

# 兴全恒益债券型证券投资基金

## 2017 年年度报告摘要

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：兴全基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2017 年 9 月 20 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	兴全恒益债券	
场内简称	-	
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	兴全基金管理有限公司	
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	3,200,159,598.59 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	-	
上市日期	-	
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
下属分级基金的场内简称:	-	-
下属分级基金的交易代码:	004952	004953
下属分级基金的前端交易代码	-	-

下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	2,751,074,425.17 份	449,085,173.42 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。	
	兴全恒益债券 A	兴全恒益债券 C
下属分级基金的风险收益特征	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。	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	兴全基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	冯晓莲
	联系电话	021-20398888
	电子邮箱	fengxl@xqfunds.com
客户服务电话	4006780099, 021-38824536	95588
传真	021-20398858	010-66105798

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.xqfunds.com">http://www.xqfunds.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年 9 月 20 日(基金合同生效日)-2017 年 12 月 31 日	
	兴全恒益债券 A	兴全恒益债券 C
本期已实现收益	29,017,463.25	5,759,438.41
本期利润	7,376,675.16	1,122,214.07
加权平均基金份额本期利润	0.0024	0.0017
本期基金份额净值增长率	0.23%	0.11%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0023	0.0011
期末基金资产净值	2,757,343,109.63	449,582,651.52
期末基金份额净值	1.0023	1.0011

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
过去三个月	0.13%	0.04%	-0.12%	0.16%	0.25%	-0.12%
自基金合同生效起至今	0.23%	0.04%	-0.02%	0.16%	0.25%	-0.12%

兴全恒益债券 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.13%	0.04%	-0.12%	0.16%	0.25%	-0.12%
自基金合同生效起至今	0.23%	0.04%	-0.02%	0.16%	0.25%	-0.12%

		准差②	率③	④		
过去三个月	0.01%	0.04%	-0.12%	0.16%	0.13%	-0.12%
自基金合同 生效起至今	0.11%	0.04%	-0.02%	0.16%	0.13%	-0.12%

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：

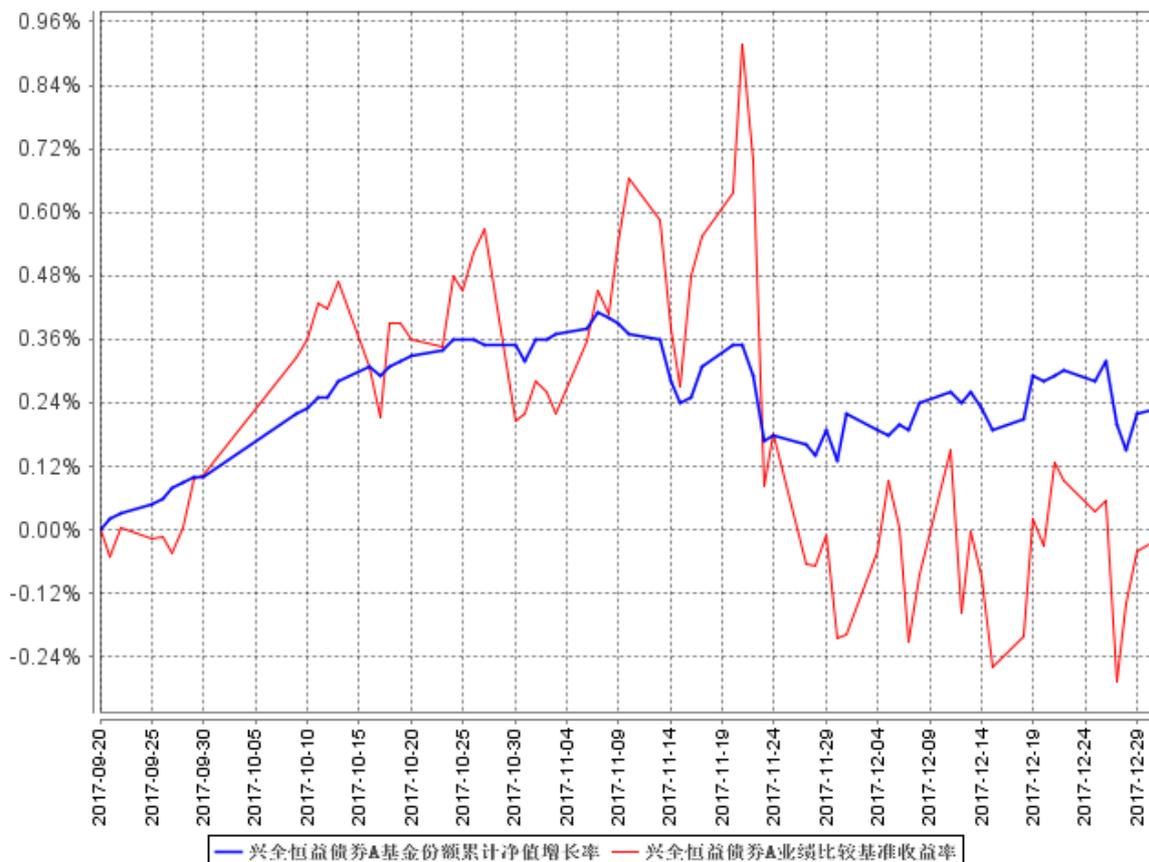
$$\text{Return } t = 80\% \times (\text{中国债券总指数收益率 } t / \text{中国债券总指数收益率 } t-1 - 1) + 20\% \times (\text{沪深 300 指数收益率 } t / \text{沪深 300 指数收益率 } t-1 - 1)$$

