

# 东兴兴源债券型证券投资基金

## 2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人:东兴基金管理有限公司

基金托管人:上海银行股份有限公司

送出日期:2022 年 08 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。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年8月25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1月13日（基金合同生效日）起至2022年6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                         | 7  |
| 2.4 信息披露方式                              | 7  |
| 2.5 其他相关资料                              | 7  |
| §3 主要财务指标和基金净值表现                        | 8  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 8  |
| 3.2 基金净值表现                              | 9  |
| §4 管理人报告                                | 10 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 10 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 12 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 13 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 14 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 14 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 15 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 15 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 15 |
| §5 托管人报告                                | 15 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 15 |
| 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 | 15 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 16 |
| §6 中期财务会计报告(未经审计)                       | 16 |
| 6.1 资产负债表                               | 16 |
| 6.2 利润表                                 | 18 |
| 6.3 净资产(基金净值)变动表                        | 19 |
| 6.4 报表附注                                | 20 |
| §7 投资组合报告                               | 46 |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 46 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 46 |
| 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       | 47 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 48 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 50 |
| 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      | 50 |
| 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   | 51 |
| 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   | 51 |
| 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      | 51 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明               | 51 |
| 7.12 投资组合报告附注                           | 51 |
| §8 基金份额持有人信息                            | 52 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构                   | 52 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况                | 52 |
| 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        | 53 |

|   |    |
|---|----|
| §9 开放式基金份额变动.....                       | 53 |
| §10 重大事件揭示.....                         | 53 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                   | 53 |
| 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.....   | 54 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....        | 54 |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                     | 54 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....              | 54 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....      | 54 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....             | 54 |
| 10.8 其他重大事件.....                        | 55 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息.....                 | 56 |
| 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..... | 56 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                | 56 |
| §12 备查文件目录.....                         | 56 |
| 12.1 备查文件目录.....                        | 56 |
| 12.2 存放地点.....                          | 57 |
| 12.3 查阅方式.....                          | 57 |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                 |               |
|-----------------|-----------------|---------------|
| 基金名称            | 东兴兴源债券型证券投资基金   |               |
| 基金简称            | 东兴兴源债券          |               |
| 基金主代码           | 014716          |               |
| 基金运作方式          | 契约型开放式          |               |
| 基金合同生效日         | 2022年01月13日     |               |
| 基金管理人           | 东兴基金管理有限公司      |               |
| 基金托管人           | 上海银行股份有限公司      |               |
| 报告期末基金份额总额      | 155,014,843.18份 |               |
| 基金合同存续期         | 不定期             |               |
| 下属分级基金的基金简称     | 东兴兴源债券A         | 东兴兴源债券C       |
| 下属分级基金的交易代码     | 014716          | 014717        |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 149,999,207.90份 | 5,015,635.28份 |

### 2.2 基金产品说明

|      |   |
|------|---|
| 投资目标 | 本基金在积极投资、严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期、稳定增值，力争获得超越业绩比较基准的投资收益。   |
| 投资策略 | <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金基于定量与定性相结合的方式跟踪国内外宏观经济数据及政策变化，密切关注市场流动性变化情况，动态评估不同资产的估值水平变化，合理确定组合中权益资产、债券资产及货币市场工具及其他金融工具的投资比例。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>（1）久期管理策略</p> <p>在全面分析宏观经济环境与政策趋向等因素的基础上，本基金将通过调整债券资产组合的久期，达到增加收益或减少损失的目的。当预期市场总体利率水平降低时，本基金将延长所持有的债券组合的久期，从而可以在市场利率实际下降时获得债券价格上升所产生的资本利得；反之，当预期市场总体利率水平上升时，则缩短组合久期，以避免债券价格下降的风险带来的资本损失，并获得较高的再投资收益。</p> <p>（2）类属配置策略</p> |

对于债券资产而言，是信用债、金融债和国债之间的比例配置。当宏观经济转向衰退周期，企业信用风险将普遍提高，此时降低信用债投资比例，降低幅度应该结合利差预期上升幅度和持有期收益分析结果来进行确定。相反，当宏观经济转向复苏，企业信用风险普遍下降，此时应该提高信用债投资比例，提高幅度应该结合利差预期下降幅度和持有期收益分析结果来进行确定。此外，还将考察一些特殊因素对于信用债配置产生影响，其中包括供给的节奏，主要投资主体的投资习惯，以及替代资产的冲击等均对信用利差产生影响，因此，在中国市场分析信用债投资机会，不仅需要分析信用风险趋势，还需要分析供需面和替代资产的冲击等因素，最后，在预期的利差变动范围内，进行持有期收益分析，以确定最佳的信用债投资比例和最佳的信用债持有结构。

### （3）期限结构配置策略

收益率曲线形状变化的主要影响因素是宏观经济基本面以及货币政策，而投资者的期限偏好以及各期限的债券供给分布对收益率形状有一定影响。对收益率曲线的分析采取定性和定量相结合的方法。定性方法为：在对经济周期和货币政策分析下，对收益率曲线形状可能变化给予一个方向判断；定量方法为：参考收益率曲线的历史趋势，同时结合未来的各期限的供给分布以及投资者的期限偏好，对未来收益率曲线形状做出判断。

在对于收益率曲线形状变化和变动幅度做出判断的基础上，结合情景分析结果，提出可能的期限结构配置策略，包括：子弹型策略、哑铃型策略、梯形策略等。

### （4）信用债投资策略

本基金投资信用债的评级范围为AA+至AAA，信用评级为债项评级，若无债项评级或债项评级为短期信用评级的，依照其主体评级。投资于各个信用等级信用债资产占基金投资信用债资产的比例如下：

信用等级 占比

AAA 50%-100%

AA+ 0%-50%

信用债券的信用利差与债券发行人所在行业特征和自身情况密切相关。本基金将通过对债券发行人所属行业及公司资产负债情况、公司现金流情况、公司运营情况及未来发展前景分析等，对信用债券的违约风险及合理的信用利差水平进行判断，对信用债券进行独立、客观的价值评估。

|        |   |
|--------|---|
|        | (5) 可转换债券投资策略 (6) 可交换债券投资策略 (7) 证券公司短期公司债券投资策略 (8) 资产支持证券等品种投资策略 (9) 国债期货投资策略<br>3、股票投资策略 |
| 业绩比较基准 | 中债综合全价(总值)指数收益率   |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。   |

### 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      | 东兴基金管理有限公司              | 上海银行股份有限公司               |
| 信息披露负责人 | 姓名                      | 银国宏                      |
|         | 联系电话                    | 400-670-1800             |
|         | 电子邮箱                    | kefu@dxamc.cn            |
| 客户服务电话  | 400-670-1800            | 95594                    |
| 传真      | 010-57307388            | 021-68476936             |
| 注册地址    | 北京市丰台区东管头1号院1号楼1-190室   | 中国(上海)自由贸易试验区银城中路168号    |
| 办公地址    | 北京市西城区平安里西大街28号中海国际中心6层 | 中国(上海)自由贸易试验区银城中路168号27层 |
| 邮政编码    | 100035                  | 200120                   |
| 法定代表人   | 银国宏                     | 金煜                       |

### 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 | <a href="http://www.dxamc.cn">http://www.dxamc.cn</a> |
| 基金中期报告备置地点          | 北京市西城区平安里西大街28号中海国际中心6层                               |

### 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称         | 办公地址                    |
|--------|------------|-------------------------|
| 注册登记机构 | 东兴基金管理有限公司 | 北京市西城区平安里西大街28号中海国际中心6层 |

