

# 兴全恒益债券型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：兴证全球基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 08 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<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 主要财务指标和基金净值表现</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
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	20
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>45</b>
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	49
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	49
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	49
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	49
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	50
7.11 投资组合报告附注 .....	50
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>52</b>
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
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>53</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>53</b>
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
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>56</b>
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
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>57</b>
12.1 备查文件目录 .....	57
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	兴全恒益债券型证券投资基金	
基金简称	兴全恒益债券	
基金主代码	004952	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年9月20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	5,295,627,394.03 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	兴全恒益债券 A	兴全恒益债券 C
下属分级基金的交易代码	004952	004953
报告期末下属分级基金的份额总额	4,841,378,099.58 份	454,249,294.45 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险并保持基金资产流动性的前提下，追求基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金在投资中主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪，通过主动管理投资策略，在主要配置债券资产的前提下，适当配置权益类资产，达到增强收益的目的。
业绩比较基准	中国债券总指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于较低风险/收益的产品。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		兴证全球基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨卫东	郭明
	联系电话	021-20398888	010-66105799
	电子邮箱	yangwd@xqfunds.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006780099, 021-38824536	95588
传真		021-20398858	010-66105798
注册地址		上海市黄浦区金陵东路 368 号	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市浦东新区芳甸路 1155 号嘉里城办公楼 28-29 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	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.xqfunds.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	兴证全球基金管理有限公司	上海市浦东新区芳甸路 1155 号 嘉里城办公楼 28-29 楼

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022年01月01日-2022年06月30日)	
	兴全恒益债券 A	兴全恒益债券 C
本期已实现收益	110,126,513.75	2,596,116.20
本期利润	-97,737,817.73	7,752,217.20
加权平均基金份额本期利润	-0.0197	0.0630
本期加权平均净值利润率	-1.43%	4.64%
本期基金份额净值增长率	-0.83%	-1.02%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)	
期末可供分配利润	1,526,953,625.07	131,505,471.91
期末可供分配基金份额利润	0.3154	0.2895
期末基金资产净值	6,836,516,283.51	629,181,232.76
期末基金份额净值	1.4121	1.3851
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	41.21%	38.51%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴全恒益债券 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	3.09%	0.31%	1.65%	0.21%	1.44%	0.10%
过去三个月	3.53%	0.39%	1.31%	0.28%	2.22%	0.11%
过去六个月	-0.83%	0.40%	-1.95%	0.30%	1.12%	0.10%
过去一年	7.51%	0.40%	-1.36%	0.26%	8.87%	0.14%
过去三年	32.39%	0.46%	7.01%	0.25%	25.38%	0.21%
自基金合同生效起至今	41.21%	0.41%	11.47%	0.25%	29.74%	0.16%

兴全恒益债券 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	3.05%	0.31%	1.65%	0.21%	1.40%	0.10%

过去三个月	3.44%	0.39%	1.31%	0.28%	2.13%	0.11%
过去六个月	-1.02%	0.40%	-1.95%	0.30%	0.93%	0.10%
过去一年	7.08%	0.40%	-1.36%	0.26%	8.44%	0.14%
过去三年	30.82%	0.46%	7.01%	0.25%	23.81%	0.21%
自基金合同生效起 至今	38.51%	0.41%	11.47%	0.25%	27.04%	0.16%

注：本基金业绩比较基准为中国债券总指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×20%，在业绩比较基准的选取上主要基于如下考虑：中国债券总指数由中央国债登记结算有限责任公司于 2003 年 1 月 1 日编制发布，样本涵盖交易所、银行间市场记账式国债（固定、浮动利率）、金融债。沪深 300 指数是由中证指数有限公司编制发布、表征 A 股市场走势的权威指数。该指数是由上海和深圳证券交易所中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数。本基金选择该指数来衡量 A 股股票投资部分的绩效。本基金的业绩比较基准根据本基金投资风格和策略特点设置，能够准确反映产品的风险收益特征，便于基金管理人合理衡量比较本基金的业绩表现。

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：

$$\text{Return}_t = 80\% \times (\text{中国债券总指数收益率}_t / \text{中国债券总指数收益率}_{t-1} - 1) + 20\% \times (\text{沪深 300 指数收益率}_t / \text{沪深 300 指数收益率}_{t-1} - 1)$$

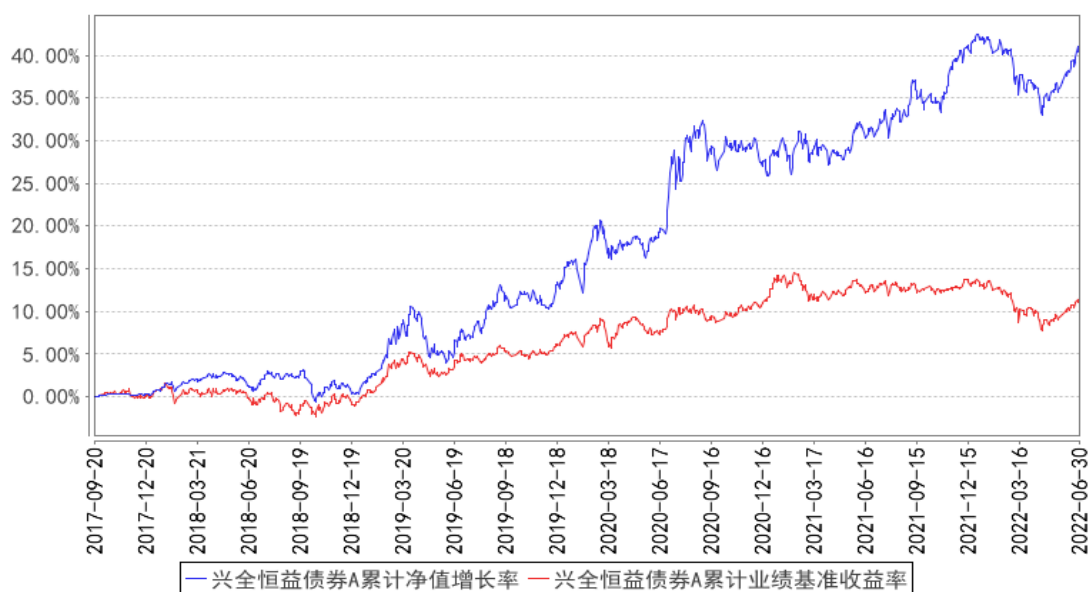
$$\text{Benchmark}_t = (1 + \text{Return}_t) \times (1 + \text{Benchmark}_{t-1}) - 1$$

