

兴全恒益债券型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 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：2021 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 2021 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 2021 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	48
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	49
7.11 投资组合报告附注	49
§ 8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	52
§ 9 开放式基金份额变动	53
§ 10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	53
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	54
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	56
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	56
§ 12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	56

§ 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	2,376,763,001.74 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	2,296,361,845.14 份	80,401,156.60 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。
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 28-30 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 浦东嘉里城办公楼 28-30 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(2021年1月1日-2021年6月30日)		
	兴全恒益债券 A	兴全恒益债券 C	
本期已实现收益	81,945,097.31	2,273,298.06	
本期利润	80,510,315.41	2,061,595.38	
加权平均基金份额本期利润	0.0311	0.0275	
本期加权平均净值利润率	2.40%	2.16%	
本期基金份额净值增长率	2.60%	2.40%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)		
	期末可供分配利润	566,080,542.68	18,259,361.90
	期末可供分配基金份额利润	0.2465	0.2271
	期末基金资产净值	3,016,284,539.36	104,000,988.94
	期末基金份额净值	1.3135	1.2935

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	31.35%	29.35%

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、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	-0.02%	0.33%	-0.52%	0.17%	0.50%	0.16%
过去三个月	1.90%	0.34%	1.10%	0.20%	0.80%	0.14%
过去六个月	2.60%	0.45%	0.40%	0.27%	2.20%	0.18%
过去一年	9.53%	0.55%	4.38%	0.26%	5.15%	0.29%
过去三年	29.90%	0.47%	13.28%	0.26%	16.62%	0.21%
自基金合同生效起至今	31.35%	0.42%	13.00%	0.25%	18.35%	0.17%

兴全恒益债券 C

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
----	---------	------------	-----------	--------------	-----	-----

	率①	准差②	率③	④		
过去一个月	-0.05%	0.33%	-0.52%	0.17%	0.47%	0.16%
过去三个月	1.79%	0.34%	1.10%	0.20%	0.69%	0.14%
过去六个月	2.40%	0.45%	0.40%	0.27%	2.00%	0.18%
过去一年	9.09%	0.55%	4.38%	0.26%	4.71%	0.29%
过去三年	28.35%	0.47%	13.28%	0.26%	15.07%	0.21%
自基金合同生效 起至今	29.35%	0.42%	13.00%	0.25%	16.35%	0.17%

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：

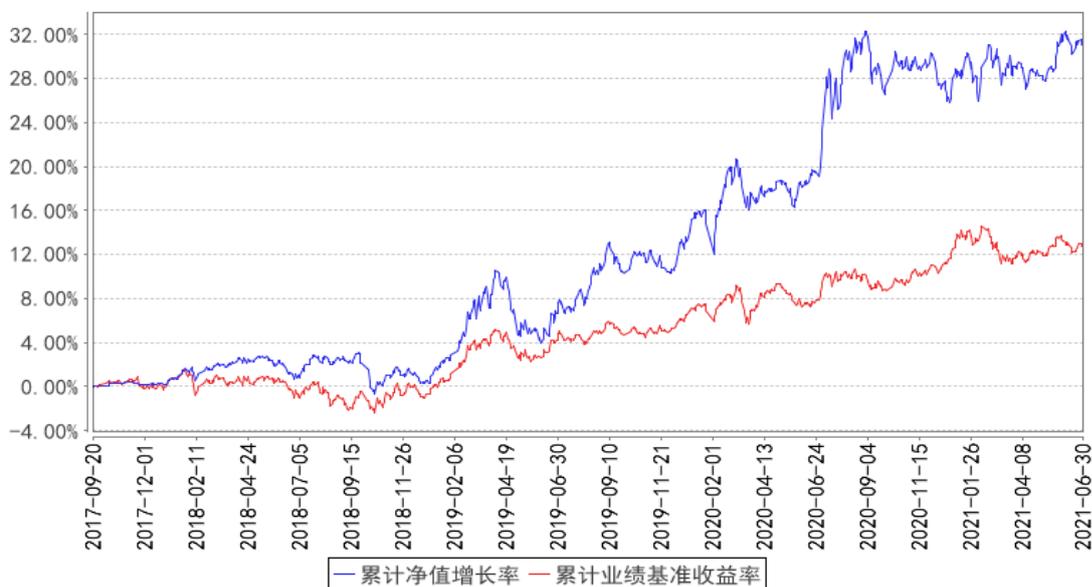
$$\text{Return}_t = 80\% \times (\text{中国债券总指数收益率}_t / \text{中国债券总指数收益率}_{t-1} - 1) + 20\% \times (\text{沪深 300 指数收益率}_t / \text{沪深 300 指数收益率}_{t-1} - 1)$$

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

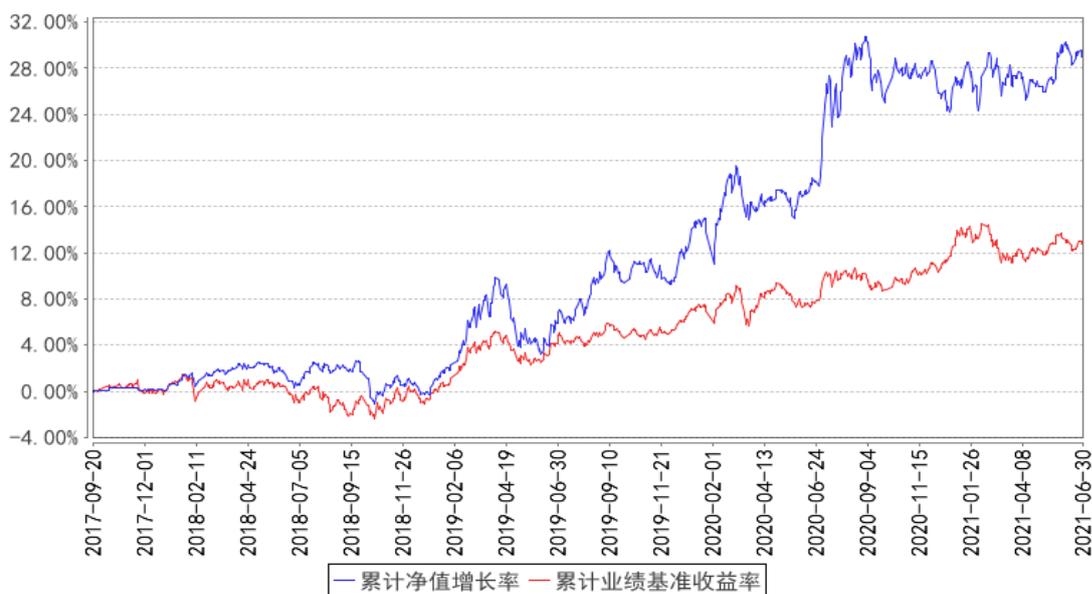
其中， $t=1, 2, 3, \dots, T$ ， T 表示时间截至日。

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 2021 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”。