### § 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<br>(2022年01月13日（基金合同生效日）-2022年06月30日) |              |
|---------------|---|--------------|
|               | 东兴兴源债券A                                   | 东兴兴源债券C      |
| 本期已实现收益       | 1,290,436.33                              | 40,690.28    |
| 本期利润          | 2,323,394.64                              | 75,212.54    |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0155                                    | 0.0047       |
| 本期加权平均净值利润率   | 1.54%                                     | 0.47%        |
| 本期基金份额净值增长率   | 1.55%                                     | 1.50%        |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末<br>(2022年06月30日)                     |              |
| 期末可供分配利润      | 1,290,436.33                              | 40,686.44    |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0086                                    | 0.0081       |
| 期末基金资产净值      | 152,322,602.54                            | 5,090,844.64 |
| 期末基金份额净值      | 1.0155                                    | 1.0150       |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末<br>(2022年06月30日)                     |              |
| 基金份额累计净值增长率   | 1.55%                                     | 1.50%        |

注：1、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。

2、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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4、本基金基金合同于2022年1月13日生效，截至本报告期末未满半年。本报告实际报告期为2022年1月13日（基金合同生效日）至2022年6月30日。



### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### 东兴兴源债券A

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③   | ②-④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去一个月      | 0.87%    | 0.09%       | -0.24%     | 0.03%         | 1.11% | 0.06% |
| 过去三个月      | 1.36%    | 0.06%       | 0.29%      | 0.04%         | 1.07% | 0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.55%    | 0.05%       | 0.24%      | 0.05%         | 1.31% | 0.00% |

##### 东兴兴源债券C

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③   | ②-④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去一个月      | 0.87%    | 0.09%       | -0.24%     | 0.03%         | 1.11% | 0.06% |
| 过去三个月      | 1.36%    | 0.06%       | 0.29%      | 0.04%         | 1.07% | 0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.50%    | 0.05%       | 0.24%      | 0.05%         | 1.26% | 0.00% |

注：本基金基金合同于 2022 年 1 月 13 日生效，截至本报告期末，本基金合同生效不满六个月。

#### 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

东兴兴源债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2022年01月13日-2022年06月30日)



东兴兴源债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日为2022年1月13日，根据相关法律法规和基金合同，本基金建仓期为基金合同生效之日起6个月内。截至本报告期末，本基金合同生效不满六个月，仍处于建仓期。

## § 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

东兴基金管理有限公司（以下简称“东兴基金”）成立于2020年3月，注册地北京，注册资本2亿元。东兴证券股份有限公司（以下简称“东兴证券”）持有东兴基金100%股份，其控股股东为中国东方资产管理股份有限公司（以下简称“中国东方”），实际控制人为中国财政部。东兴基金系中国东方下属唯一公募基金业务经营主体，是中国东方金融服务平台的重要组成部分。

东兴基金前身为东兴证券基金业务部，先后在主动权益、固定收益、现金管理和指数类产品方面进行了大量布局，积累了丰富的投资运作经验：

特色指数类产品——在行业指数、量化增强方面进行深入研究设计，致力于打造特色精品指数类基金阵列；

主动管理类产品——以追求绝对收益为目标，贯彻自上而下和自下而上相结合的投研思路，坚持价值投资；

固定收益类产品—坚持守住价值、发现价值的原则，在严格把控信用风险的前提下，充分挖掘市场机会。

东兴基金拥有一支行业经验丰富、具备高度凝聚力、战斗力和专业性的优秀团队。公司大部分员工来自于基金、券商、投资、信评等各类金融机构，90%以上员工具有硕士及以上学历。公司承载中国东方的红色基因，践行诚信、创新、激情、专注、协作的企业文化，坚持以投资者利益为上的原则，致力为客户持续创造价值。

截至2022年6月30日，本公司管理东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金、东兴蓝海财富灵活配置混合型证券投资基金、东兴安盈宝货币市场基金、东兴兴利债券型证券投资基金、东兴量化优享灵活配置混合型证券投资基金、东兴品牌精选灵活配置混合型证券投资基金、东兴兴福一年定期开放债券型证券投资基金、东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金、东兴兴瑞一年定期开放债券型证券投资基金、东兴兴财短债债券型证券投资基金、东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金、东兴中证消费50指数证券投资基金、东兴兴晟混合型证券投资基金、东兴宸瑞量化混合型证券投资基金、东兴鑫享6个月滚动持有债券型发起式证券投资基金、东兴兴盈三个月定期开放债券型证券投资基金、东兴兴源债券型证券投资基金、东兴宸祥量化混合型证券投资基金、东兴连裕6个月滚动持有债券型证券投资基金共19只开放式基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名       | 职务      | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明  |
|----------|---------|-----------------|------|--------|---|
|          |         | 任职日期            | 离任日期 |        |   |
| 司马义买买提先生 | 本基金基金经理 | 2022-01-13      | -    | 9年     | 2011年10月至2014年3月任职于中信证券股份有限公司；2015年4月至2017年2月任职于粤开证券(原联讯证券)股份有限公司；2017年3月至2019年1月任职于九州证券股份有限公司固定收益资产管理部，曾担任部门总经理职务，主要从事固定收益投资、交易等工作；2019年1月至2021年2月，任职于江信基金管理有限公司金融市场总部，担任部门总经理，主要从事固定收益研究相关工作。2021年3月加入东兴证券股份有 |

|      |         |            |   |    |   |
|------|---------|------------|---|----|---|
|      |         |            |   |    | 限公司基金业务部。现任东兴安盈宝货币市场基金基金经理、东兴兴利债券型证券投资基金基金经理、东兴兴福一年定期开放债券型证券投资基金基金经理、东兴兴瑞一年定期开放债券型证券投资基金基金经理、东兴兴财短债债券型证券投资基金基金经理、东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金基金经理、东兴兴盈三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、东兴鑫享6个月滚动持有债券型发起式证券投资基金基金经理、东兴兴源债券型证券投资基金基金经理、东兴连裕6个月滚动持有债券型证券投资基金基金经理。 |
| 张旭先生 | 本基金基金经理 | 2022-04-07 | - | 9年 | 张旭先生，硕士研究生，曾就职于东软集团、隆圣投资管理有限公司，具有基金从业资格。2012年3月至2015年3月就职于银华基金管理有限公司，任年金与特定客户资产管理计划投资经理，2015年3月加入中加基金管理有限公司，任权益投资部总监、基金经理。2019年11月加入东兴证券股份有限公司基金业务部，任助理总经理、投资总监。现任东兴量化优享灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东兴宸瑞量化混合型证券投资基金基金经理、东兴兴源债券型证券投资基金基金经理。          |

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 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守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证券监督管理委员会和《东兴兴源债券型证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

### 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

基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《东兴基金管理有限公司公平交易管理办法》。

基金管理人建立了投资决策的内部控制体系和客观的研究方法，各投资组合经理在授权范围内自主决策，各投资组合共享研究平台，在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

基金管理人实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于交易所公开竞价交易，基金管理人执行交易系统内的公平交易程序；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易，在参与申购之前，各基金经理应在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量。在获配额度确定后，按照价格优先的原则对交易结果进行分配；如果申购价格相同，则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配。债券一级市场申购分配不足最小单位的，可由基金经理协商分配，协商不一致则由投资总监决定；对于银行间市场交易，应按照场外交易流程执行，由各基金经理给出询价区间，交易部根据询价区间在银行间市场上应该按照价格优先、时间优先的原则进行询价并完成交易，并留存询价交易记录备查。

基金管理人定期对不同投资组合不同时间段的同向交易价差、反向交易情况、异常交易情况进行统计分析，投资组合经理对相关交易情况进行合理性解释并留存记录。

我们对本报告期内公司管理的不同投资组合在相同时间窗口下（日内、3日内和5日内）同向交易的价差进行了t分布假设检验，通过对检验结果进行分析，未发现旗下投资组合之间存在可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

本报告期内，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动中公平对待不同投资组合，未直接或通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。本基金运作符合法律法规和公平交易管理制度规定。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，未出现涉及本基金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5%的情况。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

