

# 兴全恒鑫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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 5         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| 3.3 其他指标                                | 9         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>10</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 10        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 10        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 11        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 11        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 12        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 12        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 12        |
| 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       | 12        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>12</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 12        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 13        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 13        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>13</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 13        |
| 6.2 利润表                                 | 14        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 15        |
| 6.4 报表附注                                | 17        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>37</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 37        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 37        |
| 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       | 38        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 38        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 39        |
| 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      | 39        |
| 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   | 39        |

|                                             |           |
|---------------------------------------------|-----------|
| 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 ..... | 39        |
| 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 .....    | 39        |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 40        |
| 7.11 投资组合报告附注 .....                         | 40        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>42</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 42        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 42        |
| 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 .....      | 43        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>43</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>43</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 43        |
| 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 .....      | 44        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 44        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 44        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 44        |
| 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 .....         | 44        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 44        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 44        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>45</b> |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....    | 45        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 46        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>46</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 46        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 46        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 46        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                  |                  |
|-----------------|------------------|------------------|
| 基金名称            | 兴全恒鑫债券型证券投资基金    |                  |
| 基金简称            | 兴全恒鑫债券           |                  |
| 基金主代码           | 008452           |                  |
| 基金运作方式          | 契约型开放式           |                  |
| 基金合同生效日         | 2020 年 1 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           | 中国建设银行股份有限公司     |                  |
| 报告期末基金份额总额      | 685,286,574.79 份 |                  |
| 基金合同存续期         | 不定期              |                  |
| 下属分级基金的基金简称     | 兴全恒鑫债券 A         | 兴全恒鑫债券 C         |
| 下属分级基金的交易代码     | 008452           | 008453           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 550,636,649.31 份 | 134,649,925.48 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   | 本基金的投资策略包括：资产配置策略、债券类属资产配置、债券投资组合策略、可转换债券投资策略、资产支持证券投资策略、证券公司短期公司债券投资策略、国债期货投资策略等策略。 |
| 业绩比较基准 | 中债企业债总指数收益率×80%+中债国债总指数收益率×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。                                          |

### 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                    | 中国建设银行股份有限公司          |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 杨卫东                             | 李申                    |
|         | 联系电话 | 021-20398888                    | 021-60637102          |
|         | 电子邮箱 | yangwd@xqfunds.com              | lishen.zh@ccb.com     |
| 客户服务电话  |      | 4006780099, 021-38824536        | 021-60637111          |
| 传真      |      | 021-20398858                    | 021-60635778          |
| 注册地址    |      | 上海市黄浦区金陵东路 368 号                | 北京市西城区金融大街 25 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 | 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼 |
| 邮政编码    |      | 201204                          | 100033                |
| 法定代表人   |      | 杨华辉                             | 田国立                   |

## 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 | <a href="http://www.xqfunds.com">http://www.xqfunds.com</a> |
| 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<br>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<br>和指标 | 报告期(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日) |                |
|-------------------|-------------------------------------|----------------|
|                   | 兴全恒鑫债券 A                            | 兴全恒鑫债券 C       |
| 本期已实现收益           | 23,316,134.79                       | 6,569,548.87   |
| 本期利润              | 14,558,959.89                       | 3,845,715.99   |
| 加权平均基金份<br>额本期利润  | 0.0377                              | 0.0346         |
| 本期加权平均净<br>值利润率   | 3.32%                               | 3.06%          |
| 本期基金份额净<br>值增长率   | 3.30%                               | 3.10%          |
| 3.1.2 期末数据<br>和指标 | 报告期末(2021 年 6 月 30 日)               |                |
| 期末可供分配利<br>润      | 85,812,129.97                       | 20,088,083.91  |
| 期末可供分配基<br>金份额利润  | 0.1558                              | 0.1492         |
| 期末基金资产净<br>值      | 636,448,779.28                      | 154,738,009.39 |
| 期末基金份额净<br>值      | 1.1558                              | 1.1492         |

| 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  | 15.58%                | 14.92% |

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

兴全恒鑫债券 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      | 0.96%    | 0.17%       | -0.04%     | 0.03%         | 1.00%  | 0.14% |
| 过去三个月      | 2.80%    | 0.20%       | 0.41%      | 0.03%         | 2.39%  | 0.17% |
| 过去六个月      | 3.30%    | 0.42%       | 0.31%      | 0.03%         | 2.99%  | 0.39% |
| 过去一年       | 14.56%   | 0.40%       | -0.86%     | 0.04%         | 15.42% | 0.36% |
| 自基金合同生效起至今 | 15.58%   | 0.34%       | -1.01%     | 0.06%         | 16.59% | 0.28% |

兴全恒鑫债券 C

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

|                |        |       |        |       |        |       |
|----------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去一个月          | 0.93%  | 0.17% | -0.04% | 0.03% | 0.97%  | 0.14% |
| 过去三个月          | 2.70%  | 0.20% | 0.41%  | 0.03% | 2.29%  | 0.17% |
| 过去六个月          | 3.10%  | 0.42% | 0.31%  | 0.03% | 2.79%  | 0.39% |
| 过去一年           | 14.11% | 0.40% | -0.86% | 0.04% | 14.97% | 0.36% |
| 自基金合同生效<br>起至今 | 14.92% | 0.34% | -1.01% | 0.06% | 15.93% | 0.28% |

注：1、中债企业债总指数收益率×80%+中债国债总指数收益率×20%

中债企业债总指数和中债国债总指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制，分别反映我国企业债和国债市场整体价格和投资回报情况的指数。该两个指数具有广泛市场代表性，能够分别反映我国企业债和国债市场的总体走势。

在正常的市场环境下，信用债具有票息优势，且信用债的投资收益更加稳定，因此本基金主要以信用债为主以获取稳定的回报。本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，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。因此本基金选择中债企业债总指数收益率，其权重为 80%。同时，长期利率债因为久期优势，能带来显著的资本利得回报，同时因为其流动性较好，也能够保证本基金的流动性，因此，本基金选择中债国债总指数收益率，其权重为 20%。

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：

$$\text{Return}_t = 80\% \times (\text{中债企业债总指数收益率}_t / \text{中债企业债总指数收益率}_{t-1} - 1) + 20\% \times (\text{中债国债总指数收益率}_t / \text{中债国债总指数收益率}_{t-1} - 1)$$