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

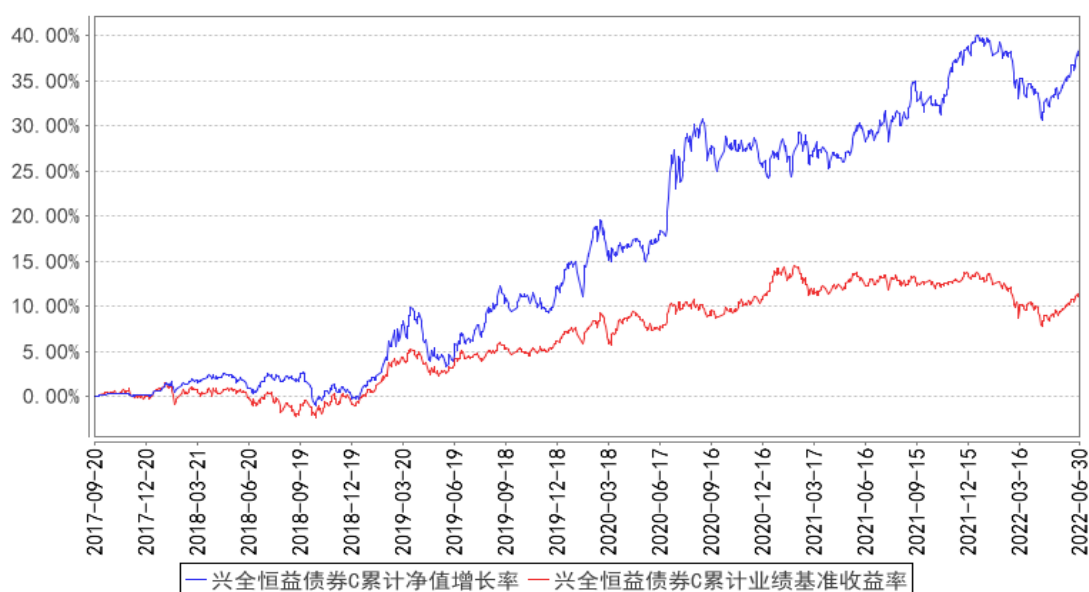


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

兴全恒益债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



兴全恒益债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、净值表现所取数据截至到 2022 年 6 月 30 日。

2、按照《兴全恒益债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金建仓期为 2017 年 9 月 20 日至 2018 年 3 月 20 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。

### 3.3 其他指标

注：无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

兴证全球基金管理有限公司（成立时名为“兴业基金管理有限公司”，以下简称“公司”）经证监基金字[2003]100号文批准于2003年9月30日成立。2008年1月，中国证监会批复（证监许可[2008]6号），同意全球人寿保险国际公司（AEGON International B.V）受让公司股权并成为公司股东。2008年4月9日，公司完成股权转让、变更注册资本等相关手续后，公司注册资本由9800万元变更为人民币1.2亿元，其中兴业证券股份有限公司的出资占注册资本的51%，全球人寿保险国际公司的出资占注册资本的49%。2008年7月，经中国证监会批准（证监许可[2008]888号），公司于2008年8月25日完成变更公司名称、注册资本等相关手续后，公司名称变更为“兴业全球基金管理有限公司”，注册资本增加为1.5亿元人民币，其中两股东出资比例不变。2016年12月28日，因公司发展需要，公司名称变更为“兴全基金管理有限公司”。2020年3月18日，公司名称变更为“兴证全球基金管理有限公司”。

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张睿	固定收益部副总监，兴全磐稳增利债券型证券投资基金、兴全恒益债券型证券投资基金、兴全恒瑞三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基	2017年9月20日	-	17年	硕士，历任红顶金融工程研究中心研究部经理，申银万国证券研究所高级分析师，兴证全球基金管理有限公司研究员、兴全货币市场基金基金经理、兴全保本混合型证券投资基金基金经理、兴全添利宝货币市场基金基金经理、兴全天添益货币市场基金基金经理、固定收益部总监助理、兴全兴泰定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。

	金经理				
徐明	兴全恒益债券型证券投资基金基金经理	2021 年 12 月 20 日	-	9 年	硕士, 历任国联证券股份有限公司分析师, 兴业证券股份有限公司分析师, 兴证全球基金管理有限公司研究部研究员、基金经理助理。

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

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

3、证券从业的涵义遵从行业的相关规定，包括资管相关行业从业经历。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本报告期末，本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划的投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全恒益债券型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，确保各投资组合之间得到公平对待，保护投资者的合法权益。公司风险管理部对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异进行统计，从不同的角度分析差异的来源、考察是否存在不公平的因素。

本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的公平交易制度，未发现违反公平交易原则的情况。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，债券市场收益率震荡下行，影响市场的主线有以下两条：一是疫情对国内经济的

阶段性影响，期间国内生产消费和供应链受到一定冲击；二是海外地缘冲突对原油为首的大宗商品价格造成扰动，海外通胀压力加大，美联储加息节奏加快，美债收益率大幅上行。上半年国内经济总体面临一定压力，地产投资下滑较为明显，财政政策在基建领域主动发力，出口仍保持一定韧性。国内货币政策总体保持定力“以我为主”，在房住不炒的大基调下房贷政策有所松动，1、5 年期 LPR 利率陆续下调。资金面维持宽松，回购利率二季度下行至接近 20 年疫情初期时的低位水平。债券市场在资金利率低位的支撑下，中短端收益率下行幅度较为明显，收益率曲线呈现陡峭化，信用利差压缩。股票和转债资产一季度普跌，但随着疫情后复工复产和稳经济政策力度加大，二季度亦有所反弹。传统煤炭等能源板块和新能源板块均有一定景气度支持，转债估值整体处于近几年偏高水平。本基金报告期内在债券投资上采取相对中性的操作策略，以优质信用债的持有票息为主。转债估值整体偏高的前提下本基金主动降低转债仓位，自下而上筛选优质标的。基于对于中国经济长远发展的信心，本基金在市场大幅下跌阶段加仓了组合中部分商业模式优秀、长期发展前景乐观且估值处于历史低位的个股，同时布局了部分跌幅较大的新能源领域的优质个股。