第一季度，我们增配了部分短期性价比较高的城投债券，权益方面由于股票市场波动较大，仍处于观望阶段，等待合适的底部建仓时机；第二季度，我们根据市场情况建仓了部分可转债，增配了部分权益资产。

下半年，我们将维持原有策略，并择机继续增配权益资产，在控制净值波动的情况下努力增厚基金收益。

东兴基金作为本基金管理人，在兼顾流动性充裕、信用风险可控的前提下，努力提升基金综合收益率。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2022年1月13日（基金合同生效日）起至2022年6月30日，本基金A类份额净值增长率为1.55%，业绩比较基准收益率为0.24%，高于业绩比较基准1.31%；本基金C类份额净值增长率为1.50%，业绩比较基准收益率为0.24%，高于业绩比较基准1.26%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在上半年中，相对宽松的资金环境与金融机构较为充裕的负债端是支撑市场维持偏强的主要因素。宽松的货币环境叠加上实体经济弱需求、弱预期的情况下，相对于偏低的实体经济预期投资回报率来说，国内利率水平并不算太低，所以出现这种资产荒的局面应该是较为正常的。并且这样内生性原因推动的资产配置需求也与2015年-2016年通过同业扩张的格局有所不同，更难以出现那种快速的扭转。对于经济基本面来说，疫情对于经济的冲击已经毋庸置疑，在连续4月、5月受到疫情较大影响的情况下，第二季度的经济增长可能面临更大的压力，距离全年5.5%的目标有一定距离。但疫情的冲击相对短暂，阶段性冲击过后也会如2020年一样有短期的复苏和反弹，而这已经是一条确定性比较强的脉络。如果回到对后续市场的判断，对此我们更应该关注疫情之外的一些中长期变量的变化，这才是可能出现预期差的关键，比如2020年国内疫情恢复后出口和制造业反而经历了相对较长时间的复苏，而这一次出口和制造业能否在疫情过后仍保持一定的韧性可能是较为关键的变量。

展望今年下半年，在市场已经经过了一定对于疫情情绪下的初步修复后，大的背景和定价逻辑并没有扭转，疫情改善带来的经济环比恢复应该抬升的是短期内利率震荡区间的下限，资金的中枢水平仍然维持原有利率震荡顶部的定价，考虑到当前经济的脉冲式反弹幅度和持续性都不强，资金环境的宽松可能仍能够维持。我们认为在当下的诸多

影响下，债券市场暂时难以脱离以政策利率为估值中枢的箱体震荡的格局，向上或向下的空间都不大。

另外，本轮信用风险的概率较2018年以及2020年降低很多，违约造成的系统性风险已经被充分认识，宏观环境有利于政府债务软着陆，防范系统性风险成为主要目标，利差进入最后挤压阶段。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本基金本报告期未进行利润分配。

#### 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

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日出现基金持有人数量不满二百人或者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，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同以及托管协议的有关约定，诚实、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

本报告期，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核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，认为复核内容真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 中期财务会计报告(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：东兴兴源债券型证券投资基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

| 资 产         | 附注号     | 本期末<br>2022年06月30日 |
|-------------|---------|--------------------|
| <b>资 产：</b> |         |                    |
| 银行存款        | 6.4.7.1 | 5,013.45           |
| 结算备付金       |         | 1,064,368.04       |
| 存出保证金       |         | 17,789.87          |
| 交易性金融资产     | 6.4.7.2 | 151,943,383.66     |
| 其中：股票投资     |         | 7,362,947.20       |
| 基金投资        |         | -                  |
| 债券投资        |         | 144,580,436.46     |
| 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 | 4,400,000.00       |
| 债权投资        |         | -                  |
| 其中：债券投资     |         | -                  |
| 资产支持证券投资    |         | -                  |
| 其他投资        |         | -                  |
| 其他债权投资      |         | -                  |
| 其他权益工具投资    |         | -                  |



|               |            |                            |
|---------------|------------|----------------------------|
| 应收清算款         |            | 97,363.88                  |
| 应收股利          |            | -                          |
| 应收申购款         |            | -                          |
| 递延所得税资产       |            | -                          |
| 其他资产          | 6.4.7.5    | -                          |
| 资产总计          |            | 157,527,918.90             |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2022年06月30日</b> |
| <b>负 债：</b>   |            |                            |
| 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         |            | 2.02                       |
| 应付管理人报酬       |            | 38,590.22                  |
| 应付托管费         |            | 12,863.42                  |
| 应付销售服务费       |            | 41.56                      |
| 应付投资顾问费       |            | -                          |
| 应交税费          |            | 5,154.25                   |
| 应付利润          |            | -                          |
| 递延所得税负债       |            | -                          |
| 其他负债          | 6.4.7.6    | 57,820.25                  |
| 负债合计          |            | 114,471.72                 |
| <b>净资产：</b>   |            |                            |
| 实收基金          | 6.4.7.7    | 155,014,843.18             |
| 其他综合收益        |            | -                          |
| 未分配利润         | 6.4.7.8    | 2,398,604.00               |
| 净资产合计         |            | 157,413,447.18             |
| 负债和净资产总计      |            | 157,527,918.90             |

注：1、报告截止日2022年6月30日，基金份额总额155,014,843.18份。东兴兴源债券A基金份额净值1.0155元，份额总额149,999,207.90份，东兴兴源债券C基金份额净值1.0150元，份额总额5,015,635.28份；

2、本基金基金合同于2022年1月13日生效，无上年度末和上年度可比期间数据。本报告实际报告期为2022年1月13日（基金合同生效日）至2022年6月30日，下同。

## 6.2 利润表

会计主体：东兴兴源债券型证券投资基金

本报告期：2022年01月13日（基金合同生效日）至2022年06月30日

单位：人民币元

| 项目                    | 附注号      | 本期<br>2022年01月13日（基金合同生效日）至2022年06月30日 |
|-----------------------|----------|--|
| 一、营业总收入               |          | 2,763,175.48                           |
| 1. 利息收入               |          | 456,609.88                             |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.9  | 117,500.16                             |
| 债券利息收入                |          | 0.00                                   |
| 资产支持证券利息收入            |          | 0.00                                   |
| 买入返售金融资产收入            |          | 339,109.72                             |
| 证券出借利息收入              |          | -                                      |
| 其他利息收入                |          | -                                      |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）     |          | 1,239,085.03                           |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.10 | 92,498.81                              |
| 基金投资收益                |          | -                                      |
| 债券投资收益                | 6.4.7.11 | 1,131,646.22                           |
| 资产支持证券投资收益            | 6.4.7.12 | -                                      |
| 贵金属投资收益               | 6.4.7.13 | -                                      |
| 衍生工具收益                | 6.4.7.14 | -                                      |
| 股利收益                  | 6.4.7.15 | 14,940.00                              |
| 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）     | 6.4.7.16   | 1,067,480.57 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |            | -            |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 6.4.7.17   | -            |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 364,568.30   |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 228,358.73   |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 76,119.61    |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 683.65       |
| 4. 投资顾问费                   |            | -            |
| 5. 利息支出                    |            | 493.01       |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 493.01       |
| 6. 信用减值损失                  | 6.4.7.18   | -            |
| 7. 税金及附加                   |            | 2,747.02     |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.19   | 56,166.28    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 2,398,607.18 |
| 减：所得税费用                    |            | -            |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 2,398,607.18 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | -            |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | 2,398,607.18 |

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：东兴兴源债券型证券投资基金

本报告期：2022年01月13日（基金合同生效日）至2022年06月30日

单位：人民币元

| 项目              | 本期                               |        |       |       |
|-----------------|----------------------------------|--------|-------|-------|
|                 | 2022年01月13日（基金合同生效日）至2022年06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） | -                                | -      | -     | -     |
| 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）                          | 305,017,894.27  | - | -            | 305,017,894.27  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -150,003,051.09 | - | 2,398,604.00 | -147,604,447.09 |
| （一）、综合收益总额                               | -               | - | 2,398,607.18 | 2,398,607.18    |
| （二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | -150,003,051.09 | - | -3.18        | -150,003,054.27 |
| 其中：1. 基金申购款                              | -               | - | -            | -               |
| 2. 基金赎回款                                 | -150,003,051.09 | - | -3.18        | -150,003,054.27 |
| （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）                          | 155,014,843.18  | - | 2,398,604.00 | 157,413,447.18  |