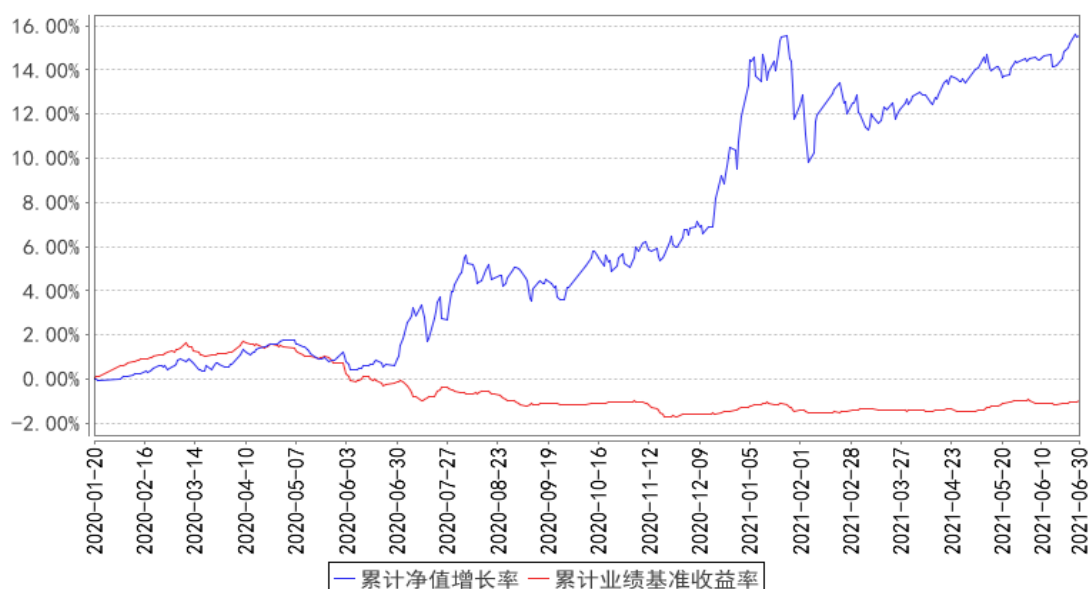
$$\text{Benchmark}_t = (1 + \text{Return}_t) \times (1 + \text{Benchmark}_{t-1}) - 1$$

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

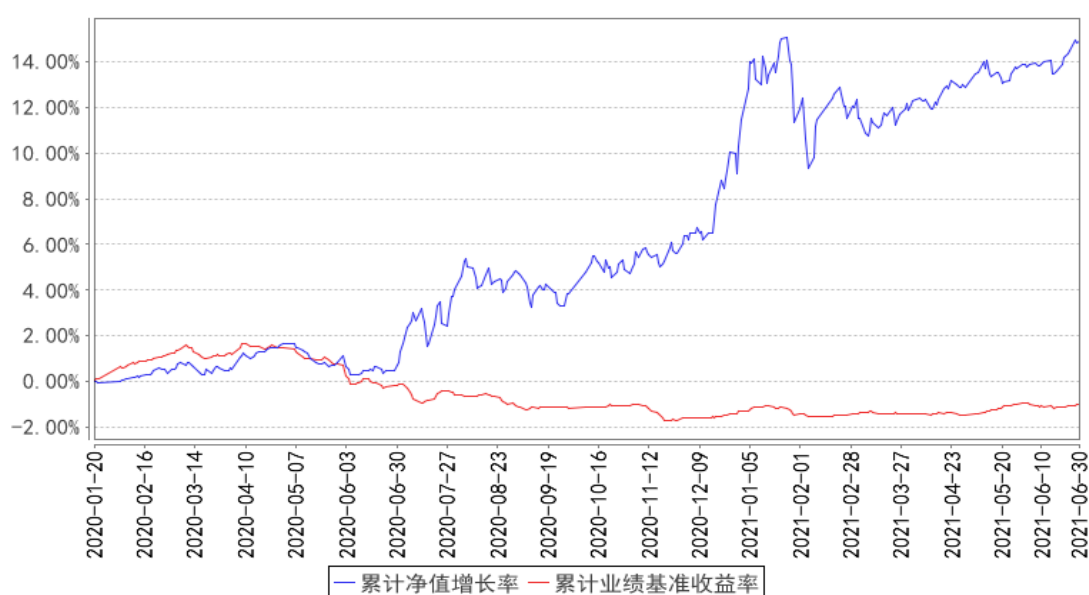


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

兴全恒鑫债券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



兴全恒鑫债券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《兴全恒鑫债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的建仓期为 2020 年 1 月 20 日到 2020 年 7 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。

### 3.3 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 |        |                                                                                                             |
| 高山 | 固定收益部总监助理、兴全恒鑫债券型证券投资基金基金经理 | 2020 年 1 月 20 日 | -    | 12 年   | 博士。历任莫尼塔公司分析师，兴业证券股份有限公司分析师、天风证券股份有限公司固定收益部副总经理、鹏扬基金管理有限公司专户投资部副总经理，兴证全球基金管理有限公司固定收益部副总监、兴全恒裕债券型证券投资基金基金经理。 |

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。

### 4.2 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、《兴全恒鑫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

上半年债市收益率呈现先上后下的走势。年初 10 年国开收益率在 3.53%，出于对通胀上行，央行收紧货币等等因素担忧，市场普遍看跌债市，收益率一度上行到 3.76%。随后收益率开始逐步震荡下行的趋势，截止到 6 月 30 日下行至 3.48%。债券收益率的下行反应了最终起决定因素的是信用收缩，经济增速回落。在需求下行的背景下，暂时的通胀并不构成债券收益率下行的制约因素。

上半年转债呈现先抑后扬的走势，但总体表现良好，上半年中证转债指数上涨 4.04%，为投资者带来了较好的回报。

本基金上半年上涨 3.3%。配置的长端利率债给组合提供了较好的回报，信用债提供了较为稳定的基础收益。同时，本基金也维持了一定仓位的可转债，给组合提供了较为明显的增强回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末兴全恒鑫债券 A 的基金份额净值为 1.1558 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.30%，同期业绩比较基准收益率为 0.31%；截至本报告期末兴全恒鑫债券 C 的基金份额净值为 1.1492 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.10%，同期业绩比较基准收益率为 0.31%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,经济增速或仍延续缓慢下行的走势,但当前资产价格对该基本面也做出了反应,基本面与市场的对应关系可能会有所弱化。债券收益率在经历了快速下行之后,也处于偏低水平。而权益市场在上半年出现了较为极端的分化,这也反应到了转债市场。对投资而言,下半年将重心放在中长期性价比更优的资产大类和细分子类上,为持有人创造风险收益比更好的回报。