2022 年上半年市场面临多方面因素的大幅冲击。新冠疫情对全国经济造成较大的负面影响。国际市场方面，俄乌战争以及随之而来的全球能源价格的上涨导致海外市场通胀出现飙升，美联储加息及持续的加息预期下市场整体较为脆弱，权益市场一度呈现出无差别下跌的情形，此后市场呈现出较为迅速的反弹。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末兴全恒益债券 A 的基金份额净值为 1.4121 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.83%，同期业绩比较基准收益率为-1.95%；截至本报告期末兴全恒益债券 C 的基金份额净值为 1.3851 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.02%，同期业绩比较基准收益率为-1.95%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，疫情后的经济复苏和上游原材料价格压力的缓解程度是关注的重点。地产竣工有望阶段性改善，但地产投资链条的演绎仍需观察。海外加息渐入尾声，而国内货币政策总体预计仍将保持一定宽松，经济复苏亦需要资金从货币市场进入实体经济。当前债券收益率总体处于近年低位，但经济复苏未明显见效前资金面仍是债市支撑。本基金将保持中性久期和优质信用债配置，转债投资依然将自下而上在景气行业中寻找性价比品种，适当控制仓位，以绝对收益目标为主。

基于对于中国经济长远发展的信心，本基金在市场大幅下跌阶段加仓了组合中部分商业模式优秀、长期发展前景乐观且估值处于历史低位的个股，同时布局了部分跌幅较大的新能源领域的

优质个股。展望未来，本基金仍将继续坚持自下而上精选个股，伴随优质企业共同成长。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：1、估值委员会制定旗下基金的估值政策和流程，选取适当的估值方法、定期对估值政策和程序进行评价。采用的基金估值方法、政策和程序应经估值委员会审议，并报管理层批准后方可实施。2、估值方法确立后，由 IT 人员或 IT 人员协助估值系统开发商及时对系统中的参数或模型作相应的调整或对系统进行升级，以适应新的估值方法的需要。3、基金会计具体负责执行估值委员会确定的估值策略，并通过与托管行核对等方法确保估值准确无误；4、投资人员（包括基金经理）积极关注市场环境变化及证券发行机构有关影响证券价格的重重大事件等可能对给估值造成影响的因素，并就可能带来的影响提出建议和意见；5、监察稽核人员参与估值方案的制定，确保估值方案符合相关法律法规及基金合同的约定，定期对估值流程、系统估值模型及估值结果进行检查，确保估值委员会决议的有效执行，负责基金估值业务的定期和临时信息披露。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《兴全恒益债券型证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，本报告期内未进行利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

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

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对兴全恒益债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，兴全恒益债券型证券投资基金的管理人——兴证全球基金管理有限公司在兴全恒益债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费

用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，兴全恒益债券型证券投资基金未实施利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

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

本托管人依法对兴证全球基金管理有限公司编制和披露的兴全恒益债券型证券投资基金 2022 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：兴全恒益债券型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	21,996,275.34	6,420,599.38
结算备付金		25,006,537.27	32,252,715.96
存出保证金		275,745.77	133,779.12
交易性金融资产	6.4.7.2	7,490,209,877.00	4,670,888,063.66
其中：股票投资		1,315,866,722.72	831,212,069.84
基金投资		-	-
债券投资		6,174,343,154.28	3,839,675,993.82
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	-	240,000,270.00
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		1,883,155.93	28,159,888.86
应收股利		-	-
应收申购款		36,469,721.28	88,487,524.58
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.8	-	34,219,836.39
资产总计		7,575,841,312.59	5,100,562,677.95
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年6月30日</b>	<b>上年度末 2021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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		85,005,069.92	298,000,000.00
应付清算款		16,819,510.66	7,581,248.50
应付赎回款		2,249,588.30	348,820.05
应付管理人报酬		3,968,406.70	2,343,021.01
应付托管费		1,133,830.49	669,434.60
应付销售服务费		113,507.02	39,268.99
应付投资顾问费		-	-
应交税费		289,128.68	132,285.05
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	564,754.55	692,223.18
负债合计		110,143,796.32	309,806,301.38
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.10	5,295,627,394.03	3,366,108,345.27
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	2,170,070,122.24	1,424,648,031.30
净资产合计		7,465,697,516.27	4,790,756,376.57
负债和净资产总计		7,575,841,312.59	5,100,562,677.95

注：1. 报告截止日 2022 年 06 月 30 日，兴全恒益债券 A 基金份额净值 1.4121 元，基金份额总额 4,841,378,099.58 份；兴全恒益债券 C 基金份额净值 1.3851 元，基金份额总额 454,249,294.45 份。兴全恒益债券份额总额合计为 5,295,627,394.03 份。

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

## 6.2 利润表

会计主体：兴全恒益债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本 期	上年度可比期间
-----	-----	-----	---------

		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-55,771,525.22	105,923,574.92
1. 利息收入		1,043,004.90	36,189,750.76
其中：存款利息收入	6.4.7.13	426,661.60	376,234.81
债券利息收入		-	35,684,581.45
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		616,343.30	128,934.50
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		145,459,514.82	70,876,489.01
其中：股票投资收益	6.4.7.14	25,515,840.76	34,410,287.30
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	106,809,403.65	30,081,762.78
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	13,134,270.41	6,384,438.93
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）	6.4.7.20	-202,708,230.48	-1,646,484.58
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	434,185.54	503,819.73
<b>减：二、营业总支出</b>		34,214,075.31	23,351,664.13
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	24,289,977.05	11,956,459.77
2. 托管费	6.4.10.2.2	6,939,993.44	3,416,131.38
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	321,671.26	188,580.74
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		2,351,517.01	6,277,406.80
其中：卖出回购金融资产支出		2,351,517.01	6,277,406.80
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		191,396.19	102,443.67
8. 其他费用	6.4.7.23	119,520.36	1,410,641.77
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-89,985,600.53	82,571,910.79



“-”号填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列)		-89,985,600.53	82,571,910.79
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-89,985,600.53	82,571,910.79

