

兴全恒益债券型证券投资基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：兴证全球基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 03 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	24
§ 8 投资组合报告	57
8.1 期末基金资产组合情况	57

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	58
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	58
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	61
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	61
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	61
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	61
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
8.14 投资组合报告附注	62
§ 9 基金份额持有人信息	65
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65
9.3 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	65
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	66
§ 10 开放式基金份额变动	66
§ 11 重大事件揭示	66
11.1 基金份额持有人大会决议	66
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	66
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	66
11.4 基金投资策略的改变	67
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	67
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	67
11.8 其他重大事件	68
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	69
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	69
§ 13 备查文件目录	69
13.1 备查文件目录	69
13.2 存放地点	69
13.3 查阅方式	69

§ 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	4,654,453,365.49 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	4,187,975,271.89 份	466,478,093.60 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。（详见本基金基金合同及招募说明书）
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		021-20398988	010-66105798
注册地址		上海市黄浦区金陵东路 368 号	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市浦东新区芳甸路 1155 号 嘉里城办公楼 28-29 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		201204	100140

法定代表人	杨华辉	陈四清
-------	-----	-----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.xqfunds.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街1号东方广场毕马威大楼8层
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28-30楼

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年		2022 年		2021 年	
	兴全恒益 债券 A	兴全恒益 债券 C	兴全恒益 债券 A	兴全恒益 债券 C	兴全恒益 债券 A	兴全恒益 债券 C
本期已实现收益	14,378,116.22	1,946,109.65	114,755,145.59	1,684,222.16	184,944,934.58	5,541,293.25
本期利润	87,081,234.27	18,947,517.47	330,727,677.60	16,890,443.09	352,688,333.33	10,581,505.73
加权平均基金份额本期利润	-0.0203	-0.0365	-0.0687	-0.0556	0.1418	0.1376
本期加权平均净值利润率	-1.55%	-2.85%	-4.99%	-4.13%	10.70%	10.53%
本期基金份额净值增长率	-1.01%	-1.40%	-4.19%	-4.56%	11.22%	10.78%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	1,053,625,287.05	101,576,482.67	1,002,976,193.40	89,529,956.82	960,070,333.58	23,994,657.39

期末可供分配基金份额利润	0.2516	0.2178	0.2479	0.2193	0.2929	0.2701
期末基金资产净值	5,372,864,693.53	582,844,789.11	5,243,979,396.21	517,411,588.48	4,666,448,495.00	124,307,881.57
期末基金份额净值	1.2829	1.2495	1.2960	1.2673	1.4239	1.3994
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
基金份额累计净值增长率	35.05%	31.68%	36.43%	33.56%	42.39%	39.94%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	-2.46%	0.36%	-0.76%	0.17%	-1.70%	0.19%
过去六个月	-2.22%	0.32%	-1.55%	0.17%	-0.67%	0.15%
过去一年	-1.01%	0.33%	-0.94%	0.16%	-0.07%	0.17%
过去三年	5.49%	0.38%	-4.25%	0.23%	9.74%	0.15%
过去五年	34.39%	0.44%	8.48%	0.24%	25.91%	0.20%
自基金合同生效	35.05%	0.40%	7.77%	0.24%	27.28%	0.16%

起至今						
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
过去三个月	-2.56%	0.36%	-0.76%	0.17%	-1.80%	0.19%
过去六个月	-2.41%	0.32%	-1.55%	0.17%	-0.86%	0.15%
过去一年	-1.40%	0.33%	-0.94%	0.16%	-0.46%	0.17%
过去三年	4.24%	0.38%	-4.25%	0.23%	8.49%	0.15%
过去五年	31.73%	0.44%	8.48%	0.24%	23.25%	0.20%
自基金合同生效 起至今	31.68%	0.40%	7.77%	0.24%	23.91%	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、银行间市场记帐式国债（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市场中选取 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。

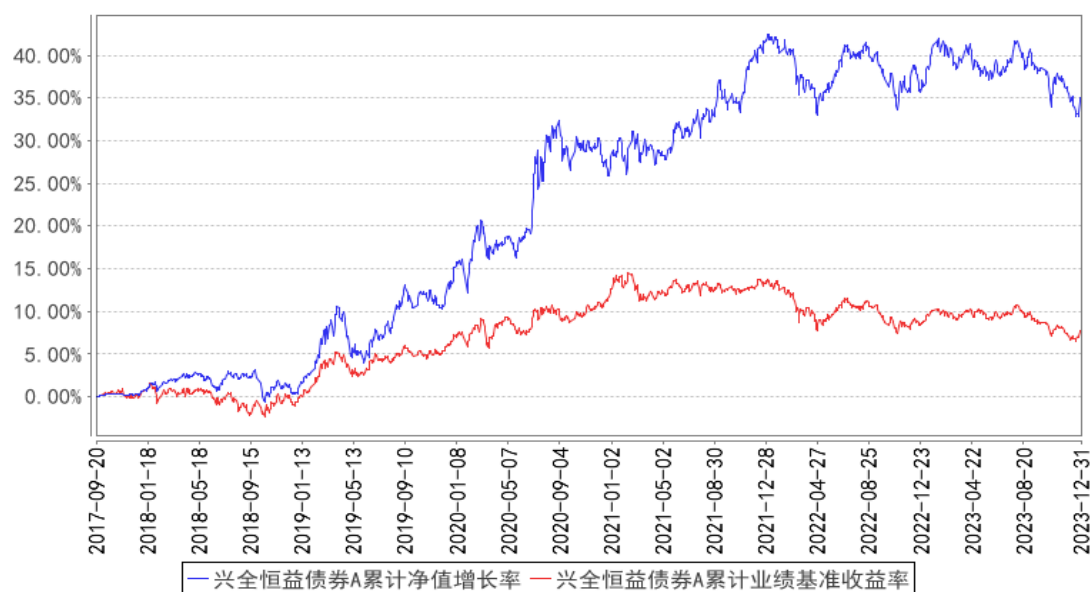
本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，按下列公式计算：