#### 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给估值造成影响的因素,并就可能带来的影响提出建议和意见;5、监察稽核人员参与估值方案的制定,确保估值方案符合相关法律法规及基金合同的约定,定期对估值流程、系统估值模型及估值结果进行检查,确保估值委员会决议的有效执行,负责基金估值业务的定期和临时信息披露。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《兴全恒鑫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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本中期报告中的财务指标、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。

# § 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：兴全恒鑫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<br>2021 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>     |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 12,700,472.31                  | 36,281,073.67                    |
| 结算备付金           |            | 4,079,183.03                   | 596,587.26                       |
| 存出保证金           |            | 72,509.78                      | 77,427.67                        |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 715,039,356.09                 | 468,358,715.67                   |
| 其中：股票投资         |            | 16,772,713.20                  | 22,089,083.18                    |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 698,266,642.89                 | 446,269,632.49                   |
| 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    | 60,000,000.00                  | 17,000,000.00                    |
| 应收证券清算款         |            | -                              | -                                |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 7,435,029.31                   | 6,217,332.89                     |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | 4,707,211.51                   | 408,114.02                       |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 804,033,762.03                 | 528,939,251.18                   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2020 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债：</b>     |            |                                |                                  |

|               |          |                |                |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 短期借款          |          | -              | -              |
| 交易性金融负债       |          | -              | -              |
| 衍生金融负债        | 6.4.7.3  | -              | -              |
| 卖出回购金融资产款     |          | -              | 26,119,841.12  |
| 应付证券清算款       |          | 9,386,801.76   | 28,043,123.46  |
| 应付赎回款         |          | 2,776,722.85   | 7,949,494.14   |
| 应付管理人报酬       |          | 365,056.04     | 218,694.23     |
| 应付托管费         |          | 91,264.02      | 54,673.54      |
| 应付销售服务费       |          | 49,357.83      | 35,071.30      |
| 应付交易费用        | 6.4.7.7  | 69,256.43      | 76,314.23      |
| 应交税费          |          | 24,565.67      | 30,008.02      |
| 应付利息          |          | -              | 4,479.63       |
| 应付利润          |          | -              | -              |
| 递延所得税负债       |          | -              | -              |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 83,948.76      | 168,284.66     |
| 负债合计          |          | 12,846,973.36  | 62,699,984.33  |
| <b>所有者权益：</b> |          |                |                |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 685,286,574.79 | 417,078,448.37 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 105,900,213.88 | 49,160,818.48  |
| 所有者权益合计       |          | 791,186,788.67 | 466,239,266.85 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 804,033,762.03 | 528,939,251.18 |

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，兴全恒鑫债券 A 基金份额净值 1.1558，基金份额总额 550,636,649.31 份；兴全恒鑫债券 C 基金份额净值 1.1492，基金份额总额 134,649,925.48 份。兴全恒鑫债券份额总额合计为 685,286,574.79 份。

## 6.2 利润表

会计主体：兴全恒鑫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<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年<br>6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 20 日（基金合<br>同生效日）至 2020 年 6 月<br>30 日 |
|------------|----------|------------------------------------------|-------------------------------------------------------------|
| 一、收入       |          | 21,231,902.32                            | 21,571,547.79                                               |
| 1. 利息收入    |          | 7,550,937.36                             | 22,691,211.54                                               |
| 其中：存款利息收入  | 6.4.7.11 | 44,803.55                                | 452,082.89                                                  |
| 债券利息收入     |          | 6,903,541.14                             | 20,486,493.02                                               |
| 资产支持证券利息收入 |          | -                                        | -                                                           |
| 买入返售金融资产收入 |          | 602,592.67                               | 1,752,635.63                                                |
| 证券出借利息收入   |          | -                                        | -                                                           |

|                        |            |                |               |
|------------------------|------------|----------------|---------------|
| 其他利息收入                 |            | -              | -             |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | 25,118,067.01  | 5,644,105.00  |
| 其中：股票投资收益              | 6.4.7.12   | 4,651,545.74   | 119,774.02    |
| 基金投资收益                 | -          | -              | -             |
| 债券投资收益                 | 6.4.7.13   | 20,466,521.27  | 5,524,330.98  |
| 资产支持证券投资<br>收益         | 6.4.7.13.5 | -              | -             |
| 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   | -              | -             |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17   | -11,481,007.78 | -6,765,056.35 |
| 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   | 43,905.73      | 1,287.60      |
| 减：二、费用                 |            | 2,827,226.44   | 6,285,281.45  |
| 1. 管理人报酬               | 6.4.10.2.1 | 1,669,873.93   | 3,737,988.05  |
| 2. 托管费                 | 6.4.10.2.2 | 417,468.44     | 934,496.98    |
| 3. 销售服务费               | 6.4.10.2.3 | 248,013.41     | 354,602.87    |
| 4. 交易费用                | 6.4.7.19   | 332,451.51     | 60,904.21     |
| 5. 利息支出                |            | 30,680.84      | 1,042,460.68  |
| 其中：卖出回购金融资产<br>支出      |            | 30,680.84      | 1,042,460.68  |
| 6. 税金及附加               |            | 14,782.41      | 55,303.37     |
| 7. 其他费用                | 6.4.7.20   | 113,955.90     | 99,525.29     |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）    |            | 18,404,675.88  | 15,286,266.34 |
| 减：所得税费用                |            | -              | -             |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）      |            | 18,404,675.88  | 15,286,266.34 |