截至2021年6月30日，公司旗下已管理兴全可转债混合型证券投资基金等共42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		
申庆	兴全沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）、兴全恒益债券型证券投资基金、兴全中证800六个月持有期指数增强型证券投资基金基金经理	2017年9月20日	-	24年	硕士，历任兴业证券研究发展中心研究员，兴证全球基金管理有限公司行业研究员，兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理助理、兴全全球视野股票型证券投资基金基金经理、基金管理部总监助理。
张睿	固定收益	2017年9月	-	16年	硕士，历任红顶金融工程研究中心研究部

	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金经理	月 20 日			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、兴全磐稳增利债券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。
陈玲	固定收益部总监助理，兴全磐稳增利债券型证券投资基金基金、兴全恒益债券型证券投资基金基金经理助理	2017 年 11 月 3 日	-	12 年	硕士，历任国信证券股份有限公司经济研究所行业研究员，兴证全球基金管理有限公司固定收益部研究员。

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。

4.2 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，所有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不存在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，债券市场震荡上涨，收益率曲线陡峭化下行，利率债品种波动幅度多在 10bp 左右，信用债利差整体有所缩小，但信用风险事件和担忧亦持续冲击低资质信用债。从基本面看，社融、地产销售数据等宏观领先指标趋于下行，出口增速持续较好而基建和消费偏弱，但微观主体业绩表现仍有一定韧性，大宗工业品、航运等领域受供给影响价格大幅上涨，半导体、电新等细分行业景气度较强。尽管报告期内 PPI 同比大幅上涨，但和 2019 年下半年 CPI 阶段性上涨一样，主要因为阶段性供给因素导致，货币政策除春节前有所收紧外，春节后资金市场始终保持持续的稳定宽松状态，并在 7 月初意外降准。债市相对收益或亏损来自几块：一是优质主体的二级债、次级债、永续债；二是震荡市场下拉长期带来的票面和骑乘收益；而信用风险担忧及事件依然贡献负收益。转债市场波动较大但整体表现依然活跃，报告期内低估值债性转债一度受到流动性及信用风险担忧的冲击大幅下跌，而后逐步修复，高估值股性转债向低估值转债切换，黑色、化工等受益于 PPI 上涨的周期性行业表现较好，而随着电新、半导体等细分行业表现出持续高景气，市场再次呈现出明显的结构化特征，中小市值转债表现活跃。本基金在债券投资上采取相对中性偏保守的操作策略，以优质信用债的持有票息为主，转债上持仓相对均衡和分散化，兼顾转债估值的安全边际以及正股标的的业绩增速，并兑现高价转债。

上半年 A 股市场的中证 100、沪深 300、中证 500、创业板指、科创 50 的涨幅分别为-2.85%、0.24%、6.93%、17.22%、14.01%，中小市值强于大市值，且新能源、医药、芯片等板块为代表的“宁”指数明显强于以金融、消费等传统稳定高 ROE 为特征的“茅”指数。根据我们的统计，主

动型公募基金收益分布也呈现比较严重的尖峰、右偏特征。

虽然正如我们所预料的那样，春节前“茅”指数呈现明显泡沫化特征，忽略成长拉升估值并不具有可持续性，但二季度以来“宁”指数的异军突起却超出我们的预期。从近期市场特征看，单纯的质量因子已很难取得超额收益，相对而言成长性预期成为近期的主要矛盾，只有不断超预期的股票才能获得市场青睐，一旦低于预期很容易导致情绪逆转。

在具体操作上，我们依然坚持在总体行业和风格均衡的前提下，采取行业内相对综合价值比较的选股策略，并积极把握各种确定性的超额收益甚至绝对收益，从而尽可能在市场回落过程中降低整体组合的下方波动，同时又能在市场上升过程中紧跟市场。目前看这一策略面临逆风，我们有能力根据市场投资逻辑的演化，虚心向市场学习，努力在风格上避免吃亏，但也不盲目追随。

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 1.3135 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.60%，同期业绩比较基准收益率为 0.40%；截至本报告期末兴全恒益债券 C 的基金份额净值为 1.2935 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.40%，同期业绩比较基准收益率为 0.40%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本轮经济上行周期可能已迎来拐点，下半年出口链、地产链动能可能减弱，稳增长压力逐渐上升，跨周期调整的应对措施也已在路上，7 月份超预期降准，且地方债发行节奏有望加快，财政对经济的托底功能有望加强。

目前市场状况与 2013 年既有相同之处，也有明显的不同。相同之处在于结构性行情鲜明，双创类股票显著跑赢大盘，而主流机构投资者并未充分从中受益，不同之处在于 2013 年的创业板更多的是小盘成长风格，与目前不乏千亿、万亿市值的双创权重股差异较大，且 2013 年无风险利率不断抬升，与目前的状况也明显不同。因此，不能简单将当前的结构性行情类比为 2013 年，尤其是不能忽略宏观背景。

我们坚持之前的判断，历史上任何时期的情绪化高估值品种都会向合理水平回归。从投资研究实践看，市场对较为长期的未来并无太强的预测能力，甚至连短期预测也倾向于线性外推。近期市场对“赛道”类资产的“终局”估值法应用达到极致，某些研究甚至采用几十年后的“终局”估值进行贴现，考虑到我国民营企业平均寿命以及新兴行业内生的技术迭代风险，至少对部分投资者而言很难作为合理的买入理由。