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

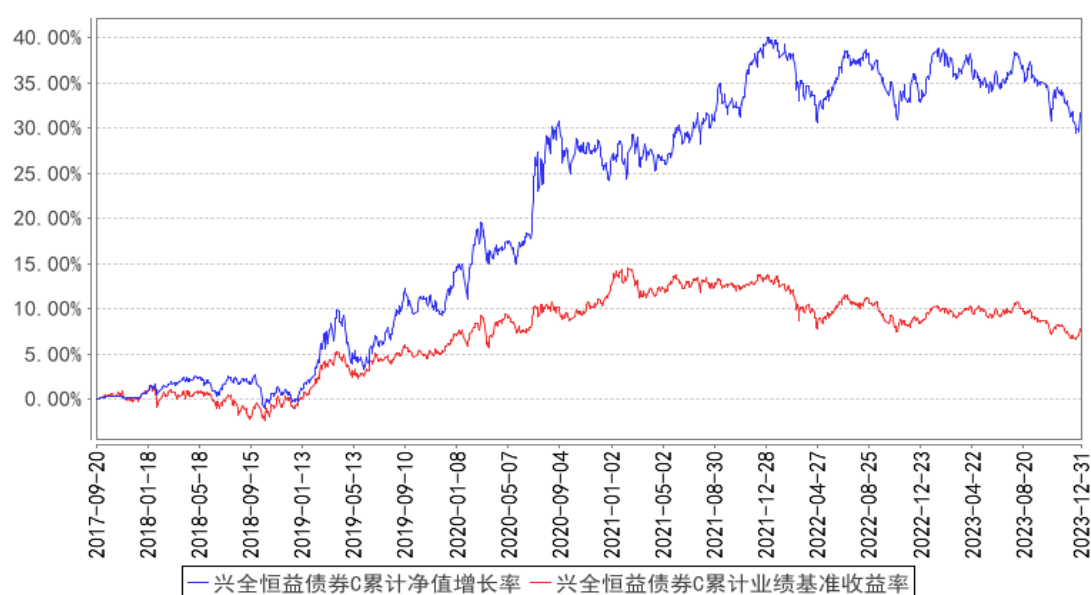
其中，t=1, 2, 3, …T, T 表示时间截至日。

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

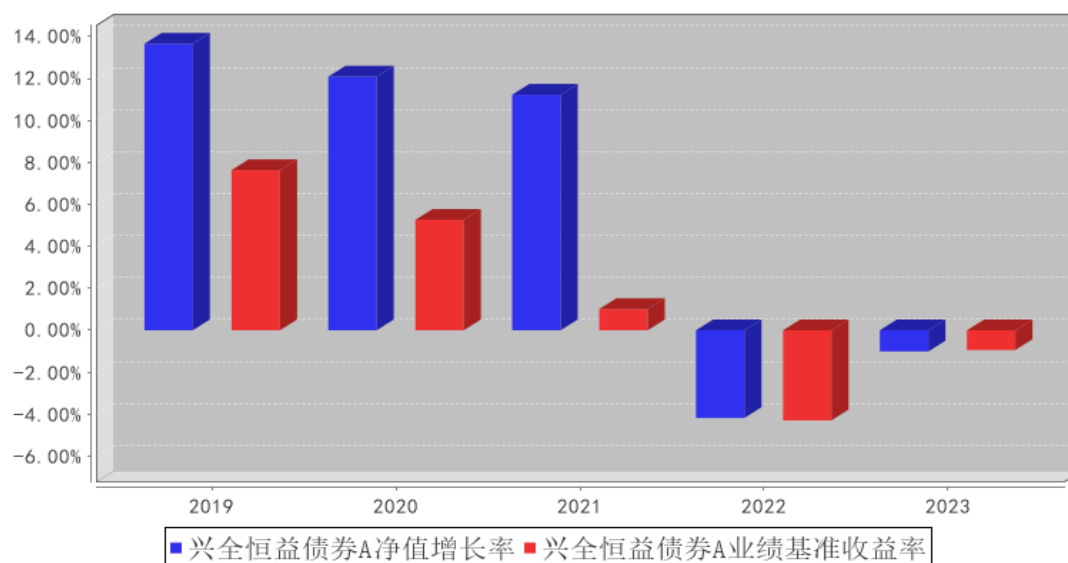


注：1、净值表现所取数据截至到 2023 年 12 月 31 日。

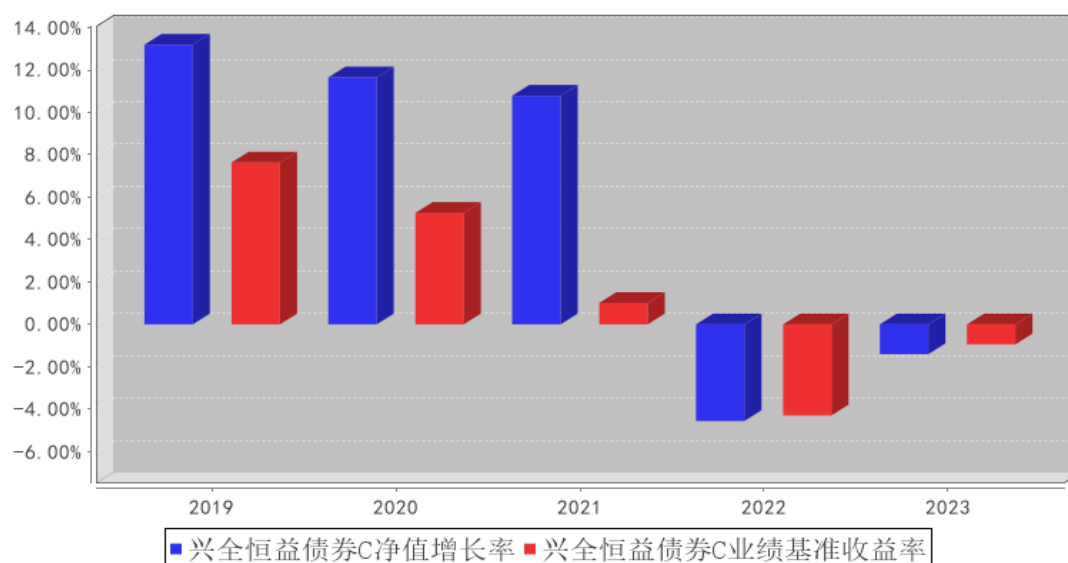
2、按照《兴全恒益债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金建仓期为 2017 年 9 月 20 日至 2018 年 3 月 19 日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴全恒益债券A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



兴全恒益债券C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 其他指标

注：无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

兴全恒益债券 A

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2022 年	0.6788	201,435,195.26	85,847,873.81	287,283,069.07	—
合计	0.6788	201,435,195.26	85,847,873.81	287,283,069.07	—

		5.26	81	9.07	
--	--	------	----	------	--

兴全恒益债券 C

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2022 年	0.6788	26,888,117.13	1,971,667.07	28,859,784.20	—
合计	0.6788	26,888,117.13	1,971,667.07	28,859,784.20	—

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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	2017 年 9 月 20 日	—	18 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。

	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金经理、兴证全球招益债券型证券投资基金基金经理				
徐留明	兴全恒益债券型证券投资基金基金经理、兴全汇享一年持有期混合型证券投资基金基金经理、兴证全球招益债券型证券投资基金基金经理	2021 年 12 月 20 日	-	10 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。
卜学欢	现任兴全兴泰定开债券发起式基金、兴证全球兴益债券基金、兴证全球恒泰一年定开债券发起式基金、兴全恒瑞三个月定期开放债券发起式基金、兴	2023 年 1 月 3 日	-	6 年	硕士，历任兴证全球基金管理有限公司交易部债券交易员、固定收益部研究员。