注：本基金合同于 2020 年 1 月 20 日生效，上年度可比期间数据按实际存续期计算。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴全恒鑫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<br>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 | 417,078,448.37                        | 49,160,818.48 | 466,239,266.85 |

|                                        |                                                      |                |                  |
|----------------------------------------|------------------------------------------------------|----------------|------------------|
| 权益（基金净值）                               |                                                      |                |                  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                                    | 18,404,675.88  | 18,404,675.88    |
| 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）      | 268,208,126.42                                       | 38,334,719.52  | 306,542,845.94   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 475,323,806.84                                       | 66,053,431.70  | 541,377,238.54   |
| 2. 基金赎回款                               | -207,115,680.42                                      | -27,718,712.18 | -234,834,392.60  |
| 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）                        | 685,286,574.79                                       | 105,900,213.88 | 791,186,788.67   |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 20 日（基金合同生效日）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）                        | 1,630,961,981.24                                     | -              | 1,630,961,981.24 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                                    | 15,286,266.34  | 15,286,266.34    |
| 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）      | -695,433,111.01                                      | -7,174,783.52  | -702,607,894.53  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 61,135,557.17                                        | 729,369.34     | 61,864,926.51    |
| 2. 基金                                  | -756,568,668.18                                      | -7,904,152.86  | -764,472,821.04  |



|                                        |                |              |                |
|----------------------------------------|----------------|--------------|----------------|
| 赎回款                                    |                |              |                |
| 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）                        | 935,528,870.23 | 8,111,482.82 | 943,640,353.05 |

注：本基金合同于 2020 年 1 月 20 日生效，上年度可比期间数据按实际存续期计算。

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

兴全恒鑫债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)，系经中国证监会 2019 年 11 月 19 日证监许可【2019】2408 号准予募集注册，由兴证全球基金管理有限公司作为管理人向社会公开发行募集，基金合同于 2020 年 1 月 20 日正式生效，首次设立募集规模为 1,630,961,981.24 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为及注册登记机构为兴证全球基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货等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）。本基金不直接从二级市场买入股票等权益类资产，但可持有因可转债转股所形成的股票等。本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，且信用债的投资比例为基金资产的 50%-95%；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，现金或者到期日在一年以内的政府债券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。

本基金的业绩比较基准为：中债企业债总指数收益率×80%+中债国债总指数收益率×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

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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<br>2021 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 12,700,472.31          |
| 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          | 12,700,472.31 |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |                |                |
|---------------|------------------------|----------------|----------------|
|               | 成本                     | 公允价值           | 公允价值变动         |
| 股票            | 16,772,713.20          | 16,772,713.20  | -              |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                      | -              | -              |
| 债券            | 交易所市场                  | 539,128,644.08 | 538,033,142.89 |
|               | 银行间市场                  | 159,967,889.60 | 160,233,500.00 |
|               | 合计                     | 699,096,533.68 | 698,266,642.89 |
| 资产支持证券        | -                      | -              | -              |
| 基金            | -                      | -              | -              |
| 其他            | -                      | -              | -              |
| 合计            | 715,869,246.88         | 715,039,356.09 | -829,890.79    |

#### 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

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |           |
|-------|------------------------|-----------|
|       | 账面余额                   | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 60,000,000.00          | -         |
| 银行间市场 | -                      | -         |
| 合计    | 60,000,000.00          | -         |

##### 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<br>2021 年 6 月 30 日 |
|----------|------------------------|
| 应收活期存款利息 | 743.49                 |
| 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  | 1,835.20     |
| 应收债券利息     | 7,417,696.89 |
| 应收资产支持证券利息 | -            |
| 应收买入返售证券利息 | 14,721.13    |
| 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         | 32.60        |
| 合计         | 7,435,029.31 |

注：此处其他列示的是应收保证金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 66,008.54              |
| 银行间市场应付交易费用 | 3,247.89               |
| 合计          | 69,256.43              |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | 638.08                 |
| 应付证券出借违约金   | -                      |
| 预提审计费用      | 23,803.31              |
| 预提信息披露费     | 59,507.37              |
| 合计          | 83,948.76              |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

##### 兴全恒鑫债券 A

| 项目            | 本期<br>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          | 317,607,766.83                        | 317,607,766.83  |
| 本期申购          | 389,742,891.65                        | 389,742,891.65  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -156,714,009.17                       | -156,714,009.17 |
| -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           | 550,636,649.31 | 550,636,649.31 |

## 兴全恒鑫债券 C

| 项目            | 本期<br>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          | 99,470,681.54                         | 99,470,681.54  |
| 本期申购          | 85,580,915.19                         | 85,580,915.19  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -50,401,671.25                        | -50,401,671.25 |
| -基金拆分/份额折算前   | -                                     | -              |
| 基金拆分/份额折算调整   | -                                     | -              |
| 本期申购          | -                                     | -              |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                                     | -              |
| 本期末           | 134,649,925.48                        | 134,649,925.48 |

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

## 兴全恒鑫债券 A

| 项目                     | 已实现部分          | 未实现部分         | 未分配利润合计        |
|------------------------|----------------|---------------|----------------|
| 上年度末                   | 30,926,597.30  | 6,830,900.62  | 37,757,497.92  |
| 本期利润                   | 23,316,134.79  | -8,757,174.90 | 14,558,959.89  |
| 本期基金份额<br>交易产生的变<br>动数 | 34,390,056.18  | -894,384.02   | 33,495,672.16  |
| 其中：基金申<br>购款           | 55,209,485.19  | -513,186.41   | 54,696,298.78  |
| 基金赎<br>回款              | -20,819,429.01 | -381,197.61   | -21,200,626.62 |
| 本期已分配利<br>润            | -              | -             | -              |
| 本期末                    | 88,632,788.27  | -2,820,658.30 | 85,812,129.97  |

## 兴全恒鑫债券 C

| 项目                     | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
|------------------------|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末                   | 9,273,297.64  | 2,130,022.92  | 11,403,320.56 |
| 本期利润                   | 6,569,548.87  | -2,723,832.88 | 3,845,715.99  |
| 本期基金份额<br>交易产生的变<br>动数 | 4,934,587.27  | -95,539.91    | 4,839,047.36  |
| 其中：基金申<br>购款           | 11,586,322.92 | -229,190.00   | 11,357,132.92 |

|         |               |             |               |
|---------|---------------|-------------|---------------|
| 基金赎回款   | -6,651,735.65 | 133,650.09  | -6,518,085.56 |
| 本期已分配利润 | -             | -           | -             |
| 本期末     | 20,777,433.78 | -689,349.87 | 20,088,083.91 |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 14,556.86                             |
| 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 | 22,255.91                             |
| 其他        | 7,990.78                              |
| 合计        | 44,803.55                             |