展望下半年，结构性行情可能仍将持续。经济结构性的热和冷在一段时间内还将维持，货币政策有保有压，地产融资受政策压制而新能源、高端制造业等行业受政策支持，资金利率目前看

维稳的概率仍大，尽管债券绝对收益率已经接近前低，但暂未看到反转的迹象，持有为主，并关注海外货币政策的退出节奏。转债投资依然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。

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、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合规守信、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托管人——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 2021 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：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	25,843,773.14	4,911,780.79
结算备付金		33,705,191.52	50,326,360.96
存出保证金		180,540.71	212,920.64
交易性金融资产	6.4.7.2	3,459,107,199.67	4,659,856,189.98
其中：股票投资		823,488,378.58	876,297,074.16
基金投资		-	-
债券投资		2,635,618,821.09	3,783,559,115.82
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		10,229,336.55	56,383,031.15
应收利息	6.4.7.5	23,113,636.96	36,712,117.17
应收股利		-	-
应收申购款		281,719.85	982,121.86
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,552,461,398.40	4,809,384,522.55

负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		422,379,869.71	885,599,650.30
应付证券清算款		4,481,074.07	40,963.85
应付赎回款		2,329,874.11	91,547,160.27
应付管理人报酬		1,857,933.65	2,368,372.66
应付托管费		530,838.16	676,677.88
应付销售服务费		34,072.06	41,722.82
应付交易费用	6.4.7.7	252,704.86	362,333.52
应交税费		142,256.89	168,832.09
应付利息		81,029.99	-163,607.64
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	86,216.60	213,663.05
负债合计		432,175,870.10	980,855,768.80
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	2,376,763,001.74	2,991,798,007.49
未分配利润	6.4.7.10	743,522,526.56	836,730,746.26
所有者权益合计		3,120,285,528.30	3,828,528,753.75
负债和所有者权益总计		3,552,461,398.40	4,809,384,522.55

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，兴全恒益债券 A 基金份额净值 1.3135，基金份额总额 2,296,361,845.14 份；兴全恒益债券 C 基金份额净值 1.2935，基金份额总额 80,401,156.60 份。兴全恒益债券份额总额合计为 2,376,763,001.74 份。

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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		105,923,574.92	102,324,436.87
1. 利息收入		36,189,750.76	24,990,703.58
其中：存款利息收入	6.4.7.11	376,234.81	285,431.36
债券利息收入		35,684,581.45	24,537,833.42
资产支持证券利息收入		-	-

买入返售金融资产收入		128,934.50	167,438.80
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		70,876,489.01	49,718,353.98
其中：股票投资收益	6.4.7.12	34,410,287.30	6,869,569.63
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	30,081,762.78	38,401,157.84
资产支持证券投资	6.4.7.13.5	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	6,384,438.93	4,447,626.51
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-1,646,484.58	27,374,372.20
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	503,819.73	241,007.11
减：二、费用		23,351,664.13	14,828,256.33
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	11,956,459.77	7,944,574.18
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,416,131.38	2,269,878.25
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	188,580.74	214,465.69
4. 交易费用	6.4.7.19	1,292,328.81	422,289.60
5. 利息支出		6,277,406.80	3,789,790.57
其中：卖出回购金融资产支出		6,277,406.80	3,789,790.57
6. 税金及附加		102,443.67	67,570.30
7. 其他费用	6.4.7.20	118,312.96	119,687.74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		82,571,910.79	87,496,180.54
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		82,571,910.79	87,496,180.54

6.3 所有者权益（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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益（基金净值）	2,991,798,007.49	836,730,746.26	3,828,528,753.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	82,571,910.79	82,571,910.79
三、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
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	2,376,763,001.74	743,522,526.56	3,120,285,528.30
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,115,699,189.38	157,677,297.87	1,273,376,487.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	87,496,180.54	87,496,180.54
三、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）	1,244,254,950.46	223,843,848.40	1,468,098,798.86
其中：1. 基金申购款	1,953,310,451.95	337,789,182.39	2,291,099,634.34

2. 基金赎回款	-709,055,501.49	-113,945,333.99	-823,000,835.48
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	2,359,954,139.84	469,017,326.81	2,828,971,466.65

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

杨华辉

庄园芳

詹鸿飞

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

兴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×80%+沪深 300 指数收益率×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的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年上半年度期间经营成果和基金净值变动情况。

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

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

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

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》、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》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。

2018 年 1 月 1 日(含)以后，资管产品管理人(以下称管理人)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。

(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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	25,843,773.14
定期存款	-
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	-
合计	25,843,773.14

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	767,903,700.33	823,488,378.58	55,584,678.25
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,993,414,762.01	1,982,155,821.09
	银行间市场	681,644,070.92	653,463,000.00
	合计	2,675,058,832.93	2,635,618,821.09
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	3,442,962,533.26	3,459,107,199.67	16,144,666.41

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

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。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	3,834.04
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	13,650.57
应收债券利息	23,096,079.18
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	73.17
合计	23,113,636.96

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	249,628.89
银行间市场应付交易费用	3,075.97
合计	252,704.86

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,044.28
应付证券出借违约金	-
预提费用	85,172.32
合计	86,216.60

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

兴全恒益债券 A

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,906,060,434.74	2,906,060,434.74
本期申购	1,216,365,381.28	1,216,365,381.28
本期赎回（以“-”号填列）	-1,826,063,970.88	-1,826,063,970.88
-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	2,296,361,845.14	2,296,361,845.14

兴全恒益债券 C

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	85,737,572.75	85,737,572.75
本期申购	40,956,231.66	40,956,231.66
本期赎回（以“-”号填列）	-46,292,647.81	-46,292,647.81
-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	80,401,156.60	80,401,156.60

注：申购含红利再投资、转入转换份额，赎回含转换转出份额。

6.4.7.10 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	618,949,914.00	195,214,451.27	814,164,365.27
本期利润	81,945,097.31	-1,434,781.90	80,510,315.41
本期基金份额 交易产生的变 动数	-134,814,468.63	-39,937,517.83	-174,751,986.46
其中：基金申 购款	266,997,402.65	83,311,030.11	350,308,432.76
基金赎 回款	-401,811,871.28	-123,248,547.94	-525,060,419.22
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	566,080,542.68	153,842,151.54	719,922,694.22