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

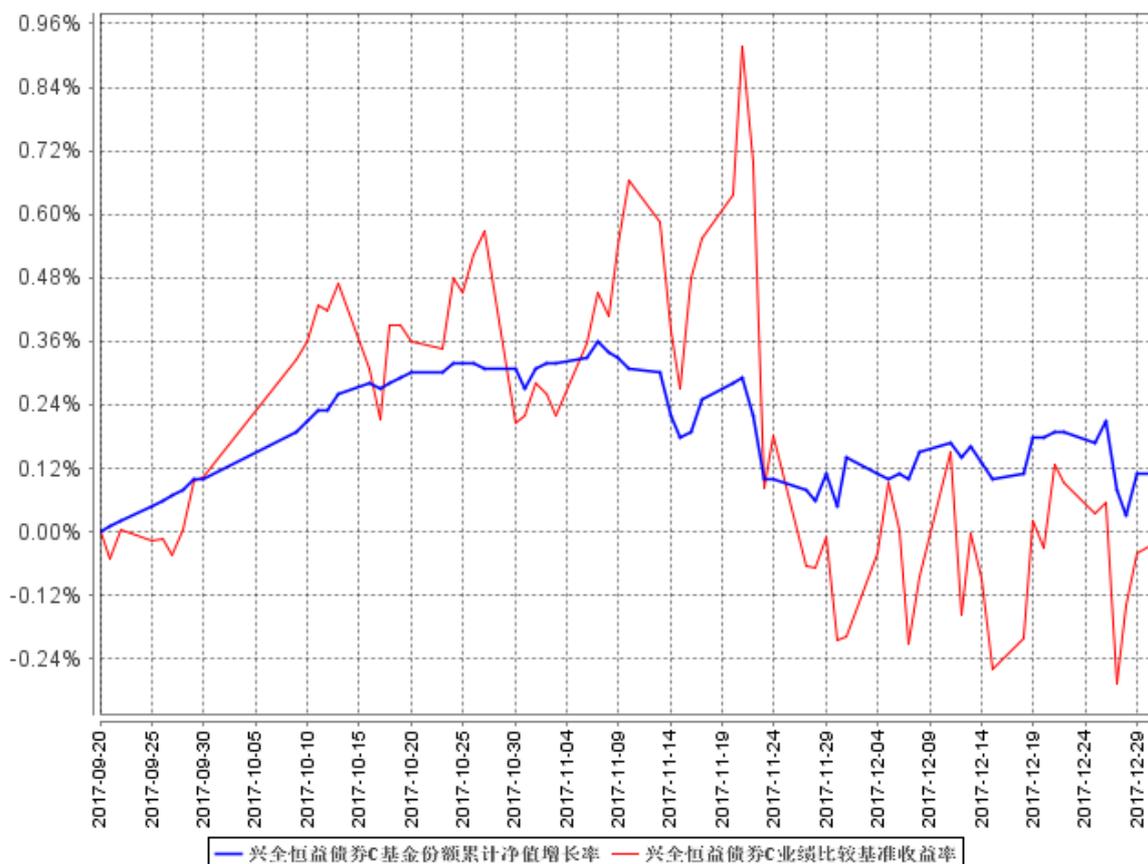
其中， $t=1, 2, 3, \dots, T$ ， $T$  表示时间截至日。

### 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基金份额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基金份额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