	全恒益债券基金、兴全磐稳增利债券基金、兴全祥泰定开债券发起式基金、兴全稳益定开债券发起式基金基金经理助理。				
--	---	--	--	--	--

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。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本报告期末，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本报告期末，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年国内市场在疫情影响消退后经历经济强预期、弱现实反复拉锯的阶段，商务、物流、消费场景等恢复，但疤痕效应仍在，政策方面总体稳中求进，坚持高质量发展。从周期的视角看，上半年 PPI、库存和工业企业利润增速加速见底，而产能周期尚在消化；下半年稳经济的各项政策密集出台，地产政策逐步放松，地方政府债务进行置换，但需求呈现弱复苏，地产链条资金压力仍大，地产投资持续下滑。同时年内海外美国经济持续强劲、加息周期尚未反转，对人民币汇率形成一定压力。权益市场在多重因素叠加的影响下表现弱势，部分指数录得较大跌幅，而债券资产全年表现最好，转债资产前三季度正收益，四季度则经历较明显的估值压缩。本基金年内在权益资产和转债资产上布局总体较为积极，纯债资产相对中性配置，四季度受到顺周期板块和转债调整的一定压力。

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 1.2829 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.01%，同期业绩比较基准收益率为-0.94%；兴全恒益债券 C 的基金份额净值为 1.2495 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.40%，同期业绩比较基准收益率为-0.94%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内经济仍处于高质量发展的结构转型期，一方面传统制造业在降本增效、资本开支、分红等方面向着更务实的方向发展，另一方面新质生产力、科技进步仍是未来发展的重点方向。年内

支持低利率环境的基本面格局尚未逆转，但整体收益率水平大幅下降，收益率曲线平坦化，相比之下债性转债和部分平衡型转债在估值调整过程中出现良好的性价比，本基金将对债券资产保持绝对收益思路，筛选信用资质良好的品种配置，并在转债资产中积极寻找自下而上的投资机会。

权益资产方面，我们相信尽管部分传统行业的需求增速未来可能保持平稳或低速增长，但随着供给端的竞争及调整，优质公司的盈利能力将在竞争格局趋于稳定后保持较为合理的水平，而股东回报能力也将得以显著提升。同时部分具有良好的商业模式的消费类公司，是全社会中少有的具备特许经营权的优质资产，此类公司当前估值下股东回报水平已经远超长期国债收益率甚至逐步超越传统意义上的高股息资产，对于此类资产的长期回报我们有足够信心。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：1、估值委员会制定旗下基金的估值政策和流程，选取适当的估值方法、定期对估值政策和程序进行评价。采用的基金估值方法、政策和程序应经估值委员会

审议，并报管理层批准后方可实施。2、估值方法确立后，由 IT 人员或 IT 人员协助估值系统开发商及时对系统中的参数或模型作相应的调整或对系统进行升级，以适应新的估值方法的需要。3、基金会计具体负责执行估值委员会确定的估值策略，并通过与托管行核对等方法确保估值准确无误；4、投资人员（包括基金经理）积极关注市场环境变化及证券发行机构有关影响证券价格的重大事件等可能对估值造成影响的因素，并就可能带来的影响提出建议和意见；5、合规管理人员参与估值方案的制定，确保估值方案符合相关法律法规及基金合同的约定；负责基金估值业务的定期和临时信息披露。6、审计部对估值流程、估值结果等进行检查，确保估值委员会决议的有效执行。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《兴全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，本基金未实施利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、

投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2401725 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	兴全恒益债券型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的兴全恒益债券型证券投资基金（以下简称“该基金”）财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表、2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“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编制，公允反映了该基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	该基金管理人兴证全球基金管理有限公司（以下简称“该基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2023 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需

	要报告。	
管理层和治理层对财务报表的责任	该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 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编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。 该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。	
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3) 评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (4) 对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。 (5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。	
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	叶凯韵	欧梦澈
会计师事务所的地址	北京市东长安街 1 号 东方广场毕马威大楼 8 层	

审计报告日期	2024 年 03 月 27 日
--------	------------------

§ 7 年度财务报表

7.1 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：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	6,283,155.44	2,291,355.42
结算备付金		68,223,073.84	46,544,818.99
存出保证金		132,550.42	189,354.23
交易性金融资产	7.4.7.2	6,986,052,829.59	6,520,228,418.15
其中：股票投资		1,163,320,874.10	1,261,063,753.35
基金投资		-	-
债券投资		5,822,731,955.49	5,259,164,664.80
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		9,206,939.14	11,310,094.86
应收股利		-	-
应收申购款		4,342.66	47,706,799.33
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		7,069,902,891.09	6,628,270,840.98
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		1,098,758,813.09	737,880,775.98
应付清算款		-	-

应付赎回款		9,969,096.73	123,348,786.64
应付管理人报酬		3,630,198.99	3,606,528.15
应付托管费		1,037,199.72	1,030,436.62
应付销售服务费		214,245.47	178,888.39
应付投资顾问费		—	—
应交税费		95,149.83	129,973.40
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	7.4.7.9	488,704.62	704,467.11
负债合计		1,114,193,408.45	866,879,856.29
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	4,654,453,365.49	4,454,506,333.50
其他综合收益	7.4.7.11	—	—
未分配利润	7.4.7.12	1,301,256,117.15	1,306,884,651.19
净资产合计		5,955,709,482.64	5,761,390,984.69
负债和净资产总计		7,069,902,891.09	6,628,270,840.98

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，兴全恒益债券 A 基金份额净值 1.2829 元，基金份额总额 4,187,975,271.89 份；兴全恒益债券 C 基金份额净值 1.2495 元，基金份额总额 466,478,093.60 份。兴全恒益债券型证券投资基金份额总额合计为 4,654,453,365.49 份。

7.2 利润表

会计主体：兴全恒益债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-33,163,690.01	-276,453,846.25
1. 利息收入		1,155,948.11	1,424,284.06
其中：存款利息收入	7.4.7.13	921,973.80	697,409.87
债券利息收入		—	—
资产支持证券 利息收入		—	—
买入返售金融 资产收入		233,974.31	726,874.19
其他利息收入		—	—
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		83,850,523.53	185,279,579.63
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-104,451,184.17	-17,453,136.14
基金投资收益		—	—
债券投资收益	7.4.7.15	167,710,893.02	185,106,826.92