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	16,856,303.45	5,710,077.54	22,566,380.99
本期利润	2,273,298.06	-211,702.68	2,061,595.38
本期基金份额 交易产生的变 动数	-870,239.61	-157,904.42	-1,028,144.03
其中：基金申	8,479,981.03	3,037,497.37	11,517,478.40

购款			
基金赎回款	-9,350,220.64	-3,195,401.79	-12,545,622.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18,259,361.90	5,340,470.44	23,599,832.34

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	50,421.22
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	315,888.35
其他	9,925.24
合计	376,234.81

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	34,410,287.30
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	34,410,287.30

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	607,927,935.29
减：卖出股票成本总额	573,517,647.99
买卖股票差价收入	34,410,287.30

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	30,081,762.78
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	30,081,762.78

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,268,405,051.15
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,208,142,860.23
减：应收利息总额	30,180,428.14
买卖债券差价收入	30,081,762.78

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 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。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	6,384,438.93
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	6,384,438.93

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-1,646,484.58

股票投资	-9,037,942.85
债券投资	7,391,458.27
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	-1,646,484.58

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	500,956.65
基金转换费收入	2,863.08
合计	503,819.73

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	1,282,328.81
银行间市场交易费用	10,000.00
合计	1,292,328.81

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	23,803.31
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	19,852.28
账户维护费用	15,150.00
合计	118,312.96

6.4.7.21 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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	798,841,962.39	100.00	340,362,524.14	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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	1,177,263,060.00	100.00	1,133,168,019.11	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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	38,563,752,000.00	100.00	35,005,387,000.00	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 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
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	252,266.07	100.00	127,251.56	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 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	11,956,459.77	7,944,574.18
其中：支付销售机构的客户维护费	586,763.30	1,004,267.63

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	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,416,131.38	2,269,878.25

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		
	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
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020年1月1日至2020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	-	15,451.06	15,451.06
兴证全球基金	-	16,485.19	16,485.19
兴业证券	-	28,288.76	28,288.76
合计	-	60,225.01	60,225.01

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基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	25,843,773.14	50,421.22	2,583,778.03	74,417.43

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(2021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	可流通日	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
000927	中国铁物	2021年1月7日	2021年7月8日	非公开发行流通受限	3.29	3.67	1,975,683	6,499,997.07	7,250,756.61	注1
002044	美年健康	2021年1月15日	2021年7月15日	大宗交易购入流通受限	12.49	8.95	750,000	9,367,500.00	6,712,500.00	-
002182	云海金属	2021年3月26日	2021年9月27日	大宗交易购入流通受限	8.91	11.54	510,000	4,544,100.00	5,885,400.00	-
002405	四维图新	2021年2月23日	2021年8月26日	非公开发行流通受限	12.50	14.07	400,000	5,000,000.00	5,628,000.00	-
002558	巨人网络	2021年3月22日	2021年9月22日	大宗交易购入流通受限	13.10	12.82	1,190,000	15,589,000.00	15,255,800.00	-
002558	巨人网络	2021年6月21日	2021年12月21日	大宗交易购入流通受限	12.83	12.61	710,000	9,109,300.00	8,953,100.00	-
002562	兄弟科技	2021年1月5日	2021年7月8日	非公开发行流通受限	4.71	4.17	5,944,798	27,999,998.58	24,789,807.66	-
002786	银宝山新	2021年4月	2021年10月	非公开发行	4.73	6.75	1,860,465	8,799,999.45	12,558,138.75	-

		月 13 日	月 15 日	行流 通受 限						
300123	亚光 科技	2021 年 2 月 22 日	2021 年 8 月 23 日	大宗 交易 购入 流通 受限	9.05	10.49	812,000	7,348,600.00	8,517,880.00	-
300123	亚光 科技	2021 年 2 月 24 日	2021 年 8 月 24 日	大宗 交易 购入 流通 受限	8.98	10.48	2,070,000	18,588,600.00	21,693,600.00	-
300123	亚光 科技	2021 年 2 月 26 日	2021 年 8 月 26 日	大宗 交易 购入 流通 受限	8.98	10.47	2,300,000	20,654,000.00	24,081,000.00	-
300123	亚光 科技	2021 年 3 月 26 日	2021 年 9 月 27 日	大宗 交易 购入 流通 受限	7.87	10.40	1,100,000	8,657,000.00	11,440,000.00	-
300292	吴通 控股	2021 年 5 月 24 日	2021 年 11 月 26 日	非公 开发 行流 通受 限	2.69	3.71	5,576,208	14,999,999.52	20,687,731.68	-
300439	美康 生物	2021 年 3 月 29 日	2021 年 10 月 8 日	非公 开发 行流 通受 限	15.00	18.52	400,000	6,000,000.00	7,408,000.00	-
300444	双杰 电气	2021 年 2 月 26 日	2021 年 9 月 1 日	非公 开发 行流 通受 限	4.30	6.02	1,348,837	5,799,999.10	8,119,998.74	-
300460	惠伦 晶体	2021 年 5 月 7 日	2021 年 11 月 12 日	非公 开发 行流 通受 限	12.37	21.94	242,522	2,999,997.14	5,320,932.68	-
300497	富祥	2021	2021	非公	12.68	12.31	615,141	7,799,987.88	7,572,385.71	-