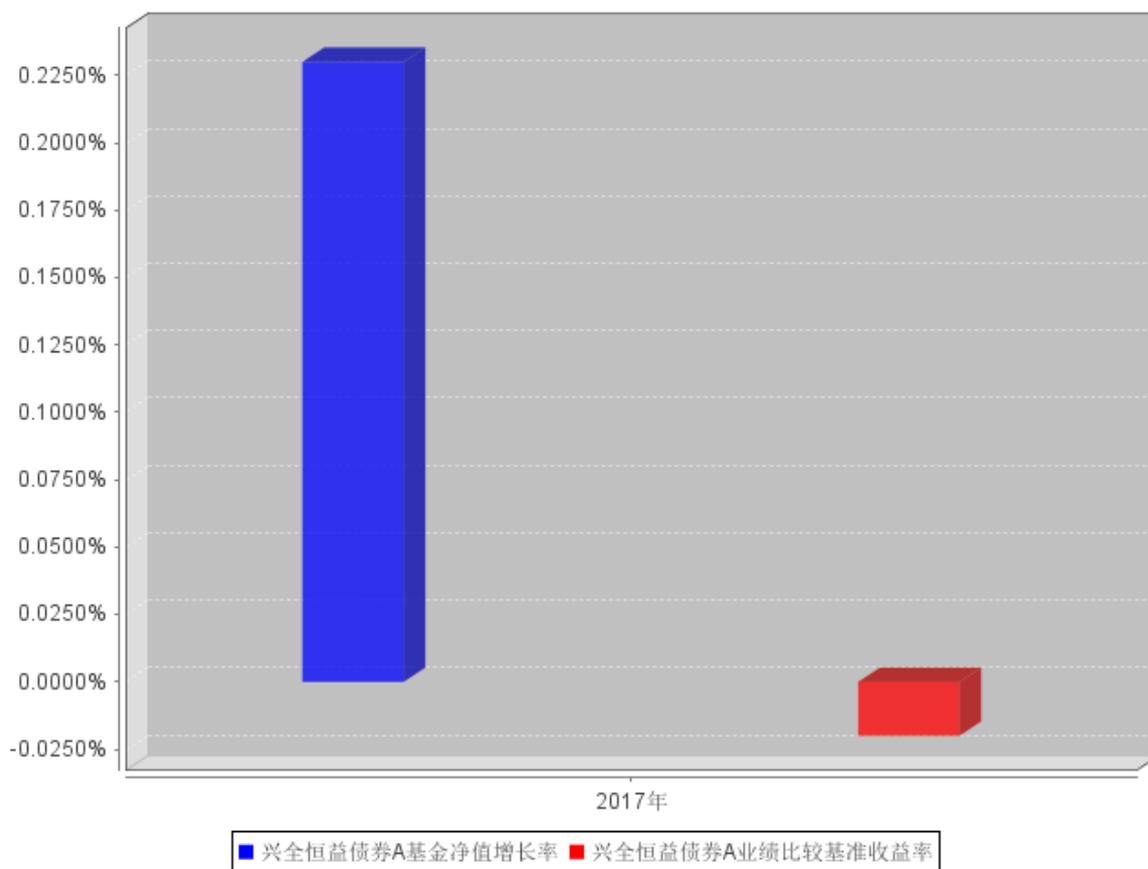
注：1、净值表现所取数据截至到 2017 年 12 月 31 日。

2、按照《兴全恒益债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金应自 2017 年 9 月 20 日成立起六个月内，达到本基金合同规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围，目前本基金还在建仓期内。

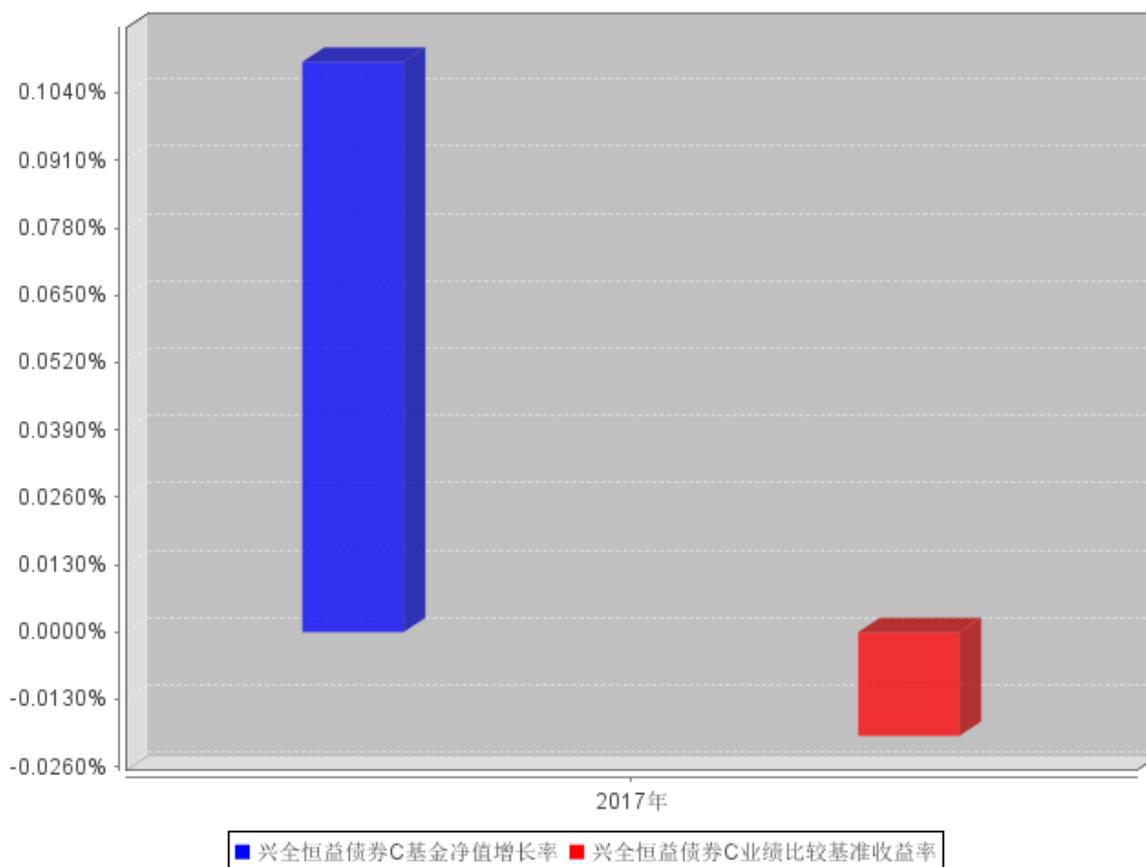
3、本基金成立于 2017 年 9 月 20 日，截止 2017 年 12 月 31 日，本基金成立不满一年。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴全恒益债券A自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 兴全恒益债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：2017年数据统计期间为2017年9月20日（基金合同生效之日）至2017年12月31日，数据按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2017年9月20日）至2017年12月31日期间未进行利润分配。