资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	20,590,814.68	17,625,888.85
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	-118,460,758.31	-464,057,488.44
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	290,596.66	899,778.50
减：二、营业总支出		72,865,061.73	71,164,274.44
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	44,187,461.45	49,274,841.09
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	12,624,989.04	14,078,526.05
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	2,676,493.93	1,602,908.99
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		13,010,366.26	5,623,408.48
其中：卖出回购金融资产支出		13,010,366.26	5,623,408.48
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		121,084.47	343,221.75
8. 其他费用	7.4.7.23	244,666.58	241,368.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-106,028,751.74	-347,618,120.69
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-106,028,751.74	-347,618,120.69
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-106,028,751.74	-347,618,120.69

7.3 净资产变动表

会计主体：兴全恒益债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	4,454,506,333.50	-	1,306,884,651.19	5,761,390,984.69
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	4,454,506,333.50	-	1,306,884,651.19	5,761,390,984.69
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	199,947,031.99	-	-5,628,534.04	194,318,497.95
(一)、综合收益总额	-	-	-106,028,751.74	-106,028,751.74
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	199,947,031.99	-	100,400,217.70	300,347,249.69
其中：1. 基金申购款	3,092,939,134.64	-	985,486,464.71	4,078,425,599.35
2. 基金赎回款	-2,892,992,102.65	-	-885,086,247.01	-3,778,078,349.66
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	4,654,453,365.49	-	1,301,256,117.15	5,955,709,482.64

项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	3,366,108,345. 27	—	1,424,648,031. 30	4,790,756,376.5 7
加：会计政策变更	—	—	—	—
前期差错更正	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
二、本期期初净资产	3,366,108,345. 27	—	1,424,648,031. 30	4,790,756,376.5 7
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,088,397,988. 23	—	— 117,763,380.11	970,634,608.12
(一)、综合收益总额	—	—	— 347,618,120.69	-347,618,120.69
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	1,088,397,988. 23	—	545,997,593.85	1,634,395,582.0 8
其中：1. 基金申购款	4,396,027,935. 68	—	1,749,465,419. 68	6,145,493,355.3 6
2. 基金赎回款	— 3,307,629,947. 45	—	— 1,203,467,825. 83	— 4,511,097,773.2 8
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	—	—	— 316,142,853.27	-316,142,853.27
(四)、其他综合收益结转留存收益	—	—	—	—
四、本期期末净资产	4,454,506,333.	—	1,306,884,651.	5,761,390,984.6

	50		19	9
--	----	--	----	---

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>杨华辉</u>	<u>庄园芳</u>	<u>詹鸿飞</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

兴全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”)于 2017 年 7 月 11 日印发的证监许可[2017]1182 号文核准公开募集，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》及其配套规则和《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（更新）》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及存托凭证（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及存托凭证）、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，基金管理人可在履行适当程序后，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为：中国债券总指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×20%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。本基金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和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 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 2023 年 12 月 31 日的财务状况、2023 年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币,编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资和买入返售金融资产等。

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征,在初始确认时将金融资产分为不同类别: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及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式,在此情形下,所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类,否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,分类为以摊余成本计量的金融资产:

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标;
- 该金融资产的合同条款规定,在特定日期产生的现金流量,仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外,本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收

益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

– 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

– 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b) 后续计量

– 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

– 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

– 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

– 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

– 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内（若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，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，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，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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，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。

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，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 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。

7.4.4.7 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份额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。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计

量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的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。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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相应类别的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；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；由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”）在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证监会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财税[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《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》、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《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税〔2016〕36号文《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》、财税〔2023〕39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 资管产品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。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券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。

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

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。

c) 对基金从上市公司、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，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。

对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

d) 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。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

e) 对基金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附加。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	6,283,155.44	2,291,355.42
等于：本金	6,281,773.67	2,290,579.80
加：应计利息	1,381.77	775.62
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	6,283,155.44	2,291,355.42

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,350,669,115.13	-	1,163,320,874.10	- 187,348,241.03
贵金属投资- 金交所黄金合 约		-	-	-	-
债券	交易所 市场	3,249,202,960.95	10,407,814.66	3,064,708,627.47	- 194,902,148.14
	银行间 市场	2,725,531,095.36	42,185,328.02	2,758,023,328.02	-9,693,095.36
	合计	5,974,734,056.31	52,593,142.68	5,822,731,955.49	- 204,595,243.50
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		7,325,403,171.44	52,593,142.68	6,986,052,829.59	- 391,943,484.53

项目		上年度末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,365,492,202.69	—	1,261,063,753.35	— 104,428,449.34
贵金属投资— 金交所黄金合 约		—	—	—	—
债 券	交易所 市场	2,768,741,637.25	8,978,326.37	2,635,654,721.42	— 142,065,242.20
	银行间 市场	2,614,396,634.68	36,102,343.38	2,623,509,943.38	-26,989,034.68
	合计	5,383,138,271.93	45,080,669.75	5,259,164,664.80	— 169,054,276.88
资产支持证券		—	—	—	—
基金		—	—	—	—
其他		—	—	—	—
合计		6,748,630,474.62	45,080,669.75	6,520,228,418.15	— 273,482,726.22

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末无期货合约。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末无黄金衍生品。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均无买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未通过买断式逆回购交易取得债券。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末均无债权投资。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内无债权投资减值准备。

7.4.7.6 其他债权投资**7.4.7.6.1 其他债权投资情况**

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他债权投资。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内无其他债权投资减值准备。

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

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他权益工具投资。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他权益工具投资。

7.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他资产。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	7,362.31	77,217.60
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	313,342.31	459,249.51
其中：交易所市场	287,335.67	442,857.56
银行间市场	26,006.64	16,391.95
应付利息	-	-
预提费用	168,000.00	168,000.00
合计	488,704.62	704,467.11

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

兴全恒益债券 A

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,046,222,537.10	4,046,222,537.10
本期申购	2,203,459,312.96	2,203,459,312.96
本期赎回（以“-”号填列）	-2,061,706,578.17	-2,061,706,578.17
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	4,187,975,271.89	4,187,975,271.89

兴全恒益债券 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	408,283,796.40	408,283,796.40
本期申购	889,479,821.68	889,479,821.68
本期赎回(以“-”号填列)	-831,285,524.48	-831,285,524.48
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	466,478,093.60	466,478,093.60

注：申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末无其他综合收益。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

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
上年度末	1,002,976,193.40	194,780,665.71	1,197,756,859.11
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	1,002,976,193.40	194,780,665.71	1,197,756,859.11
本期利润	14,378,116.22	-101,459,350.49	-87,081,234.27
本期基金份额交易产生的变动数	36,270,977.43	37,942,819.37	74,213,796.80
其中：基金申购款	553,115,339.17	166,767,378.25	719,882,717.42
基金赎回款	-516,844,361.74	-128,824,558.88	-645,668,920.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,053,625,287.05	131,264,134.59	1,184,889,421.64