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：

银国宏

王青

王广辉

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

东兴兴源债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据2021年12月16日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予东兴兴源债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2021]4002号）的批复，自2022年1月10日至2022年1月11日公开募集设立。本基金为债券型证券投资基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集305,017,894.09元人民币，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）“普华永道中天验字(2022)第0066号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《东兴兴源债券型证券投资基金基金合同》于2022年1月13日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为305,017,894.27份，其中认购资金利息折合0.18份。本基金基金管理人为东兴基金管理有限公司，基金托管人为上海银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东兴兴源债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行

上市的股票（包括主板、创业板及其他中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、次级债、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债、企业债、公司债、可转换公司债券（含分离交易的可转换公司债券纯债部分）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、证券公司短期公司债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款等）、同业存单、货币市场工具、国债期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。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。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，投资于股票等权益类资产的比例不超过基金资产的20%。本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金，存出保证金，应收申购款等。如果法律法规对该比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，本基金的投资比例相应进行调整。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的会计报表按照财政部2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》（财政部令第33号发布、财政部令第76号修订）、于2006年2月15日及其后颁布和修订的42项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第3号—半年度报告的内容与格式》、《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》、《证券投资基金信息披露编报规则第3号—会计报表附注的编制及披露》及中国证监会颁布的其他相关规定编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合企业会计准则及其他有关规定要求，真实、完整地反映了本基金2022年6月30日的财务状况以及2022年1月13日（基金合同生效日）至2022年6月30日的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日。本期财务报表的实际编制期间为2022年1月13日（基金合同生效日）至2022年6月30日。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### 1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产。在通常情况下，本基金所持有的金融资产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。

基金持有的股票投资、债券投资、基金投资、资产支持证券投资等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在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

基金持有的以摊余成本计量的、按照返售协议约定先买入再按固定价格返售的票据、证券等金融资产所融出的资金分类为买入返售金融资产。

基金采用买入并持有至到期策略的金融资产，即到期日固定、回收金额固定或可确定，且有明确意图和能力持有至到期的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产，在债权投资中核算。

基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### 2、金融负债的分类

金融负债分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以及以摊余成本计量的金融负债两类。基金持有的未划分为以摊余成本计量的金融负债通常以公允价值计量且其变动计入当期损益，列示为交易性金融负债。基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按取得时的公允价值作为初始确认金额。取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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，期间取得的利息或现金股利，确认为当期收益。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以成本进行后续计量，在摊销时产生的利得或损失，应当确认为当期收益。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产；金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

1、对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2、对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

3、如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认

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。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

#### 6.4.4.9 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。

分类为以摊余成本计量的金融资产利息收入在持有期内，按金融资产的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由金融资产发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认金融资产利息收入。其中：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，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息收入。

##### （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和对应投资品种产生的交易费用的差额确认。

债券、资产支持证券、同业存单等固定收益类金融资产的投资收益分为：

① 持有期间的利息收入：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利息收入在持有期内，按金融资产的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由金融资产发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认金融资产投资收益。其中：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，逐日确认投资收益；

② 交易日按卖出金融资产交易日的成交总额扣除应结转的投资成本与应计利息(若有)和对应投资品种产生的交易费用后的差额确认投资收益。

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和对应投资品种产生的交易费用后的差额确认。

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扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

##### （3）公允价值变动损益



公允价值变动损益系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失，并于相关金融资产或金融负债卖出或到期时转出计入投资收益。

#### (4) 其他收入

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

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 根据基金合同，基金管理费按前一日基金资产净值的0.30%的年费率逐日计提；

(2) 根据基金合同，基金托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率逐日计提；

(3) 根据基金合同，基金销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.01%的年费率计提；

(4) 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费用；基金份额持有人大会费用、基金的证券交易或结算费用；基金的银行汇划费用；证券账户开户费用、银行账户维护费用、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

#### 6.4.4.11 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，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的30%，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；选择采取红利再投资形式的，分红资金将按红利发放日的基金份额净值转成相应的基金份额，红利再投资的份额免收申购费。如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，则登记机构将以投资者在各销售机构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、同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5、分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红，分红权益登记日申请赎回的基金份额享受当次分红；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且对现有基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人、登记机构可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

#### 6.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他需要披露的重要会计政策和会计估计。

#### 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

本基金在本报告期无需说明的重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期无需说明的重大会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期无需说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税【2004】78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、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4月23日发布的《上海、深圳证券交易所关于做好交易相关系统印花税率参数调整的通知》、2008年9月18日发布的《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】70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》、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《财政部、国家税务总局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》及其他相关税务法规和实务操作、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》，主要税项列示如下：

1. 于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。自2018年1月1日起，在基金运营过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

2. 对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，暂不征收企业所得税。

3. 对基金取得的股票股息、红利收入，自2015年9月8日起，基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。基金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。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4. 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5. 对于基金从事A股买卖，自2008年09月19日起，由出让方按0.1%的税率缴纳证券（股票）交易印花税，受让方不再缴纳印花税。

6. 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、现金等对价，暂免于缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2022年06月30日 |
|--------------|--------------------|
| 活期存款         | 5,013.45           |
| 等于：本金        | 4,327.11           |
| 加：应计利息       | 686.34             |
| 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        | 5,013.45 |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2022年06月30日 |                |                |                |            |
|---------------|--------------------|----------------|----------------|----------------|------------|
|               | 成本                 | 应计利息           | 公允价值           | 公允价值变动         |            |
| 股票            | 6,756,165.19       | -              | 7,362,947.20   | 606,782.01     |            |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                  | -              | -              | -              |            |
| 债券            | 交易所市场              | 82,644,240.25  | 1,025,258.73   | 83,911,030.43  | 241,531.45 |
|               | 银行间市场              | 60,002,832.89  | 447,406.03     | 60,669,406.03  | 219,167.11 |
|               | 合计                 | 142,647,073.14 | 1,472,664.76   | 144,580,436.46 | 460,698.56 |
| 资产支持证券        | -                  | -              | -              | -              |            |
| 基金            | -                  | -              | -              | -              |            |
| 其他            | -                  | -              | -              | -              |            |
| 合计            | 149,403,238.33     | 1,472,664.76   | 151,943,383.66 | 1,067,480.57   |            |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2022年06月30日 |           |
|-------|--------------------|-----------|
|       | 账面余额               | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 4,400,000.00       | -         |

|       |              |   |
|-------|--------------|---|
| 银行间市场 | -            | - |
| 合计    | 4,400,000.00 | - |

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2022年06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      | 6,211.97           |
| 其中：交易所市场    | 5,511.97           |
| 银行间市场       | 700.00             |
| 应付利息        | -                  |
| 预提费用        | 51,608.28          |
| 合计          | 57,820.25          |

注：预提费用为按日计提的审计费、信息披露费和账户维护费。

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 6.4.7.7.1 东兴兴源债券A

金额单位：人民币元

| 项目<br>(东兴兴源债券A) | 本期<br>2022年01月13日（基金合同生效日）至2022年06月30日 |                |
|-----------------|--|----------------|
|                 | 基金份额（份）                                | 账面金额           |
| 基金合同生效日         | 149,999,208.90                         | 149,999,208.90 |

|               |                |                |
|---------------|----------------|----------------|
| 本期申购          | -              | -              |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1.00          | -1.00          |
| 本期末           | 149,999,207.90 | 149,999,207.90 |