注：以上比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号（年度报告和中期报告）》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：兴全恒益债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	3,366,108,345.27	-	1,424,648,031.30	4,790,756,376.57
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)	3,366,108,345.27	-	1,424,648,031.30	4,790,756,376.57
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,929,519,048.76	-	745,422,090.94	2,674,941,139.70
(一)、综合收益总额	-	-	-89,985,600.53	-89,985,600.53

(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)	1,929,519,048.76	-	835,407,691.47	2,764,926,740.23
其中:1. 基金申购款	3,438,926,966.80	-	1,389,690,966.84	4,828,617,933.64
2. 基金赎回款	-1,509,407,918.04	-	-554,283,275.37	-2,063,691,193.41
(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)	5,295,627,394.03	-	2,170,070,122.24	7,465,697,516.27
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	2,991,798,007.49	-	836,730,746.26	3,828,528,753.75

加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产(基金净值)	2,991,798,007.49	-	836,730,746.26	3,828,528,753.75
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-615,035,005.75	-	-93,208,219.70	-708,243,225.45
(一)、综合收益总额	-	-	82,571,910.79	82,571,910.79
(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)	-615,035,005.75	-	-175,780,130.49	-790,815,136.24
其中:1.基金申购款	1,257,321,612.94	-	361,825,911.16	1,619,147,524.10
2.基金赎回款	-1,872,356,618.69	-	-537,606,041.65	-2,409,962,660.34
(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、本期末净资产(基金净值)	2,376,763,001.74	-	743,522,526.56	3,120,285,528.30

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

兴全恒益债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予兴全恒益债券型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2017]1182号文),由兴证全球基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法规和《兴全恒益债券型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2017年9月20日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为3,955,626,246.97份基金份额。本基金的基金管理人为兴证全球基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《兴全恒益债券型证券投资基金基金合同》和《兴全恒益债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债券、可转债(含可分离交易可转债)、非公开发行公司债(含中小企业私募债、证券公司短期公司债券)、政府支持机构债券、可交换债券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具等金融工具,国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的

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。

基金的投资组合比例为:本基金投资于债券比例不低于基金资产的 80%,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,应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例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。

本基金业绩比较基准:中国债券总指数收益率 $\times$ 80%+沪深 300 指数收益率 $\times$ 20%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

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

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

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

##### (a) 新金融工具准则

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

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

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

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

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

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

(i) 金融工具的分类影响

以摊余成本计量的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产和应收利息，对应的账面价值分别为人民币 6,420,599.38 元、32,252,715.96 元、133,779.12 元、240,000,270.00 元和 34,219,836.39 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金和买入返售金融资产，对应的账面价值分别为人民币 6,430,042.57 元、32,267,229.76 元、133,839.32 元和 239,996,455.65 元。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币 4,670,888,063.66 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金

融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币 4,705,087,697.21 元。

以摊余成本计量的金融负债

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付交易费用、应付利息和其他负债，对应的账面价值分别为人民币 298,000,000.00 元、569,656.96 元、-47,363.45 元和 169,929.67 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款和其他负债，对应的账面价值分别为人民币 297,952,636.55 元和 739,586.63 元。

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

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

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

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

及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

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

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在



1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，其股息红利所得暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。

(e) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	21,996,275.34
等于：本金	21,990,297.83
加：应计利息	5,977.51
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	21,996,275.34

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,304,612,337.08	-	1,315,866,722.72	11,254,385.64
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	2,431,626,360.14	15,342,073.69	2,439,784,979.72	-7,183,454.11
交易所市场				

	银行间市场	3,706,835,799.79	43,926,774.56	3,734,558,174.56	-16,204,399.79
	合计	6,138,462,159.93	59,268,848.25	6,174,343,154.28	-23,387,853.90
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		7,443,074,497.01	59,268,848.25	7,490,209,877.00	-12,133,468.26

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末各项买入返售金融资产余额为零。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未通过买断式逆回购交易取得债券。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本报告期末本基金无债权投资。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本报告期内本基金未发生债权投资减值准备。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

##### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

## 6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	614.48
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	480,829.39
其中：交易所市场	472,104.30
银行间市场	8,725.09
应付利息	-
预提信息披露费	59,507.37
预提费用	23,803.31
合计	564,754.55

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 兴全恒益债券 A

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,277,278,838.25	3,277,278,838.25
本期申购	3,048,313,965.81	3,048,313,965.81
本期赎回（以“-”号填列）	-1,484,214,704.48	-1,484,214,704.48
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	4,841,378,099.58	4,841,378,099.58

## 兴全恒益债券 C

项目	本期
----	----

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	88,829,507.02	88,829,507.02
本期申购	390,613,000.99	390,613,000.99
本期赎回 (以“-”号填列)	-25,193,213.56	-25,193,213.56
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	454,249,294.45	454,249,294.45

注：申购含红利再投资、转入转换份额，赎回含转换转出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

##### 兴全恒益债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	960,070,333.58	429,099,323.17	1,389,169,656.75
本期利润	110,126,513.75	-207,864,331.48	-97,737,817.73
本期基金份额交易产生的变动数	456,756,777.74	246,949,567.17	703,706,344.91
其中：基金申购款	913,651,295.89	335,358,557.73	1,249,009,853.62
基金赎回款	-456,894,518.15	-88,408,990.56	-545,303,508.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,526,953,625.07	468,184,558.86	1,995,138,183.93

##### 兴全恒益债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	23,994,657.39	11,483,717.16	35,478,374.55
本期利润	2,596,116.20	5,156,101.00	7,752,217.20
本期基金份额交易产生的变动数	104,914,698.32	26,786,648.24	131,701,346.56
其中：基金申购款	112,033,219.54	28,647,893.68	140,681,113.22
基金赎回款	-7,118,521.22	-1,861,245.44	-8,979,766.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	131,505,471.91	43,426,466.40	174,931,938.31

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

活期存款利息收入	120,311.80
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	201,711.66
其他	104,638.14
合计	426,661.60

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	25,515,840.76
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	25,515,840.76

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	597,513,747.28
减：卖出股票成本总额	569,840,092.13
减：交易费用	2,157,814.39
买卖股票差价收入	25,515,840.76

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无证券出借差价收入。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	69,143,155.60
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	37,666,248.05
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	106,809,403.65

**6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,973,870,500.44
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,894,217,677.40
减：应计利息总额	41,873,479.25
减：交易费用	113,095.74
买卖债券差价收入	37,666,248.05