	药业	年 1 月 19 日	年 7 月 21 日	开发行流通受限						
300634	彩讯股份	2021 年 6 月 10 日	2021 年 12 月 15 日	非公开发行流通受限	11.46	19.58	1,308,900	14,999,994.00	25,628,262.00	-
600059	古越龙山	2021 年 4 月 28 日	2021 年 10 月 26 日	非公开发行流通受限	9.31	12.15	2,685,284	24,999,994.04	32,626,200.60	-
600446	金证股份	2021 年 3 月 29 日	2021 年 9 月 27 日	非公开发行流通受限	12.34	14.06	470,016	5,799,997.44	6,608,424.96	-
601360	三六零	2021 年 1 月 6 日	2021 年 7 月 9 日	非公开发行流通受限	12.93	12.11	470,000	6,077,100.00	5,691,700.00	-
603703	盛洋科技	2021 年 1 月 5 日	2021 年 7 月 1 日	非公开发行流通受限	9.61	12.70	603,538	5,800,000.18	7,664,932.60	-
688099	晶晨股份	2021 年 3 月 3 日	2021 年 9 月 3 日	大宗交易购入流通受限	79.53	106.01	60,000	4,771,800.00	6,360,600.00	-
688099	晶晨股份	2021 年 3 月 4 日	2021 年 9 月 6 日	大宗交易购入流通受限	78.58	106.02	80,000	6,286,400.00	8,481,600.00	-

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	可流通日	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
113050	南银	2021	2021	新债	100.00	100.00	11,610	1,161,000.00	1,161,000.00	-

	转债	年 6 月 16 日	年 7 月 1 日	未上 市						
113050	南银 转债	2021 年 6 月 17 日	2021 年 7 月 1 日	新债 未上 市	100.00	100.00	8,720	872,000.00	872,000.00	-
188342	21 海怡 01	2021 年 6 月 30 日	2021 年 7 月 6 日	新债 未上 市	100.00	100.00	200,000	20,000,000.00	20,000,000.00	-

注：1. 经深圳证券交易所核准，公司证券简称自 2021 年 1 月 8 日起由“一汽夏利”变更为“中国铁物”。

2. 上述流通受限证券可流通日系基金根据上市公司公告暂估确定，最终日期以上市公司公告为准。

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

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 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 20,579,869.71 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
200216	20 国开 16	2021 年 7 月 1 日	100.17	210,000	21,035,700.00
合计				210,000	21,035,700.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 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 401,800,000.00 元，于 2021 年 7 月 1 日，2021 年 7 月 6 日，2021 年 7 月 5 日，2021 年 7 月 13 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，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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	30,186,000.00	130,020,000.00
A-1 以下	1,500,000.00	-
未评级	160,597,000.00	471,784,000.00
合计	192,283,000.00	601,804,000.00

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。

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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	1,209,096,206.76	1,675,991,969.50
AAA 以下	1,025,998,614.33	1,134,044,705.00
未评级	-	-
合计	2,235,094,821.09	2,810,036,674.50

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。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

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

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金为开放式基金，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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2021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	25,843,773.14	-	-	-	-	-	25,843,773.14
结算备付金	33,705,191.52	-	-	-	-	-	33,705,191.52
存出保证金	180,540.71	-	-	-	-	-	180,540.71
交易性金融资产	141,412,000.00	243,551,600.00	627,092,518.80	989,772,182.56	632,290,519.73	824,988,378.58	3,459,107,199.67
应收利息	-	-	-	-	-	23,113,636.96	23,113,636.96
应收申购款	60,095.20	-	-	-	-	221,624.65	281,719.85

应收证券清算款	-	-	-	-	-	10,229,336.55	10,229,336.55
资产总计	201,201,600.57	243,551,600.00	627,092,518.80	989,772,182.56	632,290,519.73	858,552,976.74	3,552,461,398.40
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,329,874.11	2,329,874.11
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,857,933.65	1,857,933.65
应付托管费	-	-	-	-	-	530,838.16	530,838.16
应付证券清算款	-	-	-	-	-	4,481,074.07	4,481,074.07
卖出回购金融资产款	422,379,869.71	-	-	-	-	-	422,379,869.71
应付销售服务费	-	-	-	-	-	34,072.06	34,072.06
应付交易费用	-	-	-	-	-	252,704.86	252,704.86
应付利息	-	-	-	-	-	81,029.99	81,029.99
应交税费	-	-	-	-	-	142,256.89	142,256.89
其他负债	-	-	-	-	-	86,216.60	86,216.60
负债总计	422,379,869.71	-	-	-	-	9,796,000.39	432,175,870.10
利率敏感度缺口	221,178,269.14	243,551,600.00	627,092,518.80	989,772,182.56	632,290,519.73	848,756,976.35	3,120,285,528.30
上年度末 2020 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	4,911,780.79	-	-	-	-	-	4,911,780.79
结算备付金	50,326,360.96	-	-	-	-	-	50,326,360.96
存出保证金	212,920.64	-	-	-	-	-	212,920.64
交易性金融资产	245,795,441.50	214,658,000.00	804,115,000.00	1,509,130,996.53	1,008,359,677.79	877,797,074.16	4,659,856,189.98
应收利息	-	-	-	-	-	36,712,117.17	36,712,117.17
应收申购款	569,651.55	-	-	-	-	412,470.31	982,121.86
应收证券清	-	-	-	-	-	56,383,031	56,383,031

算款						1.15	.15
资产总计	301,816,155.44	214,658,000.00	804,115,000.00	1,509,130,996.53	1,008,359,677.79	971,304,692.79	4,809,384,522.55
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	91,547,160.27	91,547,160.27
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,368,372.66	2,368,372.66
应付托管费	-	-	-	-	-	676,677.88	676,677.88
应付证券清算款	-	-	-	-	-	40,963.85	40,963.85
卖出回购金融资产款	885,599,650.30	-	-	-	-	-	885,599,650.30
应付销售服务费	-	-	-	-	-	41,722.82	41,722.82
应付交易费用	-	-	-	-	-	362,333.52	362,333.52
应付利息	-	-	-	-	-	163,607.64	163,607.64
应交税费	-	-	-	-	-	168,832.09	168,832.09
其他负债	-	-	-	-	-	213,663.05	213,663.05
负债总计	885,599,650.30	-	-	-	-	95,256,118.50	980,855,768.80
利率敏感度缺口	583,783,494.86	214,658,000.00	804,115,000.00	1,509,130,996.53	1,008,359,677.79	876,048,574.29	3,828,528,753.75

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他影响债券公允价值的变量保持不变，仅利率发生变动；	
	假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化(即平移收益率曲线)。	
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
	本期末(2021年6月30日)	上年度末(2020年12月31日)