## § 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

兴全基金管理有限公司（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”。

截止 2017 年 12 月 31 日，公司旗下管理着二十只基金，分别为兴全可转债混合型证券投资基金、兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全货币市场证券投资基金、兴全全球视野股票型证券投资基金、兴全社会责任混合型证券投资基金、兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金、兴全磐稳增利债券型证券投资基金、兴全合润分级混合型证券投资基金、兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）、兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全精选混合型证券投资基金、兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全商业模式优选混合型证券投资基金（LOF）、兴全添利宝货币市场基金、兴全新视野灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、兴全稳益债券型证券投资基金、兴全天添益货币市场基金、兴全稳泰债券型证券投资基金、兴全兴泰定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全恒益债券型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
申庆	本基金、兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理	2017 年 9 月 20 日	-	20 年	工商管理硕士，历任兴全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、基金管理部总监助理、兴全全球视野股票型证券投资基金基金经理。
张睿	固定收益部总监助理，本基金、兴全磐稳增利债券型证券投资基金、兴全	2017 年 9 月 20 日	-	12 年	经济学硕士，历任红顶金融工程研究中心研究部经理，申银万国证券研究所高级分析师，兴全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

	天添益货币市场基金、兴全兴泰定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理				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。
--	------------------------------------	--	--	--	---

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、“证券从业年限”按其从事证券投资、研究等业务的年限计算。

## 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 公平交易制度和控制方法

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

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，确保各投资组合之间得到公平对待，保护投资者的合法权益。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，基金管理人管理的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超过该证券当日总成交量的 5%的交易次数为 1 次，由组合投资策略导致，并经过公司内部风控审核。经检查和分析未发现异常交易情况。

## 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

2017 年债券市场延续了自 2016 年四季度开始的债券熊市，10 年国债和 10 年国开收益率分别上行 87bp 和 130BP，1 年 AAA 存单收益率也上行超过 100BP，收益率曲线呈现平坦化。全年以下跌行情为主，交易性机会仅短暂出现在 3 月下旬和 6 月下旬，尤其四季度出现了收益率超预期大幅上行的情况。影响债券市场的主要有两大因素：一是因城施策和棚改政策下，房地产周期延长，叠加供给侧改革，经济韧性始终较强，各行业盈利继续改善，龙头受益明显，宏观和微观表现出一定的差异性；二是脱虚向实的宏观背景下，监管政策力度超预期，资金面出现分层现象，大部分时间呈现中性偏紧的状态。针对资金空转、表外业务当中的不规范行为等，MPA 考核、货币基金监管政策、资管新规征求意见等陆续出台，对债券的配置需求形成挤压。

股市呈现显著的“二八”分化，大市值龙头企业、周期类企业、价值型企业的股价表现优秀，而业绩一般的中小企业股价则跌跌不休，这也使转债市场产生相应的分化。

恒益于 17 年四季度建仓，期初以存款和同业存单为主，快速建仓，到年末已基本替换为短久期信用债，后续将继续精选个券，优化持仓，维持适度杠杆。转债仓位也在有一定安全垫后逐步增加。

### 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 基金份额净值为 1.0023 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.23%；截至本报告期末兴全恒益债券 C 基金份额净值为 1.0011 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.11%；同期业绩比较基准收益率为-0.02%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于 2018 年，我们认为债券资产配置性价比有所抬升。从绝对收益的角度看，即便不考虑基准利率、宏观经济数据等传统参考因素，各类债券资产的收益率较 2016 年低点已上行 200bp 左右，绝对收益率处于历史波动的较高区间，风险收益比明显改善。

而从基本面的角度看，制约债券市场短期走势的主要因素依然是经济数据和监管政策的边际变化。国内在环保限产的情况下，经济数据回落依然缓慢；而金融去杠杆继续在路，资产管理

新规尚未落地，期间债券配置资金受到限制；此外海外债券收益率回升对市场预期带来一定影响。

本基金在债券方面的投资总体将采取票息为主，等待交易机会的策略，以优质的短期限信用品种配置追求绝对收益，对于长期品种不过分悲观，择机逐步拉长久期。

转债市场仍需精选个券，部分高价位个券性价比走弱，仍然积极关注新发转债机会，对正股估值合理，具备一定成长性的转债进行积极配置。

股票方面，估值水平面临考验。A 股中很多蓝筹公司相对当前的利率环境也不十分具备吸引力。特别是当前市场对“白马”成长性预期偏乐观，谨慎性考量偏少。一旦基本面低于预期会导致这些公司盈利预期和估值水平的双重下降。股票配置更需至上而下控制仓位和风格，至下而上精选个股。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：1、估值委员会制定旗下基金的估值政策和流程，选取适当的估值方法、定期对估值政策和程序进行评价。采用的基金估值方法、政策和程序应经估值委员会审议，并报管理层批准后方可实施。2、估值方法确立后，由 IT 人员或 IT 人员协助估值系统开发商及时对系统中的参数或模型作相应的调整或对系统进行升级，以适应新的估值方法的需要。3、基金会计具体负责执行估值委员会确定的估值策略，并通过与托管行核对等方法确保估值准确无误；4、投资人员（包括基金经理）积极关注市场环境变化及证券发行机构有关影响证券价格的重大事件等可能对估值造成影响的因素，并就可能带来的影响提出建议和意见；5、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有 3 年以上相关工作经验，具备估值业务所需的专业胜任能力。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

-

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

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，兴全恒益债券型证券投资基金的管理人——兴全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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对兴全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 2017 年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 审计报告

本报告期基金财务报告经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师（王国蓓）、（张楠）签字出具了（标准无保留意见）（毕马威华振审字第 1800151 号）标准无保留意见的审计报告。投资者可通过本基金年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：兴全恒益债券型证券投资基金