**6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入**

注：无。

**6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：无。

**6.4.7.16 资产支持证券投资收益****6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

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

注：无。

**6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

注：无。

**6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

注：无。

**6.4.7.17 贵金属投资收益****6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：无。

## 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

## 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

## 6.4.7.18 衍生工具收益

## 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内未进行衍生工具买卖交易。

## 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	13,134,270.41
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	13,134,270.41

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-202,708,230.48
股票投资	-108,174,292.18
债券投资	-94,533,938.30
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	-202,708,230.48

## 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	406,127.06
基金转换费收入	28,058.48
合计	434,185.54

## 6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

## 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	23,803.31
信息披露费	57,645.73
证券出借违约金	-
银行费用	20,971.32
账户维护费用	16,800.00
其他费用	300.00
合计	119,520.36

## 6.4.7.24 分部报告

无。

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

## 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须做披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

## 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
兴证全球基金管理有限公司（“兴证全球基金”）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
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：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
兴业证券	768,499,333.54	45.60	798,841,962.39	100.00

##### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
兴业证券	1,055,152,869.35	52.21	1,177,263,060.00	100.00

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
兴业证券	10,116,329,000.00	42.16	38,563,752,000.00	100.00

##### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
兴业证券	562,988.23	38.17	204,314.53	43.28

关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
兴业证券	585,696.18	100.00	249,628.89	100.00

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用兴业证券证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还从兴业证券获得证券研究综合服务。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	24,289,977.05	11,956,459.77
其中：支付销售机构的客户维护费	1,462,356.05	586,763.30

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.7%的年费率计提。计算方法如下：每日应支付的基金管理费=前一日的基金资产净值×0.7%/当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	6,939,993.44	3,416,131.38

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.2%的年费率计提。计算方法如下：每日应支付的基金托管费=前一日的基金资产净值×0.2%/当年天数。

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴全恒益债券 A	兴全恒益债券 C	合计
工商银行	-	14,509.92	14,509.92
兴业证券	-	36,784.95	36,784.95

兴证全球基金	-	126,494.87	126,494.87
合计	-	177,789.74	177,789.74
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴全恒益债券 A	兴全恒益债券 C	合计
兴证全球基金	-	41,365.98	41,365.98
工商银行	-	13,709.51	13,709.51
兴业证券	-	18,096.44	18,096.44
合计	-	73,171.93	73,171.93

注：兴全恒益 C 日基金销售服务费=兴全恒益 C 前一日基金资产净值×0.40%/当年天数

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

注：本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资本基金。

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

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

工商银行	21,996,275.34	120,311.80	25,843,773.14	50,421.22
------	---------------	------------	---------------	-----------

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。

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

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300353	东土科技	2022年1月14日	6个月	非公开发行流通受限	7.90	8.74	1,898,734	14,999,998.60	16,594,935.16	-
300383	光环新网	2021年12月29日	6个月	非公开发行流通受限	11.79	10.42	848,176	9,999,995.04	8,837,993.92	-
300506	名家汇	2021年12月28日	6个月以上	非公开发行流通受限	6.30	6.77	2,380,952	14,999,997.60	16,119,045.04	-
600309	万华化学	2022年5月16日	6个月	大宗交易购入流通受限	79.20	92.12	850,000	67,320,000.00	78,302,000.00	-
600309	万华化学	2022年5月31日	6个月	大宗交易购入流通受限	81.26	91.94	50,000	4,063,000.00	4,597,000.00	-

688400	凌云光	2022年6月28日	1个月内(含)	新股流通受限	21.93	21.93	500	10,965.00	10,965.00	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
127064	杭氧转债	2022年5月19日	1-2个月	新债未上市	100.00	100.02	2,371	237,100.00	237,144.69	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有临时停牌等流通受限股票。

#### 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

注：本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 06 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 85,005,069.92 元，于 2022 年 7 月 1 日，2022 年 7 月 4 日，2022 年 7 月 7 日先后到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有因参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、风险管理部和合规管理部以及审计部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立

了信用风险管理流程，本基金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；本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并采用券款对付交割方式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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	10,325,350.14	20,072,000.00
A-1 以下	1,500,000.00	1,500,000.00
未评级	2,058,454,020.18	940,533,000.00
合计	2,070,279,370.32	962,105,000.00

注：此处的信用证券不包括国债、央行票据、政策性金融债券等非信用债券投资。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

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

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	2,223,887,206.31	1,525,634,271.68
AAA 以下	1,141,546,809.01	1,028,157,222.14
未评级	40,744,536.99	-
合计	3,406,178,552.31	2,553,791,493.82

注：此处的信用证券不包括国债、央票、政策性金融债券等非信用债券投资。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

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

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-

未评级	97,996,147.67	-
合计	97,996,147.67	-

注：此处为主体信用评级。

### 6.4.13.3 流动性风险

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。本基金的流动性风险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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现，另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。

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人员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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制，对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限，控制基金的流动性结构；加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析，定期揭示基金的流动性风险；通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。本基金所持证券均可在证券交易所或银行间同业市场交易，除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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人根据申购赎回变动情况，制定现金头寸预测表，及时采取措施满足流动性需要；分析基金持有人结构，加强与主要持有机构的沟通，及时揭示可能的赎回需求；按照有关法律法规规定应对固定赎回，并进行适当报告和批露；在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金为开放式基金，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。

#### 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。

本基金持有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。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过对所持投资品种修正久期等参数的监控进行利率风险管理。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类：

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年6月 30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	21,996,275.34	-	-	-	-	-	21,996,275.34
结算备付金	25,006,537.27	-	-	-	-	-	25,006,537.27
存出保证金	275,745.77	-	-	-	-	-	275,745.77