分析	市场利率-1%	18,711,201.88	43,875,644.73
	市场利率+1%	-16,842,797.13	-38,629,024.02

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。

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 2021年6月30日		上年度末 2020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	823,488,378.58	26.39	876,297,074.16	22.89
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	2,635,618,821.09	84.47	3,783,559,115.82	98.83
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	3,459,107,199.67	110.86	4,659,856,189.98	121.71

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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准+10%	351,257,391.60	487,414,429.92
	业绩比较基准-10%	-351,257,391.60	-487,414,429.92

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。

6.4.14 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	823,488,378.58	23.18
	其中：股票	823,488,378.58	23.18
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,635,618,821.09	74.19
	其中：债券	2,635,618,821.09	74.19
	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	59,548,964.66	1.68
8	其他各项资产	33,805,234.07	0.95
9	合计	3,552,461,398.40	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	4,072,000.00	0.13
C	制造业	491,303,620.93	15.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,151,708.17	0.07
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	4,298,865.05	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	8,714,278.17	0.28
H	住宿和餐饮业	911,200.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	114,389,781.64	3.67
J	金融业	82,389,879.00	2.64
K	房地产业	3,153,600.00	0.10
L	租赁和商务服务业	3,796,382.49	0.12
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	25,885,890.33	0.83
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	36,151,465.00	1.16
R	文化、体育和娱乐业	45,630,257.80	1.46
S	综合	639,450.00	0.02
	合计	823,488,378.58	26.39

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	300123	亚光科技	6,282,000	65,732,480.00	2.11
2	600195	中牧股份	4,528,580	54,161,816.80	1.74
3	002572	索菲亚	2,218,800	53,694,960.00	1.72
4	002739	万达电影	2,889,820	45,630,257.80	1.46
5	002821	凯莱英	107,156	39,926,325.60	1.28
6	000001	平安银行	1,688,800	38,200,656.00	1.22
7	002044	美年健康	3,981,500	36,151,465.00	1.16

8	600059	古越龙山	2,685,284	32,626,200.60	1.05
9	300634	彩讯股份	1,308,900	25,628,262.00	0.82
10	002562	兄弟科技	5,944,798	24,789,807.66	0.79
11	002558	巨人网络	1,900,000	24,208,900.00	0.78
12	600782	新钢股份	4,268,131	23,816,170.98	0.76
13	300292	吴通控股	5,576,208	20,687,731.68	0.66
14	600299	安迪苏	1,404,423	16,796,899.08	0.54
15	002773	康弘药业	700,000	16,191,000.00	0.52
16	688099	晶晨股份	140,000	14,842,200.00	0.48
17	601997	贵阳银行	1,981,200	14,185,392.00	0.45
18	600487	亨通光电	1,218,521	13,891,139.40	0.45
19	600141	兴发集团	668,800	12,593,504.00	0.40
20	002786	银宝山新	1,860,465	12,558,138.75	0.40
21	600727	鲁北化工	1,518,800	12,454,160.00	0.40
22	000403	派林生物	398,945	12,415,168.40	0.40
23	601838	成都银行	898,800	11,360,832.00	0.36
24	603136	天目湖	686,774	11,290,564.56	0.36
25	600323	瀚蓝环境	399,801	8,711,663.79	0.28
26	300444	双杰电气	1,348,837	8,119,998.74	0.26
27	603703	盛洋科技	603,538	7,664,932.60	0.25
28	300497	富祥药业	615,141	7,572,385.71	0.24
29	300439	美康生物	400,000	7,408,000.00	0.24
30	000927	中国铁物	1,975,683	7,250,756.61	0.23
31	300254	仟源医药	928,801	6,631,639.14	0.21
32	600446	金证股份	470,016	6,608,424.96	0.21
33	601009	南京银行	581,200	6,114,224.00	0.20
34	601628	中国人寿	180,000	6,100,200.00	0.20
35	002182	云海金属	510,000	5,885,400.00	0.19
36	601200	上海环境	491,534	5,883,661.98	0.19
37	300385	雪浪环境	703,400	5,880,424.00	0.19
38	300609	汇纳科技	300,000	5,727,000.00	0.18
39	601360	三六零	470,000	5,691,700.00	0.18
40	002405	四维图新	400,000	5,628,000.00	0.18
41	300460	惠伦晶体	242,522	5,320,932.68	0.17
42	600873	梅花生物	888,800	4,977,280.00	0.16
43	000938	紫光股份	218,280	4,775,966.40	0.15
44	002422	科伦药业	238,000	4,748,100.00	0.15
45	000785	居然之家	708,215	4,298,865.05	0.14
46	002624	完美世界	168,800	4,036,008.00	0.13
47	002707	众信旅游	615,297	3,796,382.49	0.12
48	601699	潞安环能	300,000	3,543,000.00	0.11
49	601601	中国太保	120,000	3,476,400.00	0.11

50	001979	招商蛇口	288,000	3,153,600.00	0.10
51	600326	西藏天路	400,553	2,699,727.22	0.09
52	601336	新华保险	52,500	2,410,275.00	0.08
53	600703	三安光电	73,000	2,339,650.00	0.07
54	600690	海尔智家	72,000	1,865,520.00	0.06
55	300476	胜宏科技	73,600	1,608,160.00	0.05
56	002614	奥佳华	70,000	1,584,100.00	0.05
57	600535	天士力	98,600	1,460,266.00	0.05
58	600795	国电电力	563,419	1,369,108.17	0.04
59	002050	三花智控	55,000	1,318,900.00	0.04
60	002938	鹏鼎控股	35,000	1,255,800.00	0.04
61	600309	万华化学	11,500	1,251,430.00	0.04
62	601919	中远海控	37,000	1,129,980.00	0.04
63	300296	利亚德	140,000	1,094,800.00	0.04
64	300735	光弘科技	88,387	1,074,785.92	0.03
65	601636	旗滨集团	55,000	1,020,800.00	0.03
66	600161	天坛生物	29,317	1,004,107.25	0.03
67	002371	北方华创	3,500	970,830.00	0.03
68	002555	三七互娱	40,000	960,800.00	0.03
69	300760	迈瑞医疗	2,000	960,100.00	0.03
70	600754	锦江酒店	16,000	911,200.00	0.03
71	002993	奥海科技	20,000	871,000.00	0.03
72	688636	智明达	8,000	850,400.00	0.03
73	000547	航天发展	45,000	849,150.00	0.03
74	601865	福莱特	20,000	790,600.00	0.03
75	002036	联创电子	60,000	789,000.00	0.03
76	300332	天壕环境	140,000	782,600.00	0.03
77	002332	仙琚制药	60,000	752,400.00	0.02
78	300582	英飞特	30,000	700,200.00	0.02
79	000009	中国宝安	35,000	639,450.00	0.02
80	002326	永太科技	30,000	599,700.00	0.02
81	600036	招商银行	10,000	541,900.00	0.02
82	601857	中国石油	100,000	529,000.00	0.02
83	300219	鸿利智汇	40,000	528,000.00	0.02
84	603707	健友股份	11,990	500,582.50	0.02
85	600426	华鲁恒升	15,570	481,891.50	0.02
86	002475	立讯精密	10,000	460,000.00	0.01
87	000949	新乡化纤	50,000	423,500.00	0.01
88	300075	数字政通	31,500	370,755.00	0.01
89	002414	高德红外	13,000	358,540.00	0.01
90	002120	韵达股份	24,652	333,541.56	0.01
91	300568	星源材质	5,000	206,850.00	0.01