#### 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<br>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 | 4,651,545.74               |
| 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               | 4,651,545.74               |

##### 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<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 175,974,701.80                        |
| 减：卖出股票成本总额 | 171,323,156.06                        |
| 买卖股票差价收入   | 4,651,545.74                          |

##### 6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金在本报告期内无股票投资证券出借差价收入。

### 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<br>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 | 20,466,521.27              |
| 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                            | 20,466,521.27              |

#### 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<br>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   | 898,780,881.09             |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 870,811,823.20             |
| 减：应收利息总额                | 7,502,536.62               |
| 买卖债券差价收入                | 20,466,521.27              |

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金在本报告期内无债券投资收益赎回差价收入。

#### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金在本报告期内无债券投资收益申购差价收入。

#### 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：本基金在本报告期内无贵金属投资收益。



**6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：无。

**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**

注：本基金本报告期内无股利收益。

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称                       | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|----------------------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产                 | -11,481,007.78                        |
| 股票投资                       | -2,363,763.48                         |
| 债券投资                       | -9,117,244.30                         |
| 资产支持证券投资                   | -                                     |
| 基金投资                       | -                                     |
| 贵金属投资                      | -                                     |
| 其他                         | -                                     |
| 2. 衍生工具                    | -                                     |
| 权证投资                       | -                                     |
| 3. 其他                      | -                                     |
| 减：应税金融商品公允价值变动<br>产生的预估增值税 | -                                     |
| 合计                         | -11,481,007.78                        |

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 43,484.07                             |
| 基金转换费收入 | 421.66                                |
| 合计      | 43,905.73                             |

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 328,379.01                            |
| 银行间市场交易费用 | 4,072.50                              |
| 合计        | 332,451.51                            |

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>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 | -                                     |
| 账户维护费用  | 18,660.00                             |
| 银行费用    | 11,985.22                             |
| 合计      | 113,955.90                            |

#### 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               |
|------------------------|-----------------------|
| 中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）   | 基金托管人、基金销售机构          |
| 兴证全球基金管理有限公司（“兴证全球基金”） | 基金管理人、基金注册登记机构、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 |
| 兴业证券(“兴业证券”)       | 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<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |                         | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日 |                         |
|-------|---------------------------------------|-------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
|       | 成交金额                                  | 占当期股票<br>成交总额的比例<br>(%) | 成交金额                                                 | 占当期股票<br>成交总额的比例<br>(%) |
| 兴业证券  | 175,974,701.80                        | 100.00                  | 18,910,268.13                                        | 100.00                  |

注：本基金合同于 2020 年 1 月 20 日生效，上年度可比期间数据按实际存续期计算。

##### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |                         | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日 |                         |
|-------|---------------------------------------|-------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
|       | 成交金额                                  | 占当期债券<br>成交总额的比例<br>(%) | 成交金额                                                 | 占当期债券<br>成交总额的比例<br>(%) |
| 兴业证券  | 1,435,925,448.49                      | 100.00                  | 3,425,311,590.05                                     | 100.00                  |

注：本基金合同于 2020 年 1 月 20 日生效，上年度可比期间数据按实际存续期计算。

##### 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<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |                           | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日 |                           |
|-------|---------------------------------------|---------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------|
|       | 成交金额                                  | 占当期债券回购<br>成交总额的比例<br>(%) | 成交金额                                                 | 占当期债券回购<br>成交总额的比例<br>(%) |
| 兴业证券  | 2,784,200,000.00                      | 100.00                    | 3,757,029,000.00                                     | 100.00                    |

注：本基金合同于 2020 年 1 月 20 日生效，上年度可比期间数据按实际存续期计算。

#### 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<br>2021年1月1日至2021年6月30日                |                   |              |                     |
|-------|-------------------------------------------|-------------------|--------------|---------------------|
|       | 当期<br>佣金                                  | 占当期佣金总量<br>的比例（%） | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例（%） |
| 兴业证券  | 111,096.97                                | 100.00            | 66,008.54    | 100.00              |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2020年1月20日（基金合同生效日）至2020年6月30日 |                   |              |                     |
|       | 当期<br>佣金                                  | 占当期佣金总量<br>的比例（%） | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例（%） |
| 兴业证券  | 11,938.26                                 | 100.00            | 11,938.26    | 100.00              |

注：本基金合同于 2020 年 1 月 20 日生效，上年度可比期间数据按实际存续期计算。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目                  | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 20 日（基金<br>合同生效日）至 2020 年 6<br>月 30 日 |
|---------------------|------------------------------------------|-------------------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费      | 1,669,873.93                             | 3,737,988.05                                                |
| 其中：支付销售机构的客户维护<br>费 | 332,486.76                               | 1,588,813.18                                                |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.6%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×0.6%/当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 20 日（基金<br>合同生效日）至 2020 年 6<br>月 30 日 |
|----------------|------------------------------------------|-------------------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 417,468.44                               | 934,496.98                                                  |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15%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×0.15%/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<br>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                                     |            |            |
|                | 兴全恒鑫债券 A                                             | 兴全恒鑫债券 C   | 合计         |
| 兴证全球基金         | —                                                    | 112,909.68 | 112,909.68 |
| 建设银行           | —                                                    | 10,821.26  | 10,821.26  |
| 兴业证券           | —                                                    | 2,175.63   | 2,175.63   |
| 合计             | —                                                    | 125,906.57 | 125,906.57 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日 |            |            |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                                     |            |            |
|                | 兴全恒鑫债券 A                                             | 兴全恒鑫债券 C   | 合计         |
| 兴证全球基金         | —                                                    | 6,461.85   | 6,461.85   |
| 建设银行           | —                                                    | 35,702.19  | 35,702.19  |
| 兴业证券           | —                                                    | 1,523.61   | 1,523.61   |
| 合计             | —                                                    | 43,687.65  | 43,687.65  |

注：兴全恒鑫 C 日基金销售服务费=兴全恒鑫 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：本基金本报告期末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：本基金的管理人在本报告期内与上年度可比期间均未持有过本基金。

##### 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<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |           | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至<br>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     |
| 建设银行  | 12,700,472.31                         | 14,556.86 | 1,482,327.19                                            | 412,713.94 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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：本基金本报告期末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：本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 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

| 6.4.12.1.2 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               | 南银转债 | 2021 年 6 月 17 日 | 2021 年 7 月 1 日 | 新发未上市  | 100.00 | 100.00 | 1,980    | 198,000.00 | 198,000.00 | -  |