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
上年度末	89,529,956.82	19,597,835.26	109,127,792.08
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-

本期期初	89,529,956.82	19,597,835.26	109,127,792.08
本期利润	-1,946,109.65	-17,001,407.82	-18,947,517.47
本期基金份额交易产生的变动数	13,992,635.50	12,193,785.40	26,186,420.90
其中：基金申购款	196,953,546.32	68,650,200.97	265,603,747.29
基金赎回款	-182,960,910.82	-56,456,415.57	-239,417,326.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	101,576,482.67	14,790,212.84	116,366,695.51

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	77,931.30	168,625.31
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	791,239.36	394,262.91
其他	52,803.14	134,521.65
合计	921,973.80	697,409.87

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-104,451,184.17	-17,453,136.14
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	-104,451,184.17	-17,453,136.14

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

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

卖出股票成交总额	733,658,250.31	1,080,959,989.56
减：卖出股票成本总额	836,336,043.09	1,094,923,332.44
减：交易费用	1,773,391.39	3,489,793.26
买卖股票差价收入	-104,451,184.17	-17,453,136.14

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无股票投资收益证券出借差价收入。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
债券投资收益——利息收入	112,992,370.01	135,751,161.95
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	54,718,523.01	49,355,664.97
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	167,710,893.02	185,106,826.92

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,139,906,008.96	7,062,843,890.69
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,032,766,006.99	6,906,163,055.51
减：应计利息总额	52,302,709.83	107,125,003.41
减：交易费用	118,769.13	200,166.80
买卖债券差价收入	54,718,523.01	49,355,664.97

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益赎回差价收入。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益申购差价收入。

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

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

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益赎回差价收入。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益申购差价收入。

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益买卖贵金属差价收入。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益赎回差价收入。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益申购差价收入。

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益买卖权证差价收入。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益其他投资收益。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

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

	31 日	月 31 日
股票投资产生的股利收益	20,590,814.68	17,625,888.85
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	20,590,814.68	17,625,888.85

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-118,460,758.31	-464,057,488.44
股票投资	-82,919,791.69	-223,857,127.16
债券投资	-35,540,966.62	-240,200,361.28
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	-118,460,758.31	-464,057,488.44

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	276,028.04	871,356.69
基金转换费收入	14,568.62	28,421.81
合计	290,596.66	899,778.50

7.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	48,000.00	48,000.00

信息披露费	120,000.00	118,138.36
证券出借违约金	-	-
银行费用	42,766.58	39,529.72
账户维护费用	32,700.00	34,800.00
其他	1,200.00	900.00
合计	244,666.58	241,368.08

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要在财务报表附注中说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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

注：下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
兴业证券	1,474,923,585.99	100.00	1,815,749,545.44	66.45

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例（%）	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
兴业证券	3,307,234,957.04	100.00	3,320,374,663.35	77.46

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券 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	117,433,504,000.00	100.00	43,945,628,000.00	76.00

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 （%）
兴业证券	1,087,254.38	100.00	287,335.67	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 （%）
兴业证券	1,328,967.07	59.30	442,857.56	100.00

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

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	44,187,461.45	49,274,841.09
其中：应支付销售机构的客户维护费	4,308,984.04	2,980,455.99
应支付基金管理人的净管理费	39,878,477.41	46,294,385.10

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.70% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

计算方法如下：每日应支付的基金管理费=前一日基金资产净值×0.70%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	12,624,989.04	14,078,526.05

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

计算方法如下：每日应支付的基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

7.4.10.2.3 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	-	27,157.75	27,157.75
兴业证券	-	46,018.97	46,018.97
兴证全球基金	-	1,874,891.50	1,874,891.50
合计	-	1,948,068.22	1,948,068.22
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期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	-	29,840.22	29,840.22

兴业证券	-	65,751.59	65,751.59
兴证全球基金	-	1,172,909.49	1,172,909.49
合计	-	1,268,501.30	1,268,501.30

注：A 类份额不收取销售服务费，C 类份额的基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算方法如下：每日应支付的 C 类基金份额销售服务费=C 类基金份额前一日的基金资产净值×0.40%/当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内及上年度可比期间内本基金的基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	6,283,155.44	77,931.30	2,291,355.42	168,625.31

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

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金在本报告期内未进行过利润分配。

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

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
688625	呈和科技	2023 年 7 月 4 日	6 个月	非公开发行流通受限	49.12	39.22	66,476	3,265,301.12	2,607,188.72	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 409,816,793.58 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
170404	17 农发 04	2024 年 1 月 2 日	103.80	500,000	51,898,767.12
200004	20 附息国债 04	2024 年 1 月 2 日	109.90	700,000	76,927,557.69
210202	21 国开 02	2024 年 1 月 2 日	102.94	800,000	82,354,279.46
210406	21 农发 06	2024 年 1 月	101.54	1,100,000	111,689,251.37

		2 日			
220024	22 付息国 债 24	2024 年 1 月 2 日	105.03	160,000	16,804,747.54
1928021	19 农业银 行永续债 01	2024 年 1 月 3 日	102.61	1,112,000	114,097,665.40
合计				4,372,000	453,772,268.58

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 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 688,942,019.51 元，于 2024 年 1 月 2 日到期。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。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。本基金管理人制定了政策和程序以识别及分析相关风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

7.4.13.2 信用风险

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

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	1,500,000.00
未评级	151,994,692.89	760,690,799.77
合计	151,994,692.89	762,190,799.77

注：此处列示的信用证券不包括国债、央行票据、政策性金融债券等非信用债券投资。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

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

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	2,707,987,527.80	2,071,527,519.85
AAA 以下	1,923,971,486.30	1,600,185,592.26
未评级	102,439,272.13	90,317,523.29
合计	4,734,398,286.23	3,762,030,635.40

注：此处列示的信用证券不包括国债、央行票据、政策性金融债券等非信用债券投资。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	197,725,899.46	-
合计	197,725,899.46	-

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

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

本基金所持大部分证券为剩余期限较短、信誉良好的国债、企业债及央行票据等，主要在银行间

同业市场交易。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金、提前支取定期存款等方式应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金为契约型开放式基金，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。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 20 23	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
-------------------------	--------	--------	----------	-------	-------	-----	----