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	300123	亚光科技	55,248,200.00	1.44
2	600782	新钢股份	48,958,040.92	1.28
3	002832	比音勒芬	28,676,020.03	0.75
4	002562	兄弟科技	27,999,998.58	0.73
5	600059	古越龙山	24,999,994.04	0.65
6	002472	双环传动	24,720,334.83	0.65
7	002558	巨人网络	24,698,300.00	0.65
8	603136	天目湖	23,367,076.20	0.61
9	002067	景兴纸业	19,950,445.51	0.52
10	688099	晶晨股份	16,167,795.75	0.42
11	600323	瀚蓝环境	15,935,585.77	0.42
12	300292	吴通控股	14,999,999.52	0.39
13	300634	彩讯股份	14,999,994.00	0.39
14	600985	淮北矿业	13,517,132.31	0.35
15	002044	美年健康	9,367,500.00	0.24
16	603876	鼎胜新材	8,991,415.24	0.23
17	002786	银宝山新	8,799,999.45	0.23
18	300497	富祥药业	7,799,987.88	0.20
19	600299	安迪苏	6,800,871.49	0.18
20	601899	紫金矿业	6,631,040.00	0.17

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	002558	巨人网络	114,552,921.46	2.99
2	002821	凯莱英	29,404,326.40	0.77
3	002832	比音勒芬	29,060,711.19	0.76
4	002472	双环传动	24,665,701.61	0.64
5	002572	索菲亚	22,909,432.86	0.60
6	601988	中国银行	21,602,240.00	0.56
7	601137	博威合金	20,698,513.29	0.54
8	002067	景兴纸业	19,787,003.63	0.52
9	601328	交通银行	19,218,977.11	0.50
10	600782	新钢股份	18,150,050.97	0.47
11	300450	先导智能	16,236,802.20	0.42
12	002044	美年健康	14,833,931.00	0.39
13	600985	淮北矿业	12,217,129.35	0.32

14	600141	兴发集团	10,653,896.40	0.28
15	603136	天目湖	9,887,741.44	0.26
16	300527	中船应急	9,556,701.36	0.25
17	000001	平安银行	9,375,747.00	0.24
18	603876	鼎胜新材	9,330,461.88	0.24
19	300075	数字政通	9,202,409.00	0.24
20	002374	中锐股份	8,749,785.60	0.23

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	529,746,895.26
卖出股票收入（成交）总额	607,927,935.29

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	37,920,000.00	1.22
2	央行票据	-	-
3	金融债券	200,552,000.00	6.43
	其中：政策性金融债	170,321,000.00	5.46
4	企业债券	720,727,800.00	23.10
5	企业短期融资券	122,129,000.00	3.91
6	中期票据	292,862,000.00	9.39
7	可转债（可交换债）	1,261,428,021.09	40.43
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,635,618,821.09	84.47

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	200216	20 国开 16	1,500,000	150,255,000.00	4.82
2	132018	G 三峡 EB1	809,030	97,180,683.60	3.11
3	110059	浦发转债	720,770	73,828,471.10	2.37
4	155419	19 南网 02	700,000	70,483,000.00	2.26
5	163865	21 招证 S1	700,000	70,154,000.00	2.25

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.10.3 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中，国家开发银行、上海浦东发展银行股份有限公司、招商证券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形；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	180,540.71
2	应收证券清算款	10,229,336.55

3	应收股利	-
4	应收利息	23,113,636.96
5	应收申购款	281,719.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	33,805,234.07

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	132018	G 三峡 EB1	97,180,683.60	3.11
2	110059	浦发转债	73,828,471.10	2.37
3	127024	盈峰转债	53,850,445.05	1.73
4	128109	楚江转债	47,096,000.00	1.51
5	132020	19 蓝星 EB	44,012,769.60	1.41
6	128129	青农转债	42,814,741.32	1.37
7	110075	南航转债	36,867,000.00	1.18
8	113037	紫银转债	36,178,623.90	1.16
9	110076	华海转债	30,103,327.80	0.96
10	113043	财通转债	29,873,200.00	0.96
11	110051	中天转债	28,731,614.30	0.92
12	127017	万青转债	27,479,014.56	0.88
13	123050	聚飞转债	26,562,433.70	0.85
14	110062	烽火转债	25,891,986.00	0.83
15	128048	张行转债	24,141,482.40	0.77
16	110068	龙净转债	24,005,659.20	0.77
17	128131	崇达转 2	23,307,638.40	0.75
18	110033	国贸转债	23,297,518.80	0.75
19	110053	苏银转债	23,058,400.00	0.74
20	113602	景 20 转债	22,553,235.30	0.72
21	128125	华阳转债	21,530,903.60	0.69
22	132021	19 中电 EB	21,480,921.00	0.69
23	113606	荣泰转债	21,284,000.00	0.68
24	123077	汉得转债	20,482,873.38	0.66
25	123063	大禹转债	19,159,156.80	0.61
26	127025	冀东转债	18,418,308.54	0.59
27	113017	吉视转债	17,571,600.00	0.56
28	127022	恒逸转债	17,204,157.20	0.55
29	128133	奇正转债	16,517,458.65	0.53
30	128137	洁美转债	15,659,258.81	0.50
31	113598	法兰转债	15,355,983.70	0.49