#### 6.4.7.7.2 东兴兴源债券C

金额单位：人民币元

| 项目<br>(东兴兴源债券C) | 本期<br>2022年01月13日（基金合同生效日）至2022年06月30日 |                 |
|-----------------|--|-----------------|
|                 | 基金份额（份）                                | 账面金额            |
| 基金合同生效日         | 155,018,685.37                         | 155,018,685.37  |
| 本期申购            | -                                      | -               |
| 本期赎回（以“-”号填列）   | -150,003,050.09                        | -150,003,050.09 |
| 本期末             | 5,015,635.28                           | 5,015,635.28    |

注：本基金基金合同于2022年1月13日生效，基金合同生效日的基金份额总额为305,017,894.27份，A类基金份额总额为149,999,208.90份，其中：认购资金本金折算基金份额为：149,999,208.90份，利息折算基金份额为：0.00份；C类基金份额总额为155,018,685.37份，其中：认购资金本金折算基金份额为：155,018,685.19份，利息折算基金份额为：0.18份。

#### 6.4.7.8 未分配利润

##### 6.4.7.8.1 东兴兴源债券A

单位：人民币元

| 项目<br>(东兴兴源债券A) | 已实现部分        | 未实现部分        | 未分配利润合计      |
|-----------------|--------------|--------------|--------------|
| ><br>基金合同生效日    | -            | -            | -            |
| 本期利润            | 1,290,436.33 | 1,032,958.31 | 2,323,394.64 |
| 本期基金份额交易产生的变动数  | -            | -            | -            |
| 其中：基金申购款        | -            | -            | -            |
| 基金赎回款           | -            | -            | -            |

|         |              |              |              |
|---------|--------------|--------------|--------------|
| 本期已分配利润 | -            | -            | -            |
| 本期末     | 1,290,436.33 | 1,032,958.31 | 2,323,394.64 |

## 6.4.7.8.2 东兴兴源债券C

单位：人民币元

| 项目<br>(东兴兴源债券C) | 已实现部分     | 未实现部分     | 未分配利润合计   |
|-----------------|-----------|-----------|-----------|
| ><br>基金合同生效日    | -         | -         | -         |
| 本期利润            | 40,690.28 | 34,522.26 | 75,212.54 |
| 本期基金份额交易产生的变动数  | -3.84     | 0.66      | -3.18     |
| 其中：基金申购款        | -         | -         | -         |
| 基金赎回款           | -3.84     | 0.66      | -3.18     |
| 本期已分配利润         | -         | -         | -         |
| 本期末             | 40,686.44 | 34,522.92 | 75,209.36 |

## 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2022年01月13日（基金合同生效日）至2022年06月30日 |
|-----------|--|
| 活期存款利息收入  | 100,348.33                             |
| 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 | 17,077.35                              |
| 其他        | 74.48                                  |
| 合计        | 117,500.16                             |

注：其他包括结算保证金利息收入。

## 6.4.7.10 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01月13日（基金合同生效日）至2022年06月30日 |
| 卖出股票成交总额   | 600,693.00                       |
| 减：卖出股票成本总额 | 501,452.66                       |
| 减：交易费用     | 6,741.53                         |
| 买卖股票差价收入   | 92,498.81                        |

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期                               |
|------------------------------|----------------------------------|
|                              | 2022年01月13日（基金合同生效日）至2022年06月30日 |
| 债券投资收益——利息收入                 | 1,200,816.51                     |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -69,170.29                       |
| 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                           | 1,131,646.22                     |

##### 6.4.7.11.2 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01月13日（基金合同生效日）至2022年06月30日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 48,320,670.25                    |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 47,094,500.00                    |
| 减：应计利息总额               | 1,294,137.25                     |
| 减：交易费用                 | 1,203.29                         |
| 买卖债券差价收入               | -69,170.29                       |



**6.4.7.12 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期2022年01月13日（基金合同生效日）至2022年06月30日无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.13 贵金属投资收益**

本基金本报告期2022年01月13日（基金合同生效日）至2022年06月30日无贵金属投资收益。

**6.4.7.14 衍生工具收益**

本基金本报告期2022年01月13日（基金合同生效日）至2022年06月30日无衍生工具收益。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2022年01月13日（基金合同生效日）至2022年06月30日 |
|---------------|--|
| 股票投资产生的股利收益   | 14,940.00                              |
| 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            | 14,940.00                              |

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2022年01月13日（基金合同生效日）至2022年06月30日 |
|------------|--|
| 1. 交易性金融资产 | 1,067,480.57                           |
| ——股票投资     | 606,782.01                             |
| ——债券投资     | 460,698.56                             |
| ——资产支持证券投资 | -                                      |
| ——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                     | 1,067,480.57 |

#### 6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期2022年01月13日（基金合同生效日）至2022年06月30日无其他收入。

#### 6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期2022年01月13日（基金合同生效日）至2022年06月30日无信用减值损失。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期                               |
|---------|----------------------------------|
|         | 2022年01月13日（基金合同生效日）至2022年06月30日 |
| 审计费用    | 9,095.58                         |
| 信息披露费   | 33,512.70                        |
| 证券出借违约金 | -                                |
| 汇划手续费   | 1,258.00                         |
| 账户维护费   | 12,000.00                        |
| 其他      | 300.00                           |
| 合计      | 56,166.28                        |

注：其他为银行间账户查询费。

#### 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

本基金本报告期末不存在需要说明的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本基金报告报出日，本基金不存在需要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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称          | 与本基金的关系                  |
|----------------|--------------------------|
| 中国东方资产管理股份有限公司 | 基金管理人的实际控制人              |
| 东兴证券股份有限公司     | 基金管理人的控股股东、基金销售机构        |
| 东兴基金管理有限公司     | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构      |
| 上海银行股份有限公司     | 基金托管人                    |
| 大连银行股份有限公司     | 与基金管理人同一实际控制人的关联方、基金销售机构 |

##### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 6.4.10.1 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<br>2022年01月13日（基金合同生效日）至2022年06月30日 |              |
|------------|--|--------------|
|            | 成交金额                                   | 占当期股票成交总额的比例 |
| 东兴证券股份有限公司 | 7,858,310.85                           | 100.00%      |

注：本基金基金合同于2022年1月13日生效，无上年度可比期间数据。

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期2022年01月13日（基金合同生效日）至2022年06月30日未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 |
|-------|----|
|-------|----|

|            | 2022年01月13日（基金合同生效日）至2022年06月30日 |                |
|------------|----------------------------------|----------------|
|            | 成交金额                             | 占当期债券买卖成交总额的比例 |
| 东兴证券股份有限公司 | 151,756,419.54                   | 100.00%        |

注：本基金基金合同于2022年1月13日生效，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2022年01月13日（基金合同生效日）至2022年06月30日 |                |
|------------|--|----------------|
|            | 成交金额                                   | 占当期债券回购成交总额的比例 |
| 东兴证券股份有限公司 | 2,299,532,000.00                       | 100.00%        |

注：本基金基金合同于2022年1月13日生效，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2022年01月13日（基金合同生效日）至2022年06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 |
| 东兴证券股份有限公司 | 5,511.97                               | 100.00%    | 5,511.97 | 100.00%      |

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，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后的净额列示。

2、本基金基金合同于2022年1月13日生效，无上年度可比期间数据。

#### 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<br>2022年01月13日（基金合同生效日）至2022年06月30日 |
|----|--|
|    |  |

|                 |            |
|-----------------|------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 228,358.73 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 18.84      |

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、本基金基金合同于2022年1月13日生效，无可比期间数据。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                               |
|----------------|----------------------------------|
|                | 2022年01月13日（基金合同生效日）至2022年06月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 76,119.61                        |