报告截止日： 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	6,105,003.46
结算备付金		41,032,141.85
存出保证金		115,755.27
交易性金融资产	7.4.7.2	3,885,055,004.04
其中：股票投资		196,429,228.51
基金投资		-
债券投资		3,688,625,775.53
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		11,939,112.73
应收利息	7.4.7.5	52,063,011.64
应收股利		-
应收申购款		3,121.80
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		3,996,313,150.79
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 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	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		768,179,303.98
应付证券清算款		-
应付赎回款		18,190,694.43
应付管理人报酬		1,994,949.43
应付托管费		569,985.55
应付销售服务费		173,668.40
应付交易费用	7.4.7.7	248,911.98
应交税费		-
应付利息		-53,575.01
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	83,450.88
负债合计		789,387,389.64
<b>所有者权益：</b>		

实收基金	7.4.7.9	3,200,159,598.59
未分配利润	7.4.7.10	6,766,162.56
所有者权益合计		3,206,925,761.15
负债和所有者权益总计		3,996,313,150.79

注：1、报告截止日 2017 年 12 月 31 日，兴全恒益债券 A 基金份额净值 1.0023 元，基金份额总额 2,751,074,425.17 份；兴全恒益债券 C 基金份额净值 1.0011 元，基金份额总额 449,085,173.42 份。兴全恒益债券份额总额合计为 3,200,159,598.59 份。

2、本基金合同于 2017 年 9 月 20 日生效，本期财务报表的实际编制期间为自 2017 年 9 月 20 日（基金合同生效日）起至 2017 年 12 月 31 日止。

## 7.2 利润表

会计主体：兴全恒益债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 9 月 20 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 9 月 20 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		25,792,832.07
1.利息收入		50,273,941.97
其中：存款利息收入	7.4.7.11	384,863.37
债券利息收入		35,515,342.59
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		14,373,736.01
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,684,112.19
其中：股票投资收益	7.4.7.12	2,612,702.56
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-928,590.37
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-26,278,012.43
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	112,790.34

减：二、费用		17,293,942.84
1. 管理人报酬	7.4.9.2.1	7,338,908.13
2. 托管费	7.4.9.2.2	2,096,830.91
3. 销售服务费	7.4.9.2.3	767,040.19
4. 交易费用	7.4.7.19	339,355.09
5. 利息支出		6,659,974.75
其中：卖出回购金融资产支出		6,659,974.75
6. 其他费用	7.4.7.20	91,833.77
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		8,498,889.23
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		8,498,889.23

注：本基金合同于 2017 年 9 月 20 日生效，本期数据按实际存续期计算。

### 7.3 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：2017 年 9 月 20 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 9 月 20 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 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）	3,955,626,246.97	-	3,955,626,246.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	8,498,889.23	8,498,889.23
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）	-755,466,648.38	-1,732,726.67	-757,199,375.05
其中：1. 基金申购款	12,226,407.09	23,375.79	12,249,782.88
2. 基金赎回款	-767,693,055.47	-1,756,102.46	-769,449,157.93
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）	3,200,159,598.59	6,766,162.56	3,206,925,761.15

注：本基金合同于 2017 年 9 月 20 日生效，本期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 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

兴全恒益债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《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)，由兴全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全基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券比例不低于基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。

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%。

### 7.4.2 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〈年度报告和半年度报告〉》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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 2017 年 12 月 31 日的财务状况、自 2017 年 9 月 20 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间经营成果和基金净值变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为自 2017 年 9 月 20 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

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

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金目前持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变

动形成的利得或损失计入当期损益。

应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产的现金流量的合同权利终止或将所有权上几乎所有的风险和报酬转移时，本基金终止确认该金融资产。

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

——所转移金融资产的账面价值

——因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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

本基金估计公允价值时，考虑市场参与者在计量日对相关资产或负债进行定价时考虑的特征（包括资产状况及所在位置、对资产出售或者使用的限制等），并采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

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

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益/(损失)核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资。若基金份额持有人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。红利再投资方式免收再投资的费用。基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股

票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发 [2017] 6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本期间未发生重大会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本期间未发生重大会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本期间未发生重大会计差错更正。

## 7.4.6 税项

根据财税[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]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 [2015] 125 号文《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、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) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(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)运营基金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。对基金在 2018 年 1 月 1 日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、债券收入免征增值税。

对香港市场投资者(包括单位和个人)通过基金互认买卖内地基金份额免征增值税。

(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)对基金取得的股票的股息、红利收入,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,股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的,暂减按 25%计入应纳税所得额,股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的,暂免征收个人所得税。

(e)关于香港市场投资者通过基金互认买卖内地基金份额的所得税问题:

对香港市场投资者(包括企业和个人)通过基金互认买卖内地基金份额取得的转让差价所得,暂免征收所得税。

对香港市场投资者(包括企业和个人)通过基金互认从内地基金分配取得的收益,由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时,对香港市场投资者按照 10%的税率代扣所得税;或发行债券的企业向该内地基金分配利息时,对香港市场投资者按照 7%的税率代扣所得税,并由内地上市公司或发行债券的企业向其主管税务机关办理扣缴申报。该内地基金向投资者分配收益时,不再扣缴所得税。

内地基金管理人应当向相关证券登记结算机构提供内地基金的香港市场投资者的相关信息。

(f)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。

(g)对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入,暂不征收企业所得税。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日
活期存款	6,105,003.46
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	6,105,003.46