32	127016	鲁泰转债	14,999,400.00	0.48
33	123060	苏试转债	14,348,481.40	0.46
34	113525	台华转债	14,341,914.00	0.46
35	128083	新北转债	14,001,073.80	0.45
36	110057	现代转债	13,544,663.40	0.43
37	123033	金力转债	13,055,350.08	0.42
38	127021	特发转 2	12,487,931.04	0.40
39	113013	国君转债	12,409,100.00	0.40
40	123035	利德转债	11,180,339.10	0.36
41	113608	威派转债	11,063,000.00	0.35
42	110041	蒙电转债	11,033,299.20	0.35
43	128107	交科转债	10,855,240.08	0.35
44	113579	健友转债	10,565,755.20	0.34
45	110045	海澜转债	10,046,700.00	0.32
46	113614	健 20 转债	5,458,593.40	0.17
47	110067	华安转债	5,371,000.00	0.17
48	123091	长海转债	5,296,378.56	0.17
49	123078	飞凯转债	4,890,261.28	0.16
50	113594	淳中转债	4,524,891.70	0.15
51	113030	东风转债	3,312,811.20	0.11
52	128022	众信转债	3,186,100.00	0.10
53	128101	联创转债	1,835,700.00	0.06
54	123007	道氏转债	492,570.00	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	300123	亚光科技	65,732,480.00	2.11	大宗交易购入 流通受限
2	600059	古越龙山	32,626,200.60	1.05	非公开发行流 通受限
3	300634	彩讯股份	25,628,262.00	0.82	非公开发行流 通受限
4	002562	兄弟科技	24,789,807.66	0.79	非公开发行流 通受限
5	002044	美年健康	6,712,500.00	0.22	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	7,801	294,367.63	2,096,326,219.93	91.29	200,035,625.21	8.71
兴全恒益债券 C	3,199	25,133.22	18,118,590.62	22.54	62,282,565.98	77.46
合计	11,000	216,069.36	2,114,444,810.55	88.96	262,318,191.19	11.04

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	119,076.94	0.0052
	兴全恒益债券 C	8,759.72	0.0109
	合计	127,836.66	0.0054

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、基金投资和研究部门负责人持有本开	兴全恒益债券 A	0
	兴全恒益债券 C	0

开放式基金		
	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	2,906,060,434.74	85,737,572.75
本报告期基金总申 购份额	1,216,365,381.28	40,956,231.66
减：本报告期基金 总赎回份额	1,826,063,970.88	46,292,647.81
本报告期基金拆分 变动份额（份额减 少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金 份额总额	2,296,361,845.14	80,401,156.60

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。

§ 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无重大人事变动。

(2) 报告期内，本基金托管人中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

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	2	798,841,962.39	100.00%	585,696.18	100.00%	-

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	1,177,263,060.00	100.00%	38,563,752,000.00	100.00%	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于旗下部分基金投资兄弟科技(002562)非公开发行股票的公告	证券时报、规定互联网网站	2021-1-7
2	关于旗下部分基金投资盛洋科技(603703)非公开发行股票的公告	证券时报、规定互联网网站	2021-1-7
3	关于旗下部分基金投资三六零	证券时报、规定互联网	2021-1-8

	(601360)非公开发行的公告	网站	
4	关于旗下部分基金投资一汽夏利(000927)非公开发行的公告	证券时报、规定互联网网站	2021-1-9
5	关于兴全恒益债券型证券投资基金 A 份额恢复接受五百万元以上申购、转换转入的公告	证券时报、规定互联网网站	2021-1-19
6	关于旗下部分基金投资富祥药业(300497)非公开发行的公告	证券时报、规定互联网网站	2021-1-21
7	关于旗下部分基金投资范围增加存托凭证并修改基金合同和托管协议的公告	证券时报、规定互联网网站	2021-2-9
8	关于调整旗下基金在湘财证券费率优惠活动的公告	证券时报、规定互联网网站	2021-2-10
9	关于旗下部分基金投资四维图新(002405)非公开发行的公告	证券时报、规定互联网网站	2021-2-25
10	关于旗下部分基金投资双杰电气(300444)非公开发行的公告	证券时报、规定互联网网站	2021-3-2
11	关于增加中原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	2021-3-5
12	关于旗下部分基金投资金证股份(600446)非公开发行的公告	证券时报、规定互联网网站	2021-3-31
13	关于旗下部分基金投资美康生物(300439)非公开发行的公告	证券时报、规定互联网网站	2021-3-31
14	关于增加阳光人寿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	2021-4-1
15	关于旗下部分基金投资银宝山新(002786)非公开发行的公告	证券时报、规定互联网网站	2021-4-15
16	关于旗下部分基金投资古越龙山(600059)非公开发行的公告	证券时报、规定互联网网站	2021-4-30
17	关于旗下部分基金投资惠伦晶体(300460)非公开发行的公告	证券时报、规定互联网网站	2021-5-11
18	关于旗下部分基金增加侧袋机制并修改基金合同和托管协议的公告	证券时报、规定互联网网站	2021-5-24
19	关于旗下部分基金投资吴通控股(300292)非公开发行的公告	证券时报、规定互联网网站	2021-5-26
20	关于旗下部分基金投资彩讯股份(300634)非公开发行的公告	证券时报、规定互联网网站	2021-6-12
21	关于增加北京新浪仓石基金销售有限公司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	2021-6-16
22	关于增加泛华普益基金销售有限公司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	2021-6-17
23	关于调整网上直销基金转换、赎回转购、汇款交易优惠费率的公告	证券时报、规定互联网网站	2021-6-18

§ 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

无。

§ 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中心电话：400-678-0099，021-38824536。

兴证全球基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日