注：1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2、本基金基金合同于2022年1月13日生效，无可比期间数据。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期                               |
|----------------|----------------------------------|
|                | 2022年01月13日（基金合同生效日）至2022年06月30日 |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                 |

|            | 东兴兴源债券A | 东兴兴源债券C | 合计     |
|------------|---------|---------|--------|
| 东兴基金管理有限公司 | 0.00    | 682.84  | 682.84 |
| 合计         | 0.00    | 682.84  | 682.84 |

注：1、本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.01%的年费率计提。C类基金份额销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.01\% \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E为前一日的C类基金份额基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取，由基金管理人支付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2、本基金基金合同生效日为2022年1月13日，无可比期间数据。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期2022年01月13日（基金合同生效日）至2022年06月30日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

本基金本报告期2022年01月13日（基金合同生效日）至2022年06月30日未与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期2022年01月13日（基金合同生效日）至2022年06月30日未与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

东兴兴源债券C

份额单位：份

| 项目                  | 本期<br>2022年01月13日（基金合同生效日）至2<br>022年06月30日 |              |
|---------------------|--|--------------|
|                     | 基金合同生效日（2022年01月13日）持有的基金份额                | 5,000,000.00 |
| 报告期初持有的基金份额         | 0.00                                       |              |
| 报告期间申购/买入总份额        | 0.00                                       |              |
| 报告期间因拆分变动份额         | 0.00                                       |              |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额      | 0.00                                       |              |
| 报告期末持有的基金份额         | 5,000,000.00                               |              |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 99.69%                                     |              |

注：1、本基金基金合同生效日为2022年1月13日。

2、基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用按招募说明书中规定的费率收取。

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

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

#### 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<br>2022年01月13日（基金合同生效日）至2022年06月30<br>日 |          |
|-------|--|----------|
|       | 期末余额                                       | 当期利息收入   |
|       | 上海银行股份有限公司                                 | 5,013.45 |

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期2022年01月13日（基金合同生效日）至2022年06月30日未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期2022年01月13日（基金合同生效日）至2022年06月30日无其他关联交易事项的说明。

#### 6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本基金本报告期2022年01月13日（基金合同生效日）至2022年06月30日未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2022年06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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有在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在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参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

本基金投资风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险和操作风险及其他不可抗拒的风险。其中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。

对于上述风险本基金管理人建立了系统化、流程化和数量化的风险管理体系，确保投资组合在获取较高收益的同时承受尽可能低的风险，从而实现本基金的投资目标。本基金设立了由投资决策委员会、风险控制委员会、风险管理部和合规法律部组成的风险管理组织体系，该体系通过分工合作的制度对风险进行管理控制。本基金通过事前的风险识别，事中的风险测量和处理以及事后的风险评估和调整风险实行全程风险控制。



#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、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；本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的百分之十，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的百分之十。

除通过上述投资限定控制相应信用风险外，本基金在交易所进行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，发生违约风险的可能性很低；本基金也可在银行间同业市场进行交易，在交易前均会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

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2022年06月30日 |
|--------|--------------------|
| A-1    | 10,125,191.78      |
| A-1以下  | -                  |
| 未评级    | 40,312,019.73      |
| 合计     | 50,437,211.51      |

注：1、以上按短期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

2、本基金基金合同生效日为2022年1月13日，无上年度末数据。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有同业存单。

##### 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<br>2022年06月30日 |
|--------|--------------------|
| AAA    | 20,157,763.73      |

|       |               |
|-------|---------------|
| AAA以下 | 3,699,095.47  |
| 未评级   | 10,232,194.52 |
| 合计    | 34,089,053.72 |

注：1、以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

2、本基金基金合同生效日为2022年1月13日，无上年度末数据。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有同业存单。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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。

本基金保持不低于基金资产净值5%的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以备支付基金份额持有人的赎回款项。本基金所持债券均在证券交易所和银行间同业市场交易，除在本报告6.4.12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，本报告期末本基金的其余资产均能及时变现。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。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

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

本报告所称流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险，风险管理的目标是确保基金组合资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。基金管理人在报告期内综合考虑投资标的流动性、投资策略、投资限制、销售渠道、潜在投资者类型与风险偏好、投资者结构等因素，综合进行流动性风险管理。

基金管理人坚持按照“组合管理、分散投资”的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制进行投资管理，通过灵活配置的二级市场投资策略、分散化的投资原则、严格的投资比例限制等投资安排，使基金组合资产的流动性安排与基金申赎安排相匹配，报告期内未发生流动性风险事件。

#### 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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金管理人在利率风险管理方面，定期监控本基金面临的利率风险敞口，并通过调整基金投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2022年06月30<br>日 | 1个月以内        | 1-3个月         | 3个月-1年        | 1-5年          | 5年以上          | 不计息          | 合计             |
|------------------------|--------------|---------------|---------------|---------------|---------------|--------------|----------------|
| 资产                     |              |               |               |               |               |              |                |
| 银行存款                   | 4,327.11     | -             | -             | -             | -             | 686.34       | 5,013.45       |
| 结算备付金                  | 1,063,889.24 | -             | -             | -             | -             | 478.80       | 1,064,368.04   |
| 存出保证金                  | 17,781.87    | -             | -             | -             | -             | 8.00         | 17,789.87      |
| 交易性金融资产                | -            | 50,041,000.00 | 59,107,500.00 | 18,027,992.50 | 15,931,279.20 | 8,835,611.96 | 151,943,383.66 |
| 买入返售金融资产               | 4,400,000.00 | -             | -             | -             | -             | -            | 4,400,000.00   |
| 应收清算款                  | -            | -             | -             | -             | -             | 97,363.88    | 97,363.88      |
| 资产总计                   | 5,485,998.22 | 50,041,000.00 | 59,107,500.00 | 18,027,992.50 | 15,931,279.20 | 8,934,148.98 | 157,527,918.90 |
| 负债                     |              |               |               |               |               |              |                |
| 应付赎回款                  | -            | -             | -             | -             | -             | 2.02         | 2.02           |
| 应付管理人报酬                | -            | -             | -             | -             | -             | 38,590.22    | 38,590.22      |
| 应付托管费                  | -            | -             | -             | -             | -             | 12,863.42    | 12,863.42      |
| 应付销售服务费                | -            | -             | -             | -             | -             | 41.56        | 41.56          |
| 应交税费                   | -            | -             | -             | -             | -             | 5,154.25     | 5,154.25       |
| 其他负债                   | -            | -             | -             | -             | -             | 57,820.25    | 57,820.25      |
| 负债总计                   | -            | -             | -             | -             | -             | 114,471.72   | 114,471.72     |
| 利率敏感度缺口                | 5,485,998.22 | 50,041,000.00 | 59,107,500.00 | 18,027,992.50 | 15,931,279.20 | 8,819,677.26 | 157,413,447.18 |

注：1、表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

2、本基金基金合同生效日为2022年1月13日，无上年度末数据。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|    |  |                             |
|----|--|-----------------------------|
| 假设 | 1、该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；   |                             |
|    | 2、所有期限的利率均以相同幅度变动25个基点，其他市场变量均不发生变化；                                     |                             |
| 分析 | 3、银行存款、结算备付金、存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益、而对其本身的公允价值无重大影响； |                             |
|    | 4、该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。                                    |                             |
| 分析 | 相关风险变量的变动  | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |
|    |  | 本期末<br>2022年06月30日          |
|    | 1、市场利率上升25个基点  | -134,999.64                 |
|    | 2、市场利率下降25个基点  | 135,502.11                  |

注：本基金基金合同生效日为2022年1月13日，无上年度末数据。

#### 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

本基金所面临的其他价格风险主要是市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 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06月30日    |              |
|---------------|----------------|--------------|
|               | 公允价值           | 占基金资产净值比例(%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 7,362,947.20   | 4.68         |
| 交易性金融资产—基金投资  | -              | -            |
| 交易性金融资产—债券投资  | 144,580,436.46 | 91.85        |
| 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            | 151,943,383.66 | 96.53        |