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	200,959,987.91	196,429,228.51	-4,530,759.40
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,040,387,574.72	1,031,901,775.53
	银行间市场	2,669,985,453.84	2,656,724,000.00
	合计	3,710,373,028.56	3,688,625,775.53
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	3,911,333,016.47	3,885,055,004.04	-26,278,012.43

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末各项买入返售金融资产期末余额为零。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未通过买断式逆回购交易取得债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2017 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	5,182.88
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	18,464.40
应收债券利息	52,039,312.36
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	-
其他	52.00
合计	52,063,011.64

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	204,128.21
银行间市场应付交易费用	44,783.77
合计	248,911.98

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	8,450.88
预提费用	75,000.00
合计	83,450.88

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

兴全恒益债券 A		
项目	本期 2017 年 9 月 20 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额

基金合同生效日	3, 176, 108, 296. 00	3, 176, 108, 296. 00
本期申购	10, 161, 603. 67	10, 161, 603. 67
本期赎回（以“-”号填列）	-435, 195, 474. 50	-435, 195, 474. 50
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2, 751, 074, 425. 17	2, 751, 074, 425. 17

兴全恒益债券 C		
项目	本期 2017 年 9 月 20 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	779, 517, 950. 97	779, 517, 950. 97
本期申购	2, 064, 803. 42	2, 064, 803. 42
本期赎回（以“-”号填列）	-332, 497, 580. 97	-332, 497, 580. 97
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	449, 085, 173. 42	449, 085, 173. 42

注：申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	29, 017, 463. 25	-21, 640, 788. 09	7, 376, 675. 16
本期基金份额交易产生的变动数	-2, 989, 168. 90	1, 881, 178. 20	-1, 107, 990. 70
其中：基金申购款	66, 900. 89	-46, 475. 54	20, 425. 35
基金赎回款	-3, 056, 069. 79	1, 927, 653. 74	-1, 128, 416. 05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	26, 028, 294. 35	-19, 759, 609. 89	6, 268, 684. 46

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	5, 759, 438. 41	-4, 637, 224. 34	1, 122, 214. 07
本期基金份额交易产生的变动数	-2, 038, 761. 88	1, 414, 025. 91	-624, 735. 97
其中：基金申购款	11, 759. 10	-8, 808. 66	2, 950. 44

基金赎回款	-2,050,520.98	1,422,834.57	-627,686.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,720,676.53	-3,223,198.43	497,478.10

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2017年9月20日(基金合同生效日)至2017年12月31日	
活期存款利息收入	241,281.76	
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	143,334.83	
其他	246.78	
合计	384,863.37	

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2017年9月20日(基金合同生效日)至2017年12月31日	
卖出股票成交总额	67,109,881.71	
减：卖出股票成本总额	64,497,179.15	
买卖股票差价收入	2,612,702.56	

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2017年9月20日(基金合同生效日)至2017年12月31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	-928,590.37	
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	-928,590.37	

**7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2017年9月20日(基金合同生效日)至2017年12月31日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	1,743,748,456.49
减:卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	1,733,150,261.07
减:应收利息总额	11,526,785.79
买卖债券差价收入	-928,590.37

**7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.14 贵金属投资收益**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**7.4.7.15 衍生工具收益**

本基金本报告期未投资衍生工具。

**7.4.7.16 股利收益**

本基金本报告期内未获得股利收益。

**7.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2017年9月20日(基金合同生效日)至2017年12月31日
1. 交易性金融资产	-26,278,012.43
——股票投资	-4,530,759.40
——债券投资	-21,747,253.03
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-26,278,012.43

**7.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2017年9月20日(基金合同生效日)至2017年12月31日
基金赎回费收入	104,745.01
转换费收入	8,045.33
合计	112,790.34

**7.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2017年9月20日(基金合同生效日)至2017年12月31日
交易所市场交易费用	312,317.59
银行间市场交易费用	27,037.50
合计	339,355.09

**7.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2017年9月20日(基金合同生效日)至2017年12月31日
审计费用	35,000.00
信息披露费	40,000.00
证券账户开户费	400.00
银行费用	16,433.77
合计	91,833.77

**7.4.7.21 分部报告**

无。

**7.4.8 关联方关系**

关联方名称	与本基金的关系
兴全基金管理有限公司（以下简称“兴全基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（以下简称“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（以下简称“兴业”）	基金管理人的股东、基金销售机构

证券” )	
全球人寿保险国际公司 ( AEGON International B.V)	基金管理人的股东
上海兴全睿众资产管理有限公司	基金管理人控制的公司

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。

#### 7.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.9.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年9月20日(基金合同生效日)至2017年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
兴业证券	317,529,521.20	100.00%

###### 7.4.9.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年9月20日(基金合同生效日)至2017年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
兴业证券	945,256,055.38	100.00%

###### 7.4.9.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年9月20日(基金合同生效日)至2017年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
兴业证券	35,036,030,000.00	100.00%

###### 7.4.9.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年9月20日(基金合同生效日)至2017年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
兴业证券	210,775.72	100.00%	204,128.21	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。

## 7.4.9.2 关联方报酬

### 7.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年9月20日(基金合同生效日)至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	7,338,908.13
其中：支付销售机构的客户维护费	2,932,002.69

注：1、支付基金管理人兴全基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 0.70% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.70%/当年天数。