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有临时停牌等流通受限股票。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | -                      | 20,104,000.00            |
| A-1 以下 | -                      | -                        |
| 未评级    | 29,069,500.00          | -                        |

|    |               |               |
|----|---------------|---------------|
| 合计 | 29,069,500.00 | 20,104,000.00 |
|----|---------------|---------------|

注：此处的信用证券不包括国债、央票与政策性金融债。

#### 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<br>2021 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA    | 352,410,194.60         | 164,909,603.11           |
| AAA 以下 | 198,638,067.29         | 161,669,029.38           |
| 未评级    | —                      | —                        |
| 合计     | 551,048,261.89         | 326,578,632.49           |

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。

#### 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、权证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<br>2021 年 6 月<br>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                      | 12,700,472.31 | -      | -              | -              | -              | -             | 12,700,472.31  |
| 结算备付金                     | 4,079,183.03  | -      | -              | -              | -              | -             | 4,079,183.03   |
| 存出保证金                     | 72,509.78     | -      | -              | -              | -              | -             | 72,509.78      |
| 交易性金融资产                   | 14,015,000.00 | -      | 111,106,833.00 | 350,084,240.82 | 223,060,569.07 | 16,772,713.20 | 715,039,356.09 |
| 买入返售金融资产                  | 60,000,000.00 | -      | -              | -              | -              | -             | 60,000,000.00  |

|                          |                |               |                |                |                |               |                |
|--------------------------|----------------|---------------|----------------|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 应收利息                     | -              | -             | -              | -              | -              | 7,435,029.31  | 7,435,029.31   |
| 应收申购款                    | 364,880.90     | -             | -              | -              | -              | 4,342,330.61  | 4,707,211.51   |
| 资产总计                     | 91,232,046.02  | -             | 111,106,833.00 | 350,084,240.82 | 223,060,569.07 | 28,550,073.12 | 804,033,762.03 |
| 负债                       |                |               |                |                |                |               |                |
| 应付赎回款                    | -              | -             | -              | -              | -              | 2,776,722.85  | 2,776,722.85   |
| 应付管理人报酬                  | -              | -             | -              | -              | -              | 365,056.04    | 365,056.04     |
| 应付托管费                    | -              | -             | -              | -              | -              | 91,264.02     | 91,264.02      |
| 应付证券清算款                  | -              | -             | -              | -              | -              | 9,386,801.76  | 9,386,801.76   |
| 应付销售服务费                  | -              | -             | -              | -              | -              | 49,357.83     | 49,357.83      |
| 应付交易费用                   | -              | -             | -              | -              | -              | 69,256.43     | 69,256.43      |
| 应交税费                     | -              | -             | -              | -              | -              | 24,565.67     | 24,565.67      |
| 其他负债                     | -              | -             | -              | -              | -              | 83,948.76     | 83,948.76      |
| 负债总计                     | -              | -             | -              | -              | -              | 12,846,973.36 | 12,846,973.36  |
| 利率敏感度缺口                  | 91,232,046.02  | -             | 111,106,833.00 | 350,084,240.82 | 223,060,569.07 | 15,703,099.76 | 791,186,788.67 |
| 上年度末<br>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                     | 36,281,073.67  | -             | -              | -              | -              | -             | 36,281,073.67  |
| 结算备付金                    | 596,587.26     | -             | -              | -              | -              | -             | 596,587.26     |
| 存出保证金                    | 77,427.67      | -             | -              | -              | -              | -             | 77,427.67      |
| 交易性金融资产                  | 52,156,467.50  | 29,298,860.00 | -              | 199,985,377.21 | 164,828,927.78 | 22,089,083.18 | 468,358,715.67 |
| 买入返售金融资产                 | 17,000,000.00  | -             | -              | -              | -              | -             | 17,000,000.00  |
| 应收利息                     | -              | -             | -              | -              | -              | 6,217,332.89  | 6,217,332.89   |
| 应收申购款                    | 74,195.52      | -             | -              | -              | -              | 333,918.50    | 408,114.02     |
| 资产总计                     | 106,185,751.62 | 29,298,860.00 | -              | 199,985,377.21 | 164,828,927.78 | 28,640,334.57 | 528,939,251.18 |
| 负债                       |                |               |                |                |                |               |                |
| 应付赎回款                    | -              | -             | -              | -              | -              | 7,949,494     | 7,949,494      |

|               |               |               |   |                |                |               |                |
|---------------|---------------|---------------|---|----------------|----------------|---------------|----------------|
|               |               |               |   |                |                | . 14          | 14             |
| 应付管理人<br>报酬   | -             | -             | - | -              | -              | 218,694.23    | 218,694.23     |
| 应付托管费         | -             | -             | - | -              | -              | 54,673.54     | 54,673.54      |
| 应付证券清<br>算款   | -             | -             | - | -              | -              | 28,043,123.46 | 28,043,123.46  |
| 卖出回购金<br>融资产款 | 26,119,841.12 | -             | - | -              | -              | -             | 26,119,841.12  |
| 应付销售服<br>务费   | -             | -             | - | -              | -              | 35,071.30     | 35,071.30      |
| 应付交易费<br>用    | -             | -             | - | -              | -              | 76,314.23     | 76,314.23      |
| 应付利息          | -             | -             | - | -              | -              | 4,479.63      | 4,479.63       |
| 应交税费          | -             | -             | - | -              | -              | 30,008.02     | 30,008.02      |
| 其他负债          | -             | -             | - | -              | -              | 168,284.66    | 168,284.66     |
| 负债总计          | 26,119,841.12 | -             | - | -              | -              | 36,580,143.21 | 62,699,984.33  |
| 利率敏感度<br>缺口   | 80,065,910.50 | 29,298,860.00 | - | 199,985,377.21 | 164,828,927.78 | 7,939,808.64  | 466,239,266.85 |

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 | 1. 市场利率下降 1%                    | 20,713,343.54               | 10,103,360.95          |
|    | 2. 市场利率上升 1%                    | -17,080,446.76              | -8,954,864.79          |