交易性金融资产	550,764,755.92	955,264,183.02	2,316,449,506.93	1,749,686,807.30	600,677,901.11	1,317,366,722.72	7,490,209,877.00
应收申购款	35,993,415.52	-	-	-	-	476,305.76	36,469,721.28
应收清算款	-	-	-	-	-	1,883,155.93	1,883,155.93
资产总计	634,036,729.82	955,264,183.02	2,316,449,506.93	1,749,686,807.30	600,677,901.11	1,319,726,184.41	7,575,841,312.59
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,249,588.30	2,249,588.30
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,968,406.70	3,968,406.70
应付托管费	-	-	-	-	-	1,133,830.49	1,133,830.49
应付清算款	-	-	-	-	-	16,819,510.66	16,819,510.66
卖出回购金融资产款	85,005,069.92	-	-	-	-	-	85,005,069.92
应付销售服务费	-	-	-	-	-	113,507.02	113,507.02
应交税费	-	-	-	-	-	289,128.68	289,128.68
其他负债	-	-	-	-	-	564,754.55	564,754.55
负债总计	85,005,069.92	-	-	-	-	25,138,726.40	110,143,796.32
利率敏感度缺口	549,031,659.90	955,264,183.02	2,316,449,506.93	1,749,686,807.30	600,677,901.11	1,294,587,458.01	7,465,697,516.27
上年度末							
2021 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	6,420,599.38	-	-	-	-	-	6,420,599.38
结算备付金	32,252,715.96	-	-	-	-	-	32,252,715.96
存出保证金	133,779.12	-	-	-	-	-	133,779.12
交易性金融资产	130,223,000.00	431,234,000.00	1,406,772,100.00	1,488,848,358.56	381,098,535.26	832,712,069.84	4,670,888,063.66
买入返售金融资产	240,000,270.00	-	-	-	-	-	240,000,270.00
应收申购款	87,077,998.98	-	-	-	-	1,409,525.60	88,487,524.58

应收证券清算款	-	-	-	-	-	28,159,888.86	28,159,888.86
其他资产	-	-	-	-	-	34,219,836.39	34,219,836.39
资产总计	496,108,363.44	431,234,000.00	1,406,772,100.00	1,488,848,358.56	381,098,535.26	896,501,320.69	5,100,562,677.95
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	348,820.05	348,820.05
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,343,021.01	2,343,021.01
应付托管费	-	-	-	-	-	669,434.60	669,434.60
应付证券清算款	-	-	-	-	-	7,581,248.50	7,581,248.50
卖出回购金融资产款	298,000,000.00	-	-	-	-	-	298,000,000.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-	39,268.99	39,268.99
应交税费	-	-	-	-	-	132,285.05	132,285.05
其他负债	-	-	-	-	-	692,223.18	692,223.18
负债总计	298,000,000.00	-	-	-	-	11,806,301.38	309,806,301.38
利率敏感度缺口	198,108,363.44	431,234,000.00	1,406,772,100.00	1,488,848,358.56	381,098,535.26	884,695,019.31	4,790,756,376.57

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他影响债券公允价值的变量保持不变，仅利率发生变动；		
	假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化(即平移收益率曲线)。		
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(2022年6月30日)	上年度末(2021年12月31日)
分析	市场利率-1%	57,625,362.51	23,158,781.03
	市场利率+1%	-49,250,978.47	-21,159,429.61

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险，主要是基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,315,866,722.72	17.63	831,212,069.84	17.35
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	6,174,343,154.28	82.70	3,839,675,993.82	80.15
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	7,490,209,877.00	100.33	4,670,888,063.66	97.50

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假设单个证券的公允价值和市场组合的公允价值依照资本-资产定价模型 (CAPM) 描述的规律进行变动		
	使用本基金业绩比较基准所对应的市场组合进行分析		
	在业绩基准变化 10% 时，对单个证券相应的公允价值变化进行加总得到基金净值的变化		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)		
	本期末 (2022 年 6 月 30 日)	上年度末 (2021 年 12 月)	

			31 日 )
分析	业绩比较基准+10%	1,039,974,794.52	509,851,755.51
	业绩比较基准-10%	-1,039,974,794.52	-509,851,755.51

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

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

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

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	2,926,582,686.71	1,891,070,829.24
第二层次	4,437,676,216.17	2,542,406,479.40
第三层次	125,950,974.12	237,410,755.02
合计	7,490,209,877.00	4,670,888,063.66

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

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期

间、交易不活跃期间及限售期间不会将相关股票和可转换债券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,315,866,722.72	17.37
	其中：股票	1,315,866,722.72	17.37
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,174,343,154.28	81.50
	其中：债券	6,174,343,154.28	81.50
	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	47,002,812.61	0.62
8	其他各项资产	38,628,622.98	0.51
9	合计	7,575,841,312.59	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	48,903,006.54	0.66
B	采矿业	6,536,770.00	0.09

C	制造业	1,086,583,096.94	14.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	16,119,045.04	0.22
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	26,276,682.06	0.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	35,512,698.42	0.48
J	金融业	69,468,985.40	0.93
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	26,466,438.32	0.35
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	1,315,866,722.72	17.63

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600426	华鲁恒升	3,276,907	95,685,684.40	1.28
2	600519	贵州茅台	46,300	94,683,500.00	1.27
3	600309	万华化学	900,600	82,957,194.00	1.11
4	000333	美的集团	1,290,150	77,912,158.50	1.04
5	002250	联化科技	4,441,693	72,710,514.41	0.97
6	000568	泸州老窖	233,600	57,591,744.00	0.77
7	600346	恒力石化	2,492,510	55,433,422.40	0.74
8	300054	鼎龙股份	2,565,920	54,320,526.40	0.73
9	000858	五粮液	264,500	53,410,485.00	0.72
10	002714	牧原股份	884,802	48,903,006.54	0.66
11	603799	华友钴业	486,370	46,506,699.40	0.62
12	300059	东方财富	1,542,752	39,185,900.80	0.52
13	600882	妙可蓝多	715,010	33,462,468.00	0.45
14	600745	闻泰科技	384,000	32,682,240.00	0.44
15	300750	宁德时代	59,562	31,806,108.00	0.43