2、本基金合同于 2017 年 9 月 20 日生效，本期数据按实际存续期计算。

### 7.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年9月20日(基金合同生效日)至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,096,830.91

注：1、支付基金托管人中国工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

2、本基金合同于 2017 年 9 月 20 日生效，本期数据按实际存续期计算。

### 7.4.9.2.3 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 2017年9月20日(基金合同生效日)至2017年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴全恒益债券 A	兴全恒益债券 C	合计
工商银行	-	104,347.39	104,347.39
兴全基金	-	7,034.28	7,034.28
兴业证券	-	154,614.30	154,614.30
合计	-	265,995.97	265,995.97

注：1、兴全恒益 C 日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.40%/当年天数。

2、本基金合同于 2017 年 9 月 20 日生效，本期数据按实际存续期计算。

### 7.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金自 2017 年 9 月 20 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日止期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 7.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

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

本基金管理人自 2017 年 9 月 20 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日止期间未运用固有资金投资本基金。

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

本基金除基金管理人之外的其他关联方自 2017 年 9 月 20 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日止期间未持有本基金。

### 7.4.9.5 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 2017年9月20日(基金合同生效日)至 2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	6,105,003.46	241,281.76	-	-

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。

### 7.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金自 2017 年 9 月 20 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日止期间未在承销期内直接购入关联方承销证券。

### 7.4.9.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.10 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

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

金额单位：人民币元

7.4.10.1.1 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
002228	合兴包装	2017 年 11 月 17 日	2018 年 11 月 20 日	非公开发行流通受限	4.37	4.08	1,716,247	7,499,999.39	7,002,287.76	-
002228	合兴包装	2017 年 11 月 17 日	2019 年 11 月 20 日	非公开发行流通受限	4.37	3.82	1,716,247	7,499,999.39	6,556,063.54	-
002821	凯莱英	2017 年 11 月 20 日	2018 年 5 月 21 日	大宗交易购入流通受限	55.87	57.01	100,000	5,587,000.00	5,701,000.00	-
002821	凯莱英	2017 年 12 月 15 日	2018 年 6 月 15 日	大宗交易购入流通受限	52.73	56.79	100,000	5,273,000.00	5,679,000.00	-

7.4.10.1.2 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
123003	蓝思转债	2017 年 12 月 13 日	2018 年 1 月 17 日	新债未上市	100.00	100.00	30	3,000.00	3,000.00	-
123005	万信转债	2017 年 12 月 22 日	2018 年 1 月 30 日	新债未上市	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.00	-
128032	双环转债	2017 年 12 月 28 日	2018 年 1 月 25 日	新债未上市	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.00	-
110042	航电转债	2017 年 12 月 28 日	2018 年 1 月 15 日	新债未上市	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.00	-

注：上述可流通日系本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。

##### 7.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 7.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 170,679,303.98 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
101558022	15 中集 MTN001	2018 年 1 月 3 日	100.14	500,000	50,070,000.00
101659002	16 张家经开 MTN001	2018 年 1 月 3 日	98.66	60,000	5,919,600.00
101752021	17 新城控股 MTN003	2018 年 1 月 3 日	99.58	500,000	49,790,000.00
170415	17 农发 15	2018 年 1 月 3 日	95.66	380,000	36,350,800.00
170415	17 农发 15	2018 年 1 月 4 日	95.66	320,000	30,611,200.00
合计				1,760,000	172,741,600.00

#### 7.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 597,500,000.00 元，分别于 2018 年 1 月 2 日及 2018 年 1 月 25 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

### 7.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### (1) 以公允价值计量的资产和负债

下文列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

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

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

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

于 2017 年 12 月 31 日, 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 283, 289, 500. 14 元, 第二层次的余额为人民币 3, 601, 765, 503. 90 元, 无属于第三层次的余额。

(a) 第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券, 若出现重大事项停牌、交易不活跃 (包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况时, 本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度, 确定相关证券公允价值的层次。

(b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 12 月 31 日, 本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

(2) 其他金融工具的公允价值 (期末非以公允价值计量的项目)

其他金融工具主要包括应收款项和其他金融负债, 其账面价值与公允价值之间无重大差异。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位: 人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	196, 429, 228. 51	4. 92
	其中: 股票	196, 429, 228. 51	4. 92
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3, 688, 625, 775. 53	92. 30
	其中: 债券	3, 688, 625, 775. 53	92. 30
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	47, 137, 145. 31	1. 18
8	其他各项资产	64, 121, 001. 44	1. 60
9	合计	3, 996, 313, 150. 79	100. 00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	555,000.00	0.02
B	采矿业	3,414,000.00	0.11
C	制造业	76,192,074.93	2.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,757,867.28	0.05
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,698,000.00	0.08
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	1,665,250.30	0.05
J	金融业	104,279,036.00	3.25
K	房地产业	5,868,000.00	0.18
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	196,429,228.51	6.13

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	占基金资产净值比例（%）
1	601988	中国银行	7,000,000	27,790,000.00	0.87
2	600195	中牧股份	1,380,000	27,199,800.00	0.85
3	601328	交通银行	4,280,000	26,578,800.00	0.83
4	601997	贵阳银行	1,318,000	17,608,480.00	0.55
5	002228	合兴包装	3,432,494	13,558,351.30	0.42
6	002821	凯莱英	200,000	11,380,000.00	0.35
7	601009	南京银行	1,400,000	10,836,000.00	0.34
8	600015	华夏银行	1,018,084	9,162,756.00	0.29
9	600873	梅花生物	1,750,000	9,030,000.00	0.28
10	000403	ST生化	282,431	8,396,673.63	0.26