注：本基金基金合同生效日为2022年1月13日，无上年度末数据。

#### 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。

##### 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

金额单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2022年06月30日 |
|---------------|--------------------|
| 第一层次          | 31,219,806.40      |
| 第二层次          | 120,723,577.26     |
| 第三层次          | -                  |
| 合计            | 151,943,383.66     |

注：本基金基金合同生效日为2022年1月13日，无上年度末数据。

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本报告期内不存在持有的金融工具公允价值所属层次间发生重大变动的情况。

**6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

本基金本报告期内不存在持有非持续以公允价值计量的金融工具的情况。

**6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明**

本基金本报告期内不存在持有不以公允价值计量的金融工具的情况。

**6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

截至本报告报出日，本基金无需要披露的有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

**§ 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              | 7,362,947.20   | 4.67          |
|    | 其中：股票             | 7,362,947.20   | 4.67          |
| 2  | 基金投资              | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 144,580,436.46 | 91.78         |
|    | 其中：债券             | 144,580,436.46 | 91.78         |
|    | 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          | 4,400,000.00   | 2.79          |
|    | 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      | 1,069,381.49   | 0.68          |
| 8  | 其他各项资产            | 115,153.75     | 0.07          |
| 9  | 合计                | 157,527,918.90 | 100.00        |

**7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合**

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------|---------|---------------|
|----|------|---------|---------------|

|   |                  |              |      |
|---|------------------|--------------|------|
| A | 农、林、牧、渔业         | -            | -    |
| B | 采矿业              | -            | -    |
| C | 制造业              | 2,631,894.60 | 1.67 |
| 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      | -            | -    |
| H | 住宿和餐饮业           | -            | -    |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | -            | -    |
| J | 金融业              | 3,822,625.60 | 2.43 |
| K | 房地产业             | -            | -    |
| L | 租赁和商务服务业         | 908,427.00   | 0.58 |
| M | 科学研究和技术服务业       | -            | -    |
| N | 水利、环境和公共设施管理业    | -            | -    |
| O | 居民服务、修理和其他服务业    | -            | -    |
| P | 教育               | -            | -    |
| Q | 卫生和社会工作          | -            | -    |
| R | 文化、体育和娱乐业        | -            | -    |
| S | 综合               | -            | -    |
|   | 合计               | 7,362,947.20 | 4.68 |

### 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  | 600036 | 招商银行 | 35,100 | 1,481,220.00 | 0.94         |
| 2  | 600030 | 中信证券 | 59,200 | 1,282,272.00 | 0.81         |
| 3  | 600958 | 东方证券 | 98,560 | 1,006,297.60 | 0.64         |
| 4  | 601888 | 中国中免 | 3,900  | 908,427.00   | 0.58         |
| 5  | 603043 | 广州酒家 | 34,380 | 867,063.60   | 0.55         |
| 6  | 600031 | 三一重工 | 33,200 | 632,792.00   | 0.40         |

|    |        |      |        |            |      |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 7  | 603806 | 福斯特  | 6,700  | 438,984.00 | 0.28 |
| 8  | 603986 | 兆易创新 | 2,700  | 383,967.00 | 0.24 |
| 9  | 600884 | 杉杉股份 | 10,400 | 309,088.00 | 0.20 |
| 10 | 601628 | 中国人寿 | 1,700  | 52,836.00  | 0.03 |

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额     | 占期末基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|----------------|
| 1  | 600036 | 招商银行 | 1,407,728.00 | 0.89           |
| 2  | 600030 | 中信证券 | 1,086,020.45 | 0.69           |
| 3  | 600958 | 东方证券 | 957,683.60   | 0.61           |
| 4  | 603043 | 广州酒家 | 781,404.80   | 0.50           |
| 5  | 601888 | 中国中免 | 703,629.00   | 0.45           |
| 6  | 600031 | 三一重工 | 621,504.00   | 0.39           |
| 7  | 601628 | 中国人寿 | 544,946.00   | 0.35           |
| 8  | 603806 | 福斯特  | 462,423.00   | 0.29           |
| 9  | 603986 | 兆易创新 | 383,327.00   | 0.24           |
| 10 | 600884 | 杉杉股份 | 308,952.00   | 0.20           |
| 11 | -      | -    | -            | -              |
| 12 | -      | -    | -            | -              |
| 13 | -      | -    | -            | -              |
| 14 | -      | -    | -            | -              |
| 15 | -      | -    | -            | -              |
| 16 | -      | -    | -            | -              |
| 17 | -      | -    | -            | -              |
| 18 | -      | -    | -            | -              |
| 19 | -      | -    | -            | -              |
| 20 | -      | -    | -            | -              |

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。



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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额   | 占期末基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|------------|----------------|
| 1  | 601628 | 中国人寿 | 600,693.00 | 0.38           |
| 2  | -      | -    | -          | -              |
| 3  | -      | -    | -          | -              |
| 4  | -      | -    | -          | -              |
| 5  | -      | -    | -          | -              |
| 6  | -      | -    | -          | -              |
| 7  | -      | -    | -          | -              |
| 8  | -      | -    | -          | -              |
| 9  | -      | -    | -          | -              |
| 10 | -      | -    | -          | -              |
| 11 | -      | -    | -          | -              |
| 12 | -      | -    | -          | -              |
| 13 | -      | -    | -          | -              |
| 14 | -      | -    | -          | -              |
| 15 | -      | -    | -          | -              |
| 16 | -      | -    | -          | -              |
| 17 | -      | -    | -          | -              |
| 18 | -      | -    | -          | -              |
| 19 | -      | -    | -          | -              |
| 20 | -      | -    | -          | -              |

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

2、“卖出金额”均按买卖成交金额（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 | 7,257,617.85 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 600,693.00   |

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

2、“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（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      | 60,054,171.23  | 38.15        |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | -              | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -              | -            |
| 4  | 企业债券      | -              | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | 50,437,211.51  | 32.04        |
| 6  | 中期票据      | 10,232,194.52  | 6.50         |
| 7  | 可转债(可交换债) | 23,856,859.20  | 15.16        |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 144,580,436.46 | 91.85        |

### 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  | 019641    | 20国债11       | 300,000 | 30,728,695.89 | 19.52        |
| 2  | 019666    | 22国债01       | 290,000 | 29,325,475.34 | 18.63        |
| 3  | 102280975 | 22鑫泰MTN001   | 100,000 | 10,232,194.52 | 6.50         |
| 4  | 012280521 | 22瀚瑞投资SCP002 | 100,000 | 10,204,945.21 | 6.48         |

|   |           |             |         |               |      |
|---|-----------|-------------|---------|---------------|------|
| 5 | 042280081 | 22连云金控CP001 | 100,000 | 10,125,191.78 | 6.43 |
|---|-----------|-------------|---------|---------------|------|

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 7.12 投资组合报告附注

##### 7.12.1

本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被中国证监会及其派出机构、证券交易所立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

##### 7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

##### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额        |
|----|-------|-----------|
| 1  | 存出保证金 | 17,789.87 |
| 2  | 应收清算款 | 97,363.88 |
| 3  | 应收股利  | -         |
| 4  | 应收利息  | -         |

|   |       |            |
|---|-------|------------|
| 5 | 应收申购款 | -          |
| 6 | 其他应收款 | -          |
| 7 | 待摊费用  | -          |
| 8 | 其他    | -          |
| 9 | 合计    | 115,153.75 |

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值         | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|--------------|---------------|
| 1  | 113052 | 兴业转债 | 6,923,635.12 | 4.40          |
| 2  | 110059 | 浦发转债 | 3,179,963.01 | 2.02          |
| 3  | 113037 | 紫银转债 | 1,895,829.50 | 1.20          |
| 4  | 113047 | 旗滨转债 | 1,803,265.97 | 1.15          |
| 5  | 113043 | 财通转债 | 609,553.85   | 0.39          |
| 6  | 110073 | 国投转债 | 427,999.34   | 0.27          |