16	002142	宁波银行	845,660	30,283,084.60	0.41
17	603707	健友股份	992,599	27,991,291.80	0.37
18	601888	中国中免	113,624	26,466,438.32	0.35
19	002120	韵达股份	1,540,251	26,276,682.06	0.35
20	300408	三环集团	870,800	26,211,080.00	0.35
21	600438	通威股份	430,300	25,757,758.00	0.35
22	688005	容百科技	183,549	23,758,582.56	0.32
23	002812	恩捷股份	81,000	20,286,450.00	0.27
24	601799	星宇股份	118,600	20,280,600.00	0.27
25	600873	梅花生物	1,688,800	19,049,664.00	0.26
26	603517	绝味食品	320,978	18,558,947.96	0.25
27	300353	东土科技	1,898,734	16,594,935.16	0.22
28	300506	名家汇	2,380,952	16,119,045.04	0.22
29	688099	晶晨股份	147,970	14,944,970.00	0.20
30	601233	桐昆股份	849,600	13,491,648.00	0.18
31	600299	安迪苏	1,404,423	13,454,372.34	0.18
32	300454	深信服	113,025	11,729,734.50	0.16
33	002493	荣盛石化	743,256	11,438,709.84	0.15
34	603986	兆易创新	71,400	10,153,794.00	0.14
35	300383	光环新网	848,176	8,837,993.92	0.12
36	002304	洋河股份	42,700	7,820,505.00	0.10
37	000683	远兴能源	685,900	7,208,809.00	0.10
38	300346	南大光电	195,496	7,033,946.08	0.09
39	601012	隆基绿能	105,080	7,001,480.40	0.09
40	600938	中国海油	374,600	6,536,770.00	0.09
41	002430	杭氧股份	205,100	6,411,426.00	0.09
42	600559	老白干酒	168,400	4,831,396.00	0.06
43	600111	北方稀土	133,200	4,683,312.00	0.06
44	603786	科博达	54,500	3,355,565.00	0.04
45	688087	英科再生	35,167	2,035,114.29	0.03
46	688400	凌云光	500	10,965.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600309	万华化学	122,449,570.00	2.56
2	600519	贵州茅台	86,681,427.00	1.81
3	600426	华鲁恒升	66,918,576.12	1.40
4	600346	恒力石化	60,006,880.20	1.25
5	000333	美的集团	57,031,132.48	1.19
6	000568	泸州老窖	52,391,953.12	1.09

7	300054	鼎龙股份	51,762,305.72	1.08
8	603799	华友钴业	44,080,124.00	0.92
9	300059	东方财富	41,320,051.78	0.86
10	002250	联化科技	40,723,916.40	0.85
11	002714	牧原股份	35,307,522.84	0.74
12	603517	绝味食品	33,279,975.70	0.69
13	600745	闻泰科技	32,737,092.88	0.68
14	002142	宁波银行	32,031,250.57	0.67
15	000858	五粮液	31,345,127.52	0.65
16	300750	宁德时代	30,190,685.46	0.63
17	300408	三环集团	26,046,567.00	0.54
18	600882	妙可蓝多	25,453,188.65	0.53
19	601888	中国中免	22,904,094.20	0.48
20	002812	恩捷股份	19,889,003.00	0.42

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600309	万华化学	69,700,647.08	1.45
2	600195	中牧股份	52,254,641.28	1.09
3	002572	索菲亚	45,150,425.48	0.94
4	002821	凯莱英	31,173,658.90	0.65
5	002627	三峡旅游	23,533,875.23	0.49
6	002728	特一药业	23,519,675.77	0.49
7	000001	平安银行	21,927,405.00	0.46
8	300507	苏奥传感	20,729,088.87	0.43
9	002562	兄弟科技	18,719,716.00	0.39
10	002947	恒铭达	18,662,706.08	0.39
11	600900	长江电力	18,512,130.53	0.39
12	002001	新和成	18,299,579.49	0.38
13	688508	芯朋微	16,592,721.01	0.35
14	002739	万达电影	16,010,123.00	0.33
15	600152	维科技术	15,363,630.56	0.32
16	600887	伊利股份	15,052,214.00	0.31
17	603517	绝味食品	14,814,679.00	0.31
18	002493	荣盛石化	14,355,284.00	0.30
19	600346	恒力石化	12,480,007.92	0.26
20	603042	华脉科技	11,433,089.30	0.24

注：“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。



### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,162,669,037.19
卖出股票收入（成交）总额	597,513,747.28

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	306,238,489.45	4.10
2	央行票据	-	-
3	金融债券	853,270,578.64	11.43
	其中：政策性金融债	293,650,594.53	3.93
4	企业债券	470,602,307.97	6.30
5	企业短期融资券	2,070,279,370.32	27.73
6	中期票据	523,679,676.16	7.01
7	可转债（可交换债）	1,852,276,584.07	24.81
8	同业存单	97,996,147.67	1.31
9	其他	-	-
10	合计	6,174,343,154.28	82.70

### 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	042100464	21 万华化学 CP002	2,000,000	203,883,506.85	2.73
2	012105002	21 中铝 SCP009	1,500,000	152,615,013.70	2.04
3	2028005	20 中国银行小微债 01	1,300,000	131,410,126.03	1.76
4	210005	21 付息国债 05	1,100,000	118,264,426.23	1.58
5	019664	21 国债 16	1,100,000	111,810,841.10	1.50

### 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项目不适用。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.10.1 本期国债期货投资政策

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。基金管理人构建量化分析体系，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。

### 7.10.2 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。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1 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。

### 7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

### 7.11.3 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	275,745.77
2	应收清算款	1,883,155.93
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	36,469,721.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	38,628,622.98

### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113044	大秦转债	109,159,506.21	1.46
2	110081	闻泰转债	99,813,598.12	1.34
3	110075	南航转债	93,777,534.87	1.26
4	113052	兴业转债	78,170,073.98	1.05
5	113043	财通转债	68,780,948.08	0.92