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	000403	ST生化	63,857,574.57	1.99
2	601988	中国银行	27,814,020.00	0.87
3	601328	交通银行	26,751,495.00	0.83
4	600195	中牧股份	26,377,238.00	0.82
5	601997	贵阳银行	19,215,720.00	0.60
6	002228	合兴包装	14,999,998.78	0.47
7	600873	梅花生物	14,334,443.14	0.45
8	601009	南京银行	11,059,000.00	0.34
9	002821	凯莱英	10,860,000.00	0.34
10	600015	华夏银行	9,344,860.20	0.29
11	300385	雪浪环境	8,233,590.00	0.26

12	600315	上海家化	5,801,026.00	0.18
13	601628	中国人寿	5,719,996.00	0.18
14	601601	中国太保	5,520,000.00	0.17
15	001979	招商蛇口	5,414,338.00	0.17
16	600827	百联股份	2,911,200.00	0.09
17	601699	潞安环能	2,780,942.00	0.09
18	600795	国电电力	1,965,889.12	0.06
19	600637	东方明珠	1,874,156.25	0.06
20	601118	海南橡胶	613,000.00	0.02

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	000403	ST 生化	57,000,864.70	1.78
2	600315	上海家化	5,781,489.60	0.18
3	600873	梅花生物	4,246,196.16	0.13
4	600795	国电电力	62,807.25	0.00
5	600025	华能水电	18,524.00	0.00

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	265,457,167.06
卖出股票收入（成交）总额	67,109,881.71

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

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	176,688,000.00	5.51
2	央行票据	-	-
3	金融债券	123,819,997.40	3.86
	其中：政策性金融债	123,819,997.40	3.86

4	企业债券	735,244,155.20	22.93
5	企业短期融资券	804,355,000.00	25.08
6	中期票据	1,026,582,000.00	32.01
7	可转债（可交换债）	111,804,622.93	3.49
8	同业存单	710,132,000.00	22.14
9	其他	-	-
10	合计	3,688,625,775.53	115.02

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	111714282	17 江苏银行 CD282	3,000,000	285,780,000.00	8.91
2	020209	17 贴债 53	1,800,000	176,688,000.00	5.51
3	111786285	17 广州农村商业银行 CD179	1,500,000	142,785,000.00	4.45
4	112384	16 歌尔 01	1,000,000	98,230,000.00	3.06
5	111786707	17 青岛银行 CD181	1,000,000	97,670,000.00	3.05

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

#### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 8.11.3 本期国债期货投资评价

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

### 8.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.12.1 本期国债期货投资政策

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

#### 8.12.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 8.12.3 本期国债期货投资评价

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，并且未在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 8.12.2

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。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	115,755.27
2	应收证券清算款	11,939,112.73
3	应收股利	-
4	应收利息	52,063,011.64
5	应收申购款	3,121.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	64,121,001.44

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	132004	15 国盛 EB	27,417,000.00	0.85
2	110033	国贸转债	5,776,500.00	0.18
3	113011	光大转债	5,740,350.00	0.18
4	113009	广汽转债	4,894,121.70	0.15
5	132002	15 天集 EB	1,028,000.00	0.03
6	113008	电气转债	493,900.00	0.02

#### 8.12.5 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	002228	合兴包装	13,558,351.30	0.42	非公开发行
2	002821	凯莱英	11,380,000.00	0.35	大宗流通受限

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
兴全恒益债券A	22,212	123,855.32	545,429,202.83	19.83%	2,205,645,222.34	80.17%
兴全恒益债券C	4,772	94,108.38	2,422,817.39	0.54%	446,662,356.03	99.46%
合计	26,984	118,594.71	547,852,020.22	17.12%	2,652,307,578.37	82.88%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	兴全恒益债券A	690,510.31	0.0251%
	兴全恒益债券C	23,121.55	0.0051%
	合计	713,631.86	0.0223%

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

### 9.3 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的情况

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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	兴全恒益债券 A	兴全恒益债券 C
基金合同生效日（2017 年 9 月 20 日）基金份额总额	3,176,108,296.00	779,517,950.97
本报告期期初基金份额总额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	10,161,603.67	2,064,803.42
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	435,195,474.50	332,497,580.97
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	2,751,074,425.17	449,085,173.42

注：总申购份额含红利再投资、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 报告期内本基金基金管理人重大人事变动。

1) 2017 年 1 月 21 日公告，自 2017 年 1 月 19 日起，杨东先生离任公司总经理，由董事长庄园芳女士代任公司总经理。

2) 2017 年 7 月 13 日公告，自 2017 年 7 月 12 日起，庄园芳女士离任公司董事长及法定代表人；自 2017 年 7 月 13 日起，兰荣先生担任公司董事长及法定代表人，庄园芳女士担任公司总经理。

(2) 报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。本年度支付给所聘任的会计师事务所 3.5 万元人民币。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
兴业证券	2	317,529,521.20	100.00%	210,775.72	100.00%	-

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

#### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额	成交金额	占当期权证成交总额的比例

				的比例		
兴业证券	945,256,055.38	100.00%	35,036,030,000.00	100.00%	-	-

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
-	-	-	-	-	-	-	-
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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

兴全基金管理有限公司  
2018 年 3 月 30 日