年 12 月 31 日							
资 产							
货 币 资 金	6,283,155.44	-	-	-	-	-	6,283,155.44
结 算 备 付 金	68,223,073.84	-	-	-	-	-	68,223,073.84
存 出 保 证 金	132,550.42	-	-	-	-	-	132,550.42
交 易 性 金 融 资 产	226,851,476.87	417,795,603.99	1,441,842,015.65	3,457,023,832.47	279,219,026.51	1,163,320,874.10	6,986,052,829.59
应 收 申 购 款	2,069.70	-	-	-	-	2,272.96	4,342.66
应 收 清 算 款	-	-	-	-	-	9,206,939.14	9,206,939.14
资 产 总 计	301,492,326.27	417,795,603.99	1,441,842,015.65	3,457,023,832.47	279,219,026.51	1,172,530,086.20	7,069,902,891.09
负 债							
应	-	-	-	-	-	9,969,096.7	9,969,096.7

付 赎 回 款						3	3
应 付 管 理 人 报 酬	-	-	-	-	-	3,630,198.99	3,630,198.99
应 付 托 管 费	-	-	-	-	-	1,037,199.72	1,037,199.72
卖 出 回 购 金 融 资 产 款	1,098,758,813.09	-	-	-	-	-	1,098,758,813.09
应 付 销 售 服 务 费	-	-	-	-	-	214,245.47	214,245.47
应 交 税 费	-	-	-	-	-	95,149.83	95,149.83
其 他 负 债	-	-	-	-	-	488,704.62	488,704.62
负 债 总 计	1,098,758,813.09	-	-	-	-	15,434,595.36	1,114,193,408.45
利	-417,795,60	1,441,842,0	3,457,023,8	279,219,02	1,157,095,4	5,955,709,4	

率 敏 感 度 缺 口	797,266,486 .82	3.99	15.65	32.47	6.51	90.84	82.64
上 年 度 末 20 22 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资 产							
货 币 资 金	2,291,355.4 2	-	-	-	-	-	2,291,355.4 2
结 算 备 付 金	46,544,818. 99	-	-	-	-	-	46,544,818. 99
存 出 保 证 金	189,354.23	-	-	-	-	-	189,354.23
交 易 性 金 融 资 产	260,833,417 .81	324,607,33 2.66	1,517,851,9 41.36	2,547,725,4 73.49	606,646,49 9.48	1,262,563,7 53.35	6,520,228,4 18.15
应 收 申 购 款	34,998,469. 51	-	-	-	-	12,708,329. 82	47,706,799. 33

应 收 清 算 款	-	-	-	-	-	11,310,094.86	11,310,094.86
资 产 总 计	344,857,415.96	324,607,332.66	1,517,851,941.36	2,547,725,473.49	606,646,499.48	1,286,582,178.03	6,628,270,840.98
负 债							
应 付 赎 回 款	-	-	-	-	-	123,348,786.64	123,348,786.64
应 付 管 理 人 报 酬	-	-	-	-	-	3,606,528.15	3,606,528.15
应 付 托 管 费	-	-	-	-	-	1,030,436.62	1,030,436.62
卖 出 回 购 金 融 资 产 款	737,880,775.98	-	-	-	-	-	737,880,775.98
应 付 销 售 服 务 费	-	-	-	-	-	178,888.39	178,888.39
应	-	-	-	-	-	129,973.40	129,973.40

交 税 费							
其 他 负 债	-	-	-	-	-	704,467.11	704,467.11
负 债 总 计	737,880,775.98	-	-	-	-	128,999,080.31	866,879,856.29
利 率 敏 感 度 缺 口	- 393,023,360.02	324,607,332.66	1,517,851,941.36	2,547,725,473.49	606,646,499.48	1,157,583,097.72	5,761,390,984.69

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他影响债券公允价值的变量保持不变，仅利率发生变动；		
	假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化(即平移收益率曲线)。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 1%	-60,653,972.70	-45,721,671.28
	市场利率下降 1%	71,058,137.64	54,010,186.58

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

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主

要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资组合中股票投资比例范围为本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 90%。现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-10%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	1,163,320,874.10	19.53	1,261,063,753.35	21.89
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	5,822,731,955.49	97.77	5,259,164,664.80	91.28
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	6,986,052,829.59	117.30	6,520,228,418.15	113.17

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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

	动	本期末（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准+10%	1,021,395,371.94	986,835,539.74
	业绩比较基准-10%	-1,021,395,371.94	-986,835,539.74

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

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	3,758,032,145.48	3,496,486,681.00
第二层次	3,228,020,684.11	3,022,241,737.15
第三层次	—	1,500,000.00
合计	6,986,052,829.59	6,520,228,418.15

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
----	--

	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	1, 500, 000. 00	-	1, 500, 000. 00
当期购买	-	28, 570, 810. 37	28, 570, 810. 37
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	24, 783, 392. 97	24, 783, 392. 97
当期利得或损失总额	-1, 500, 000. 00	-3, 787, 417. 40	-5, 287, 417. 40
其中：计入损益的利得或损失	-1, 500, 000. 00	-3, 787, 417. 40	-5, 287, 417. 40
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-1, 500, 000. 00	-	-1, 500, 000. 00
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	1, 500, 000. 00	235, 910, 755. 02	237, 410, 755. 02
当期购买	-	89, 383, 010. 99	89, 383, 010. 99
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	302, 997, 475. 01	302, 997, 475. 01
当期利得或损失总额	-	-22, 296, 291. 00	-22, 296, 291. 00
其中：计入损益的利得或损失	-	-22, 296, 291. 00	-22, 296, 291. 00
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	1, 500, 000. 00	-	1, 500, 000. 00
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-28, 503, 550. 68	-	-28, 503, 550. 68

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值
----	---------	---------	---------

	值	值技术	名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
债券	-	清算价值法	资产变现率	0.00	正相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
债券	1,500,000.00	清算价值法	资产变现率	0.00-95.00	正相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,163,320,874.10	16.45
	其中：股票	1,163,320,874.10	16.45
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,822,731,955.49	82.36
	其中：债券	5,822,731,955.49	82.36
	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	74,506,229.28	1.05
8	其他各项资产	9,343,832.22	0.13
9	合计	7,069,902,891.09	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	78,704,722.14	1.32
B	采矿业	21,978,202.00	0.37
C	制造业	957,288,276.34	16.07
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	5,170,411.18	0.09
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	48,055,363.28	0.81
K	房地产业	16,512,631.00	0.28
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	16,561,340.16	0.28
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	19,049,928.00	0.32
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	1,163,320,874.10	19.53

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	79,701	137,563,926.00	2.31
2	600426	华鲁恒升	4,071,765	112,339,996.35	1.89
3	300054	鼎龙股份	3,339,920	80,826,064.00	1.36
4	002078	太阳纸业	5,950,394	72,416,294.98	1.22
5	002714	牧原股份	1,716,973	70,704,948.14	1.19
6	000568	泸州老窖	364,466	65,392,489.72	1.10
7	603599	广信股份	3,394,175	49,215,537.50	0.83