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### § 8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别    | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额     | 持有人结构          |        |           |        |
|---------|----------|---------------|----------------|--------|-----------|--------|
|         |          |               | 机构投资者          |        | 个人投资者     |        |
|         |          |               | 持有份额           | 占总份额比例 | 持有份额      | 占总份额比例 |
| 东兴兴源债券A | 8        | 18,749,900.99 | 149,989,000.00 | 99.99% | 10,207.90 | 0.01%  |
| 东兴兴源债券C | 210      | 23,883.98     | 5,000,000.00   | 99.69% | 15,635.28 | 0.31%  |
| 合计      | 218      | 711,077.26    | 154,989,000.00 | 99.98% | 25,843.18 | 0.02%  |

#### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数 | 占基金总份额比 |
|----|------|--------|---------|
|----|------|--------|---------|

|                  |         | (份)      | 例     |
|------------------|---------|----------|-------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 东兴兴源债券A | 104.96   | 0.00% |
|                  | 东兴兴源债券C | 2,515.02 | 0.05% |
|                  | 合计      | 2,619.98 | 0.00% |

### 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                             | 份额级别    | 持有基金份额总量的数量区间(万份) |
|--------------------------------|---------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 东兴兴源债券A | 0                 |
|                                | 东兴兴源债券C | 0                 |
|                                | 合计      | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 东兴兴源债券A | 0                 |
|                                | 东兴兴源债券C | 0                 |
|                                | 合计      | 0                 |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                            | 东兴兴源债券A        | 东兴兴源债券C        |
|----------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日(2022年01月13日)基金份额总额 | 149,999,208.90 | 155,018,685.37 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额      | -              | -              |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额    | 1.00           | 150,003,050.09 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额     | -              | -              |
| 本报告期期末基金份额总额               | 149,999,207.90 | 5,015,635.28   |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内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

本基金管理人督察长王微于2022年3月16日离任，同日起由董事长银国宏代任督察长。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、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

本报告期内基金投资策略未发生改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未更换会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称       | 交易单元数量 | 股票交易         |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|------------|--------|--------------|--------------|-----------|------------|----|
|            |        | 成交金额         | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 东兴证券股份有限公司 | 1      | 7,858,310.85 | 100.00%      | 5,511.97  | 100.00%    | -  |

注：1、此处的佣金指本基金通过券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

#### 2、交易单元的选择标准和程序

券商选择标准：财务状况良好、经营行为规范、研究实力较强的证券公司。其中财务状况良好、经营行为规范以最近一年证券公司分类评介在C类或C类以上，且近一年内无重大违法违规事件为主要判断依据。研究实力较强以公司的评价意见为主要判断依据。

券商选择程序：①对符合选择标准的券商的服务进行评价；②拟定租用对象：由投

研部门根据以上评价结果拟定备选的券商；③签约：拟定备选的券商后，按公司签约程序与备选券商签约。签约时，要明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等。

3、本基金本报告期内新增1个交易单元，为东兴证券股份有限公司上海交易所交易单元。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称       | 债券交易           |              | 债券回购交易           |                | 权证交易 |              | 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 |
| 东兴证券股份有限公司 | 151,756,419.54 | 100.00%      | 2,299,532,000.00 | 100.00%        | -    | -            | -    | -            |

### 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                      | 法定披露方式    | 法定披露日期     |
|----|---|-----------|------------|
| 1  | 东兴兴源债券型证券投资基金份额发售公告                       | 指定报刊、指定网站 | 2022-01-05 |
| 2  | 东兴兴源债券型证券投资基金基金产品资料概要                     | 指定网站      | 2022-01-05 |
| 3  | 东兴兴源债券型证券投资基金基金合同                         | 指定网站      | 2022-01-05 |
| 4  | 东兴兴源债券型证券投资基金托管协议                         | 指定网站      | 2022-01-05 |
| 5  | 东兴兴源债券型证券投资基金招募说明书                        | 指定网站      | 2022-01-05 |
| 6  | 关于东兴兴源债券型证券投资基金提前结束募集的公告                  | 指定报刊、指定网站 | 2022-01-12 |
| 7  | 东兴兴源债券型证券投资基金基金合同生效公告                     | 指定报刊、指定网站 | 2022-01-14 |
| 8  | 东兴兴源债券型证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资业务的公告        | 指定报刊、指定网站 | 2022-01-18 |
| 9  | 东兴兴源债券型证券投资基金暂停接受个人投资者申购、转换转入和定期定额投资申请的公告 | 指定报刊、指定网站 | 2022-01-24 |
| 10 | 东兴基金管理有限公司行业高级管理人员变更公告                    | 指定报刊、指定网站 | 2022-03-17 |
| 11 | 东兴兴源债券型证券投资基金基金经理变更公告                     | 指定报刊、指定网站 | 2022-04-08 |
| 12 | 东兴兴源债券型证券投资基金招募说明书（更新）（2022年第1号）          | 指定网站      | 2022-04-09 |

|    |                          |      |            |
|----|--------------------------|------|------------|
| 13 | 东兴兴源债券型证券投资基金基金产品资料概要更新  | 指定网站 | 2022-04-09 |
| 14 | 东兴兴源债券型证券投资基金2022年第一季度报告 | 指定网站 | 2022-04-22 |

## § 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   | 1              | 2022年1月13日-2022年1月23日  | 90,000,000.00  | -    | 90,000,000.00 | 0.00           | 0.00%  |
|  | 2              | 2022年1月13日-2022年6月30日  | 149,989,000.00 | -    | 0.00          | 149,989,000.00 | 96.76% |
| 产品特有风险   |                |                        |                |      |               |                |        |
| <p>1、根据本基金投资范围的规定，本基金投资于债券的资产占基金资产比例不低于 80%。因此，本基金需要承担由于市场利率波动造成的利率风险以及发债主体特别是公司债、企业债的发债主体的信用质量变化造成的信用风险，以及无法偿 债造成的信用违约风险；如果债券市场出现整体下跌，将无法完全避免债券市场系统性风险。</p> <p>2、本基金投资于可转债品种，可转债的条款相对于普通债券和股票而言更为复杂，对这些条款研究不足导致的事件可能为本基金带来损失。例如，当可转债的价格明显高于其赎回价格时，若本基金未能在转债被赎回前转股或卖出，则可能产生不必要的损失。</p> <p>3、本基金可投资国债期货，可能引发如下风险：国债期货交易采用保证金交易方式，基金资产可能由于无法及时筹措资金满足建立或者维持国债期货头寸所要求的保证金而面临保证金风险。同时，该潜在损失可能成倍放大，具有杠杆性风险。另外，期货在对冲市场风险的使用过程中，基金资产可能因为国债期货合约与合约标的价格波动不一致而面临基差风险。</p> <p>4、本基金可投资于在全国银行间债券市场或证券交易所交易的资产支持证券，基金管理人将本着谨慎和控制风险的原则进行资产支持证券投资，但由于资产支持证券具有一定的信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿还风险等风险，可能导致包括基金净值波动在内的各项风险。</p> |                |                        |                |      |               |                |        |

注：单一机构投资者期末占比超过50%的原因为基金总份额变动引起，非接受某一投资者申购申请后导致份额超过基金总份额50%以上的情形。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 一、中国证监会核准东兴兴源债券型证券投资基金募集的文件
- 二、《东兴兴源债券型证券投资基金基金合同》
- 三、《东兴兴源债券型证券投资基金托管协议》
- 四、《东兴兴源债券型证券投资基金招募说明书》



五、中国证监会颁发的经营证券期货业务许可证、营业执照、公司章程

## 12.2 存放地点

北京市西城区平安里西大街28号中海国际中心6层

## 12.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（[www.dxamc.cn](http://www.dxamc.cn)）查阅。

东兴基金管理有限公司  
二〇二二年八月三十一日