6	127039	北港转债	61,088,624.24	0.82
7	113623	凤 21 转债	57,453,952.26	0.77
8	113602	景 20 转债	49,040,523.82	0.66
9	127024	盈峰转债	48,202,389.81	0.65
10	132020	19 蓝星 EB	44,657,443.90	0.60
11	113050	南银转债	42,939,409.59	0.58
12	123107	温氏转债	42,138,624.04	0.56
13	128129	青农转债	42,070,223.51	0.56
14	123133	佩蒂转债	36,850,649.24	0.49
15	123090	三诺转债	36,632,953.46	0.49
16	113037	紫银转债	36,427,974.29	0.49
17	123125	元力转债	35,546,796.64	0.48
18	127022	恒逸转债	30,684,961.01	0.41
19	110079	杭银转债	30,389,754.43	0.41
20	128134	鸿路转债	29,969,026.28	0.40
21	128048	张行转债	29,126,599.63	0.39
22	113011	光大转债	26,669,795.46	0.36
23	110062	烽火转债	26,481,371.92	0.35
24	110053	苏银转债	26,455,690.68	0.35
25	113048	晶科转债	25,559,123.29	0.34
26	113013	国君转债	24,991,192.33	0.33
27	123099	普利转债	24,116,231.08	0.32
28	123104	卫宁转债	23,383,452.05	0.31
29	127033	中装转 2	23,140,657.53	0.31
30	113621	彤程转债	21,115,260.03	0.28
31	110076	华海转债	20,560,357.64	0.28
32	128131	崇达转 2	20,509,563.81	0.27
33	123063	大禹转债	19,783,737.57	0.26
34	113606	荣泰转债	19,331,440.55	0.26
35	128133	奇正转债	18,942,250.02	0.25
36	127025	冀东转债	18,595,545.74	0.25
37	128125	华阳转债	17,943,173.08	0.24
38	123119	康泰转 2	17,442,668.86	0.23
39	123117	健帆转债	16,946,655.58	0.23
40	123120	隆华转债	16,604,198.45	0.22
41	113504	艾华转债	16,285,064.67	0.22
42	132021	19 中电 EB	16,038,505.55	0.21
43	123113	仙乐转债	15,255,562.34	0.20
44	128083	新北转债	13,030,054.80	0.17
45	113579	健友转债	11,971,074.53	0.16
46	123050	聚飞转债	11,677,139.57	0.16
47	127036	三花转债	11,332,504.11	0.15
48	113608	威派转债	11,235,901.37	0.15

49	127016	鲁泰转债	10,497,772.60	0.14
50	110045	海澜转债	9,824,732.88	0.13
51	128137	洁美转债	7,660,665.08	0.10
52	128034	江银转债	7,437,247.78	0.10
53	127006	敖东转债	6,689,745.21	0.09
54	127017	万青转债	5,109,099.78	0.07
55	110057	现代转债	3,654,479.85	0.05
56	123124	晶瑞转 2	1,398,702.31	0.02

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600309	万华化学	82,899,000.00	1.11	大宗交易购入 流通受限

### 7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
兴全恒益债券 A	6,184	782,887.79	4,652,576,132.02	96.10	188,801,967.56	3.90
兴全恒益债券 C	26,657	17,040.53	384,724,857.02	84.69	69,524,437.43	15.31
合计	32,841	161,250.49	5,037,300,989.04	95.12	258,326,404.99	4.88

### 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 (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	兴全恒益债券 A	130,351.82	0.0027
	兴全恒益债券 C	7,995.91	0.0018

金			
	合计	138,347.73	0.0026

注：对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总数）。

### 8.3 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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	兴全恒益债券 A	0
	兴全恒益债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	兴全恒益债券 A	0
	兴全恒益债券 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	兴全恒益债券 A	兴全恒益债券 C
基金合同生效日 （2017 年 9 月 20 日） 基金份额总额	3,176,108,296.00	779,517,950.97
本报告期期初基金份额总额	3,277,278,838.25	88,829,507.02
本报告期基金总申购份额	3,048,313,965.81	390,613,000.99
减：本报告期基金总赎回份额	1,484,214,704.48	25,193,213.56
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	4,841,378,099.58	454,249,294.45

注：总申购份额含红利再投资、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 报告期内基金管理人重大人事变动。

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

(2) 报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
兴业证券	3	768,499,333.54	45.60	562,988.23	38.17	-
光大证券	1	342,337,225.38	20.31	327,751.19	22.22	新增 1 个
中金公司	1	313,078,828.93	18.58	316,408.15	21.45	新增 1 个
中信建投证券	1	201,247,470.07	11.94	204,282.71	13.85	新增 1 个
国泰君安	1	60,069,086.77	3.56	63,507.06	4.31	新增 1 个
申万宏源证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
中银国际证券	1	-	-	-	-	新增 1 个

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
兴业证券	1,055,152,869.35	52.21	10,116,329,000.00	42.16	-	-
光大证券	148,871,244.61	7.37	279,000,000.00	1.16	-	-
中金公司	414,424,663.40	20.51	4,810,900,000.00	20.05	-	-
中信建投证券	263,498,812.38	13.04	6,323,500,000.00	26.36	-	-
国泰君安	139,130,427.77	6.88	2,463,000,000.00	10.27	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-

### 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	关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则工作的公告	证券时报、规定互联网站	2022-01-05
2	关于调整旗下部分基金单笔最低交易限额的公告	证券时报、规定互联网站	2022-01-06
3	关于旗下部分基金投资东土科技(300353)非公开发行股票的公告	证券时报、规定互联网站	2022-01-18
4	关于副总经理离任的公告	证券时报、规定互联网站	2022-01-21
5	关于我司旗下基金参与腾安基金销售赎回费率优惠活动的公告	证券时报、规定互联网站	2022-01-26
6	关于使用自有资金自购旗下偏股型公募基金壹亿元的公告	证券时报、规定互联网站	2022-01-27
7	关于公司副总经理任职的公告	证券时报、规定互联网站	2022-01-28
8	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、规定互联网站	2022-02-16
9	关于兴全恒益债券型证券投资基金暂停接受超过一千万元申购(含定投)、	证券时报、规定互联网站	2022-03-08

	转换转入申请的公告		
10	关于增加德邦证券为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、规定互联网网站	2022-03-15
11	关于增加南京银行为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、规定互联网网站	2022-03-21
12	关于增加兴业银行为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、规定互联网网站	2022-05-06
13	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、规定互联网网站	2022-05-27
14	关于调整网上直销基金转换、赎回申购、汇款交易优惠费率率的公告	证券时报、规定互联网网站	2022-06-17
15	关于公司副总经理变更的公告	证券时报、规定互联网网站	2022-06-30

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况,故不涉及本项特有风险。							

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

2、“赎回份额”包含份额赎回、转换转出等导致投资者持有份额减少的情形。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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



## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予兴全恒益债券型证券投资基金募集注册的文件；
2. 《兴全恒益债券型证券投资基金基金合同》；
3. 《兴全恒益债券型证券投资基金托管协议》；
4. 关于申请募集注册兴全恒益债券型证券投资基金的法律意见书；
5. 基金管理人业务资格批件和营业执照；
6. 基金托管人业务资格批件和营业执照；
7. 中国证监会要求的其他文件。

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

### 12.3 查阅方式

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

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

兴证全球基金管理有限公司

2022 年 8 月 31 日