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，为交易而持有的债权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<br>2021 年 6 月 30 日 |               | 上年度末<br>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  | 16,772,713.20          | 2.12          | 22,089,083.18            | 4.74          |
| 交易性金融资产—基金投资  | —                      | —             | —                        | —             |
| 交易性金融资产—债券投资  | 698,266,642.89         | 88.26         | 446,269,632.49           | 95.72         |
| 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            | 715,039,356.09         | 90.38         | 468,358,715.67           | 100.45        |

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：本报告期末，本基金持有的权益类资产投资占整体基金资产净值比例为 2.12%，因此除市场利率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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              | 16,772,713.20  | 2.09          |
|    | 其中：股票             | 16,772,713.20  | 2.09          |
| 2  | 基金投资              | —              | —             |
| 3  | 固定收益投资            | 698,266,642.89 | 86.85         |
|    | 其中：债券             | 698,266,642.89 | 86.85         |
|    | 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          | 60,000,000.00  | 7.46          |
|    | 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      | 16,779,655.34  | 2.09          |
| 8  | 其他各项资产            | 12,214,750.60  | 1.52          |
| 9  | 合计                | 804,033,762.03 | 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              | —             | —            |
| C  | 制造业              | 16,772,713.20 | 2.12         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | —             | —            |
| E  | 建筑业              | —             | —            |
| F  | 批发和零售业           | —             | —            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | —             | —            |
| H  | 住宿和餐饮业           | —             | —            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | —             | —            |
| J  | 金融业              | —             | —            |
| K  | 房地产业             | —             | —            |
| L  | 租赁和商务服务业         | —             | —            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | —             | —            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | —             | —            |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | —             | —            |

|   |           |               |      |
|---|-----------|---------------|------|
| P | 教育        | -             | -    |
| Q | 卫生和社会工作   | -             | -    |
| R | 文化、体育和娱乐业 | -             | -    |
| S | 综合        | -             | -    |
|   | 合计        | 16,772,713.20 | 2.12 |

### 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  | 603876 | 鼎胜新材 | 540,184 | 16,772,713.20 | 2.12         |

### 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  | 600782 | 新钢股份 | 68,676,913.92 | 14.73          |
| 2  | 002756 | 永兴材料 | 30,838,747.76 | 6.61           |
| 3  | 603876 | 鼎胜新材 | 27,839,222.44 | 5.97           |
| 4  | 002472 | 双环传动 | 15,537,872.44 | 3.33           |
| 5  | 000932 | 华菱钢铁 | 10,067,018.72 | 2.16           |
| 6  | 600299 | 安迪苏  | 8,687,093.62  | 1.86           |
| 7  | 601233 | 桐昆股份 | 6,082,215.90  | 1.30           |
| 8  | 603901 | 永创智能 | 641,464.76    | 0.14           |

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  | 600782 | 新钢股份 | 66,245,697.91 | 14.21          |
| 2  | 002756 | 永兴材料 | 43,525,371.37 | 9.34           |
| 3  | 002472 | 双环传动 | 15,065,615.92 | 3.23           |
| 4  | 601233 | 桐昆股份 | 13,621,509.02 | 2.92           |
| 5  | 603876 | 鼎胜新材 | 13,238,565.28 | 2.84           |
| 6  | 000932 | 华菱钢铁 | 9,367,419.65  | 2.01           |
| 7  | 600299 | 安迪苏  | 8,714,386.46  | 1.87           |
| 8  | 002831 | 裕同科技 | 5,560,713.29  | 1.19           |
| 9  | 603901 | 永创智能 | 635,422.90    | 0.14           |

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 | 168,370,549.56 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 175,974,701.80 |

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      | 88,037,881.00  | 11.13        |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 40,424,000.00  | 5.11         |
|    | 其中：政策性金融债 | 30,111,000.00  | 3.81         |
| 4  | 企业债券      | 266,465,500.00 | 33.68        |
| 5  | 企业短期融资券   | 29,069,500.00  | 3.67         |
| 6  | 中期票据      | 40,124,000.00  | 5.07         |
| 7  | 可转债（可交换债） | 234,145,761.89 | 29.59        |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 698,266,642.89 | 88.26        |

### 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  | 155539 | 19 西南 02   | 350,000 | 35,245,000.00 | 4.45         |
| 2  | 210005 | 21 付息国债 05 | 300,000 | 30,351,000.00 | 3.84         |
| 3  | 190202 | 19 国开 02   | 300,000 | 30,111,000.00 | 3.81         |
| 4  | 188163 | 21 兖煤 01   | 300,000 | 30,000,000.00 | 3.79         |
| 5  | 019536 | 16 国债 08   | 279,300 | 27,418,881.00 | 3.47         |

### 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：报告期末本基金未持有国债期货。

### 7.10.3 本期国债期货投资评价

报告期末本基金未持有国债期货，故此项不适用。

## 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   | 72,509.78     |
| 2  | 应收证券清算款 | —             |
| 3  | 应收股利    | —             |
| 4  | 应收利息    | 7,435,029.31  |
| 5  | 应收申购款   | 4,707,211.51  |
| 6  | 其他应收款   | —             |
| 7  | 待摊费用    | —             |
| 8  | 其他      | —             |
| 9  | 合计      | 12,214,750.60 |



