	5,428,505. 47	12.98	-	-	-	-
野村证 券	-	-	-	-	-	-
国海证 券	-	-	-	-	-	-
长城证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	兴证全球基金管理有限公司关于旗下部分基金投资润泽科技（300442）非公开发行股票的公告	中国证券报、指定互联网网站	2023年2月16日
2	关于增加上海华夏财富投资管理有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、指定互联网网站	2023年3月23日
3	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、指定互联网网站	2023年4月27日
4	关于兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）暂停接受大额申购（含定投）、转换转入申请的公告	中国证券报、指定互联网网站	2023年5月29日
5	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、指定互联网网站	2023年6月14日
6	兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）分红公告	中国证券报、指定互联网网站	2023年6月26日
7	兴证全球基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	中国证券报、指定互联网网站	2023年7月8日
8	关于增加嘉实财富管理有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、指定互联网网站	2023年7月10日
9	兴证全球基金管理有限公司关于旗下部分基金基金合同、招募说明书更新的提示性公告	中国证券报、指定互联网网站	2023年7月10日
10	关于兴全绿色投资混合型证券投资	中国证券报、指定互联	2023年8月8日

	基金（LOF）恢复接受大额申购（含定投）、大额转换转入申请的公告	网网站	
11	关于开通我司旗下基金在腾安基金基金转换业务的公告	中国证券报、指定互联网网站	2023 年 8 月 11 日
12	关于增加东莞银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、指定互联网网站	2023 年 9 月 7 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

投资者可在二级市场买卖本基金基金份额，受市场供需关系等各种因素的影响，投资者买卖基金份额有可能面临相应的折溢价风险。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）募集注册的文件；
- 2、《兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 4、关于申请募集兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）之法律意见；
- 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。

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

### 13.3 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

2024 年 3 月 29 日