8	300408	三环集团	1,587,635	46,755,850.75	0.79
9	603517	绝味食品	1,547,732	41,572,081.52	0.70
10	600309	万华化学	521,800	40,084,676.00	0.67
11	000932	华菱钢铁	7,386,035	38,038,080.25	0.64
12	002557	洽洽食品	1,055,400	36,749,028.00	0.62
13	601799	星宇股份	274,546	35,995,726.06	0.60
14	300750	宁德时代	182,632	29,816,500.32	0.50
15	300059	东方财富	1,851,302	25,992,280.08	0.44
16	002142	宁波银行	1,097,120	22,063,083.20	0.37
17	301227	森鹰窗业	807,263	21,852,609.41	0.37
18	000858	五粮液	144,265	20,241,822.15	0.34
19	603707	健友股份	1,290,379	19,355,685.00	0.32
20	002607	中公教育	4,669,100	19,049,928.00	0.32
21	600563	法拉电子	203,848	18,876,324.80	0.32
22	002223	鱼跃医疗	498,000	17,220,840.00	0.29
23	603259	药明康德	227,616	16,561,340.16	0.28
24	001979	招商蛇口	1,732,700	16,512,631.00	0.28
25	002986	宇新股份	1,037,093	16,178,650.80	0.27
26	600938	中国海油	729,000	15,287,130.00	0.26
27	300138	晨光生物	932,751	12,526,845.93	0.21
28	600299	安迪苏	1,404,423	11,235,384.00	0.19
29	600873	梅花生物	1,137,100	10,859,305.00	0.18
30	600141	兴发集团	544,100	9,929,825.00	0.17
31	300972	万辰集团	213,100	7,999,774.00	0.13
32	603979	金诚信	177,200	6,691,072.00	0.11
33	000893	亚钾国际	152,100	3,991,104.00	0.07
34	000651	格力电器	111,800	3,596,606.00	0.06
35	601006	大秦铁路	382,158	2,755,359.18	0.05
36	688625	呈和科技	66,476	2,607,188.72	0.04
37	601156	东航物流	163,400	2,415,052.00	0.04
38	688087	英科再生	85,126	2,049,834.08	0.03

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002078	太阳纸业	71,243,130.65	1.24
2	603517	绝味食品	61,193,414.26	1.06
3	603599	广信股份	56,930,683.70	0.99
4	000932	华菱钢铁	41,434,966.95	0.72
5	002557	洽洽食品	34,837,582.00	0.60
6	000568	泸州老窖	33,841,882.64	0.59
7	601006	大秦铁路	26,368,395.05	0.46

8	001979	招商蛇口	24,658,126.00	0.43
9	600426	华鲁恒升	22,927,783.80	0.40
10	002714	牧原股份	22,435,563.48	0.39
11	600519	贵州茅台	22,239,859.00	0.39
12	002986	宇新股份	21,681,860.71	0.38
13	002607	中公教育	20,946,098.00	0.36
14	300138	晨光生物	19,558,084.83	0.34
15	603799	华友钴业	18,226,969.41	0.32
16	688099	晶晨股份	17,607,910.33	0.31
17	002223	鱼跃医疗	17,604,122.00	0.31
18	600372	中航机载	15,672,159.52	0.27
19	002013	中航机电	14,692,203.96	0.26
20	600563	法拉电子	13,999,715.01	0.24

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002250	联化科技	76,743,890.64	1.33
2	000333	美的集团	74,121,309.00	1.29
3	603799	华友钴业	44,597,103.29	0.77
4	600309	万华化学	36,998,452.00	0.64
5	300138	晨光生物	28,610,779.31	0.50
6	601888	中国中免	27,842,196.44	0.48
7	600745	闻泰科技	27,305,671.86	0.47
8	688099	晶晨股份	22,425,358.48	0.39
9	601006	大秦铁路	22,098,811.50	0.38
10	603995	甬金股份	18,141,498.22	0.31
11	002120	韵达股份	17,602,402.00	0.31
12	603806	福斯特	15,779,930.30	0.27
13	002013	中航机电	15,672,159.52	0.27
14	300832	新产业	15,196,692.80	0.26
15	600372	中航机载	14,439,404.74	0.25
16	301227	森鹰窗业	13,952,835.43	0.24
17	300054	鼎龙股份	13,412,140.00	0.23
18	603259	药明康德	12,710,339.88	0.22
19	600486	扬农化工	12,234,135.20	0.21
20	600882	妙可蓝多	12,186,974.76	0.21

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	821,512,955.53
--------------	----------------

卖出股票收入（成交）总额	733,658,250.31
--------------	----------------

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	400,094,476.86	6.72
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,007,628,190.85	33.71
	其中：政策性金融债	338,518,600.05	5.68
4	企业债券	141,858,980.84	2.38
5	企业短期融资券	151,994,692.89	2.55
6	中期票据	164,359,478.93	2.76
7	可转债（可交换债）	2,759,070,235.66	46.33
8	同业存单	197,725,899.46	3.32
9	其他	-	-
10	合计	5,822,731,955.49	97.77

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	1928021	19 农业银行永续债 01	1,700,000	174,429,884.15	2.93
2	019703	23 国债 10	1,600,000	162,271,561.65	2.72
3	2028003	20 平安银行永续债 01	1,500,000	156,593,835.62	2.63
4	1928004	19 农业银行二级 02	1,500,000	155,556,442.62	2.61
5	2128024	21 中国银行 02	1,500,000	152,232,491.80	2.56

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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中，中国农业银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、中国银行股份有限公司具有在报告编制日前一年内受到监管部门处罚的情况；本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

前十名证券的发行主体中，未见其他发行主体有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。

8.11.2 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未超出基金合同规定的备选股票库。

8.11.3 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	132,550.42
2	应收清算款	9,206,939.14
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,342.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,343,832.22