#### 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<br>(%) |
|----|--------|----------|---------------|------------------|
| 1  | 132017 | 19 新钢 EB | 21,333,833.00 | 2.70             |
| 2  | 110061 | 川投转债     | 16,111,770.00 | 2.04             |
| 3  | 113614 | 健 20 转债  | 13,058,006.00 | 1.65             |
| 4  | 123092 | 天壕转债     | 10,730,134.80 | 1.36             |
| 5  | 128101 | 联创转债     | 10,337,805.74 | 1.31             |
| 6  | 113594 | 淳中转债     | 9,039,700.70  | 1.14             |
| 7  | 128137 | 洁美转债     | 8,946,833.48  | 1.13             |
| 8  | 113593 | 沪工转债     | 8,875,827.00  | 1.12             |
| 9  | 127018 | 本钢转债     | 8,492,288.40  | 1.07             |
| 10 | 128134 | 鸿路转债     | 5,401,200.00  | 0.68             |
| 11 | 110075 | 南航转债     | 5,028,658.80  | 0.64             |
| 12 | 132018 | G 三峡 EB1 | 4,804,800.00  | 0.61             |
| 13 | 123091 | 长海转债     | 4,552,359.96  | 0.58             |
| 14 | 127012 | 招路转债     | 3,746,050.00  | 0.47             |
| 15 | 110076 | 华海转债     | 3,474,116.10  | 0.44             |
| 16 | 128096 | 奥瑞转债     | 2,949,682.50  | 0.37             |
| 17 | 123039 | 开润转债     | 2,498,300.20  | 0.32             |
| 18 | 128109 | 楚江转债     | 2,408,960.40  | 0.30             |
| 19 | 128064 | 司尔转债     | 2,403,600.00  | 0.30             |
| 20 | 128136 | 立讯转债     | 2,339,000.00  | 0.30             |
| 21 | 123085 | 万顺转 2    | 2,296,285.18  | 0.29             |
| 22 | 123035 | 利德转债     | 1,855,350.00  | 0.23             |
| 23 | 113525 | 台华转债     | 1,827,339.60  | 0.23             |
| 24 | 110053 | 苏银转债     | 1,820,400.00  | 0.23             |
| 25 | 113598 | 法兰转债     | 1,567,641.70  | 0.20             |
| 26 | 127014 | 北方转债     | 1,484,717.78  | 0.19             |
| 27 | 123022 | 长信转债     | 1,403,720.00  | 0.18             |
| 28 | 113582 | 火炬转债     | 1,381,000.00  | 0.17             |
| 29 | 127019 | 国城转债     | 1,366,800.00  | 0.17             |
| 30 | 113612 | 永冠转债     | 1,257,800.00  | 0.16             |
| 31 | 113579 | 健友转债     | 1,201,200.00  | 0.15             |
| 32 | 127017 | 万青转债     | 1,178,938.80  | 0.15             |
| 33 | 123073 | 同和转债     | 1,150,800.00  | 0.15             |
| 34 | 128135 | 洽洽转债     | 1,142,000.00  | 0.14             |
| 35 | 113030 | 东风转债     | 1,102,800.00  | 0.14             |
| 36 | 113597 | 佳力转债     | 1,074,500.00  | 0.14             |
| 37 | 113505 | 杭电转债     | 1,042,600.00  | 0.13             |
| 38 | 128022 | 众信转债     | 979,040.00    | 0.12             |
| 39 | 113615 | 金诚转债     | 731,200.00    | 0.09             |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 40 | 128125 | 华阳转债 | 684,096.00 | 0.09 |
| 41 | 127026 | 超声转债 | 538,250.00 | 0.07 |

### 7.11.5 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。

### 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（%） |
| 兴全恒鑫债券 A | 6,589    | 83,569.08 | 317,340,669.70 | 57.63     | 233,295,979.61 | 42.37     |
| 兴全恒鑫债券 C | 2,334    | 57,690.63 | 56,869,161.04  | 42.23     | 77,780,764.44  | 57.77     |
| 合计       | 8,923    | 76,800.02 | 374,209,830.74 | 54.61     | 311,076,744.05 | 45.39     |

### 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 | 兴全恒鑫债券 A | 51,432.03 | 0.0093      |
|                  | 兴全恒鑫债券 C | 1,606.02  | 0.0012      |

|  |    |           |        |
|--|----|-----------|--------|
|  | 合计 | 53,038.05 | 0.0077 |
|--|----|-----------|--------|

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放式基金 | 兴全恒鑫债券 A | 0                 |
|                                | 兴全恒鑫债券 C | 0                 |
|                                | 合计       | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 兴全恒鑫债券 A | 0                 |
|                                | 兴全恒鑫债券 C | 0~10              |
|                                | 合计       | 0~10              |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                                 | 兴全恒鑫债券 A         | 兴全恒鑫债券 C       |
|------------------------------------|------------------|----------------|
| 基金合同生效日<br>（2020 年 1 月 20 日）基金份额总额 | 1,396,363,203.64 | 234,598,777.60 |
| 本报告期期初基金份额总额                       | 317,607,766.83   | 99,470,681.54  |
| 本报告期基金总申购份额                        | 389,742,891.65   | 85,580,915.19  |
| 减：本报告期基金总赎回份额                      | 156,714,009.17   | 50,401,671.25  |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）           | -                | -              |
| 本报告期末基金份额总额                        | 550,636,649.31   | 134,649,925.48 |

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的专门基金托管部门无重大人事变动。

**10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

**10.4 基金投资策略的改变**

报告期内本基金投资策略未发生改变。

**10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

**10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

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

**10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况****10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易           |              | 应支付该券商的佣金  |            | 备注 |
|------|--------|----------------|--------------|------------|------------|----|
|      |        | 成交金额           | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金         | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 兴业证券 | 2      | 175,974,701.80 | 100.00%      | 111,096.97 | 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 | 1,435,925,448.49 | 100.00%      | 2,784,200,000.00 | 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  | 关于增加北京汇成基金销售有限公司 | 证券时报及规定互联网 | 2021-01-14 |

|    |                                  |              |            |
|----|----------------------------------|--------------|------------|
|    | 司、长量基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告       | 网站           |            |
| 2  | 关于增加中原证券为旗下部分基金销售机构的公告           | 证券时报及规定互联网网站 | 2021-03-05 |
| 3  | 关于增加阳光人寿为旗下部分基金销售机构的公告           | 证券时报及规定互联网网站 | 2021-04-01 |
| 4  | 关于增加中金财富证券为旗下部分基金销售机构的公告         | 证券时报及规定互联网网站 | 2021-04-07 |
| 5  | 增加上海大智慧为旗下部分基金销售机构公告             | 证券时报及规定互联网网站 | 2021-04-21 |
| 6  | 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    | 证券时报及规定互联网网站 | 2021-05-14 |
| 7  | 关于增加腾安基金销售为旗下部分基金销售机构的公告         | 证券时报及规定互联网网站 | 2021-05-18 |
| 8  | 关于增加陆金所为旗下部分基金销售机构的公告            | 证券时报及规定互联网网站 | 2021-06-01 |
| 9  | 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 | 证券时报及规定互联网网站 | 2021-06-16 |
| 10 | 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   | 证券时报及规定互联网网站 | 2021-06-17 |
| 11 | 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    | 证券时报及规定互联网网站 | 2021-06-18 |

## § 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鑫债券型证券投资基金募集注册的文件；
2. 《兴全恒鑫债券型证券投资基金基金合同》；
3. 《兴全恒鑫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鑫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