8.11.4 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	110081	闻泰转债	149,180,337.41	2.50
2	132026	G 三峡 EB2	121,422,508.89	2.04
3	113052	兴业转债	101,946,627.74	1.71
4	113043	财通转债	85,943,018.29	1.44
5	127056	中特转债	82,596,694.98	1.39
6	113623	凤 21 转债	74,873,609.78	1.26
7	113047	旗滨转债	74,343,204.38	1.25
8	123107	温氏转债	72,161,601.73	1.21
9	127039	北港转债	71,068,994.72	1.19
10	113602	景 20 转债	65,494,514.77	1.10
11	113632	鹤 21 转债	61,347,192.64	1.03
12	113062	常银转债	54,402,342.47	0.91
13	110075	南航转债	53,917,840.40	0.91
14	110089	兴发转债	53,124,929.95	0.89
15	113636	甬金转债	49,410,402.65	0.83
16	127006	敖东转债	47,944,875.04	0.81
17	127012	招路转债	47,890,862.66	0.80
18	128142	新乳转债	46,997,905.95	0.79
19	128136	立讯转债	42,944,098.06	0.72
20	132020	19 蓝星 EB	42,936,455.39	0.72
21	111007	永和转债	41,094,376.03	0.69
22	123090	三诺转债	39,603,425.30	0.66
23	113641	华友转债	39,494,409.86	0.66
24	123119	康泰转 2	38,741,197.97	0.65
25	127024	盈峰转债	38,430,246.57	0.65
26	123120	隆华转债	37,992,934.75	0.64
27	113049	长汽转债	37,803,911.56	0.63
28	123158	宙邦转债	36,336,662.16	0.61
29	128134	鸿路转债	35,384,284.99	0.59
30	111010	立昂转债	33,084,305.72	0.56
31	111002	特纸转债	30,855,554.24	0.52
32	118005	天奈转债	30,787,863.50	0.52
33	128034	江银转债	30,779,837.23	0.52
34	127077	华宏转债	30,562,516.09	0.51
35	123131	奥飞转债	29,874,102.79	0.50
36	113616	韦尔转债	29,423,166.22	0.49
37	128131	崇达转 2	28,441,854.93	0.48
38	123167	商络转债	28,430,905.81	0.48
39	123132	回盛转债	27,376,665.31	0.46
40	110079	杭银转债	26,260,010.14	0.44
41	128144	利民转债	25,907,962.63	0.44
42	128048	张行转债	24,914,916.54	0.42
43	118031	天 23 转债	23,400,596.99	0.39

44	123170	南电转债	21,654,596.71	0.36
45	123117	健帆转债	21,596,334.49	0.36
46	127066	科利转债	20,978,687.49	0.35
47	127030	盛虹转债	20,570,404.49	0.35
48	123088	威唐转债	20,492,618.81	0.34
49	110076	华海转债	19,517,694.11	0.33
50	127059	永东转 2	19,301,483.65	0.32
51	113545	金能转债	19,152,484.11	0.32
52	113606	荣泰转债	18,770,910.96	0.32
53	118006	阿拉转债	18,737,970.68	0.31
54	110086	精工转债	18,562,105.78	0.31
55	113654	永 02 转债	17,917,726.03	0.30
56	123103	震安转债	17,673,761.29	0.30
57	123124	晶瑞转 2	17,542,953.07	0.29
58	113063	赛轮转债	17,541,647.94	0.29
59	128125	华阳转债	17,509,980.47	0.29
60	127025	冀东转债	16,564,470.53	0.28
61	113579	健友转债	16,426,089.43	0.28
62	123035	利德转债	16,325,945.00	0.27
63	123145	药石转债	16,199,598.98	0.27
64	123169	正海转债	15,192,838.90	0.26
65	113044	大秦转债	15,123,031.78	0.25
66	123113	仙乐转债	14,895,119.59	0.25
67	113059	福莱转债	14,878,873.97	0.25
68	123063	大禹转债	14,644,441.65	0.25
69	113582	火炬转债	13,411,000.00	0.23
70	123104	卫宁转债	12,361,542.24	0.21
71	118012	微芯转债	12,104,494.18	0.20
72	118024	冠宇转债	12,091,561.64	0.20
73	123050	聚飞转债	11,860,564.37	0.20
74	123155	中陆转债	11,616,741.37	0.20
75	123149	通裕转债	11,361,433.23	0.19
76	113608	威派转债	10,771,909.59	0.18
77	118034	晶能转债	10,367,288.47	0.17
78	127043	川恒转债	9,870,646.24	0.17
79	118003	华兴转债	9,519,463.01	0.16
80	123178	花园转债	9,136,075.16	0.15
81	128133	奇正转债	7,972,112.88	0.13
82	123133	佩蒂转债	7,016,031.15	0.12
83	110088	淮 22 转债	5,060,378.08	0.08
84	111004	明新转债	4,875,770.96	0.08
85	123099	普利转债	4,634,508.22	0.08
86	113658	密卫转债	2,337,219.73	0.04

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.11.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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	4,891	856,261.56	4,026,782,861.51	96.15	161,192,410.38	3.85
兴全恒益债券 C	22,762	20,493.72	420,311,476.06	90.10	46,166,617.54	9.90
合计	27,653	168,316.40	4,447,094,337.57	95.54	207,359,027.92	4.46

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）。

9.2 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	301,235.88	0.0072
	兴全恒益债券 C	839.46	0.0002
	合计	302,075.34	0.0065

注：上表所列持有人为本基金场内持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本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	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	10~50
	兴全恒益债券 C	0
	合计	10~50

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

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

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	4,046,222,537.10	408,283,796.40
本报告期基金总申 购份额	2,203,459,312.96	889,479,821.68
减：本报告期基金 总赎回份额	2,061,706,578.17	831,285,524.48
本报告期基金拆分 变动份额	—	—
本报告期期末基金 份额总额	4,187,975,271.89	466,478,093.60

注：总申购份额含红利再投资、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。

(2) 报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自 2017 年起连续 7 年聘请毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。本年度应支付给所聘任的会计师事务所 48,000.00 元人民币。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
兴业证券	3	1,474,923,585.99	100.00	1,087,254.38	100.00	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额	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 (%)		(%)		的比例 (%)
兴业证 券	3,307,234, 957.04	100.00	117,433,504, 000.00	100.00	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券	-	-	-	-	-	-
中银国 际证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	兴证全球基金管理有限公司关于旗下部分基金投资绝味食品（603517）非公开发行股票的公告	证券时报、指定互联网网站	2023 年 1 月 12 日
2	关于增加渤海银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、指定互联网网站	2023 年 3 月 10 日
3	关于增加上海华夏财富投资管理有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、指定互联网网站	2023 年 3 月 23 日
4	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、指定互联网网站	2023 年 6 月 14 日
5	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、指定互联网网站	2023 年 6 月 30 日
6	关于旗下部分基金投资呈和科技（688625）非公开发行股票的公告	证券时报、指定互联网网站	2023 年 7 月 6 日
7	关于增加嘉实财富管理有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、指定互联网网站	2023 年 7 月 10 日
8	关于开通我司旗下基金在腾安基金基金转换业务的公告	证券时报、指定互联网网站	2023 年 8 月 11 日
9	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、指定互联网网站	2023 年 9 月 14 日
10	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、指定互联网网站	2023 年 10 月 25 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

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

2、“赎回份额”包含份额赎回、转换转出等导致投资者持有份额减少的情形。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予兴全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、关于申请募集兴全恒益债券型证券投资基金之法律意见；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

13.3 查阅方式

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

基金管理人客户服务中心电话：400-678-0099，021-38824536

兴证全球基金管理有限公司

2024 年 3 月 29 日