

# 兴全恒嘉 30 天持有期债券型证券投资基金

## 2026 年中期报告

2026 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：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2026 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 5         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| 3.3 其他指标                                | 9         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>10</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 10        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 11        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 11        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 11        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 12        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 12        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 13        |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 13        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>13</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 13        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 13        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 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                                 | 15        |
| 6.3 净资产变动表                              | 16        |
| 6.4 报表附注                                | 18        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>39</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 39        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 40        |
| 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       | 40        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 40        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 40        |
| 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      | 41        |
| 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   | 41        |

|                                             |           |
|---------------------------------------------|-----------|
| 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 ..... | 41        |
| 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 .....    | 41        |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 41        |
| 7.11 投资组合报告附注 .....                         | 42        |
| <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 .....              | 43        |
| 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>44</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>44</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 44        |
| 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 .....                        | 45        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 45        |
| 10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....          | 45        |
| 10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 .....      | 45        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 46        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>46</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 .....    | 46        |
| 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>47</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 47        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 47        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 47        |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

|                     |                       |                    |                    |
|---------------------|-----------------------|--------------------|--------------------|
| 基金名称                | 兴全恒嘉 30 天持有期债券型证券投资基金 |                    |                    |
| 基金简称                | 兴全恒嘉 30 天持有债券         |                    |                    |
| 基金主代码               | 022318                |                    |                    |
| 基金运作方式              | 契约型开放式                |                    |                    |
| 基金合同生效日             | 2024 年 12 月 2 日       |                    |                    |
| 基金管理人               | 兴证全球基金管理有限公司          |                    |                    |
| 基金托管人               | 上海浦东发展银行股份有限公司        |                    |                    |
| 报告期末基金份<br>额总额      | 6,405,093,536.47 份    |                    |                    |
| 基金合同存续期             | 不定期                   |                    |                    |
| 下属分级基金的基<br>金简称     | 兴全恒嘉 30 天持有债券<br>A    | 兴全恒嘉 30 天持有债券<br>C | 兴全恒嘉 30 天持有债券<br>E |
| 下属分级基金的交<br>易代码     | 022318                | 022319             | 023166             |
| 报告期末下属分级<br>基金的份额总额 | 2,023,894,088.25 份    | 4,380,177,139.67 份 | 1,022,308.55 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   | 本基金的投资策略可以细分为资产配置策略、债券类属资产配置、债券投资组合策略、资产支持证券投资策略、证券公司短期公司债投资策略、国债期货交易策略、信用衍生品投资策略等。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合全价（总值）指数收益率                                                                     |
| 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                        | 上海浦东发展银行股份有限公司           |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 杨卫东                                 | 汪小敏                      |
|             | 联系电话 | 021-20398888                        | 021-31888888             |
|             | 电子邮箱 | yangwd@xqfunds.com                  | wangxm8@spdb.com.cn      |
| 客户服务电话      |      | 4006780099，021-38824536             | 95528                    |
| 传真          |      | 021-20398988                        | 021-63602540             |
| 注册地址        |      | 上海市黄浦区金陵东路 368 号                    | 上海市中山东一路 12 号            |
| 办公地址        |      | 上海市浦东新区芳甸路 1155 号<br>嘉里城办公楼 28-29 楼 | 上海市博成路 1388 号浦银中心<br>A 栋 |
| 邮政编码        |      | 201204                              | 200126                   |
| 法定代表人       |      | 庄园芳                                 | 张为忠                      |

2.4 信息披露方式

|                   |                                                             |
|-------------------|-------------------------------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称    | 上海证券报                                                       |
| 登载基金中期报告的管理人互联网网址 | <a href="http://www.xqfunds.com">http://www.xqfunds.com</a> |
| 基金中期报告置备地点        | 基金管理人、基金托管人住所                                               |

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 | 上海市浦东新区锦康路 308 号陆家嘴世纪金融广场 6 号楼 13 层 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日) |                    |                    |
|---------------|-------------------------------------|--------------------|--------------------|
|               | 兴全恒嘉 30 天持有债券<br>A                  | 兴全恒嘉 30 天持有债券<br>C | 兴全恒嘉 30 天持有债券<br>E |
| 本期已实现收益       | 16,129,228.89                       | 46,630,873.52      | 10,948.87          |
| 本期利润          | 15,827,242.27                       | 46,288,249.34      | 10,849.46          |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0107                              | 0.0098             | 0.0109             |
| 本期加权平均净值利润率   | 1.03%                               | 0.95%              | 1.05%              |
| 本期基金份额净值增长率   | 1.07%                               | 0.96%              | 1.06%              |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2026 年 6 月 30 日)               |                    |                    |
| 期末可供分配利润      | 84,508,459.10                       | 168,899,941.40     | 42,522.34          |

|              |                       |                  |              |
|--------------|-----------------------|------------------|--------------|
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0418                | 0.0386           | 0.0416       |
| 期末基金资产净值     | 2,108,402,547.35      | 4,549,077,081.07 | 1,064,830.89 |
| 期末基金份额净值     | 1.0418                | 1.0386           | 1.0416       |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2026 年 6 月 30 日) |                  |              |
| 基金份额累计净值增长率  | 4.18%                 | 3.86%            | 3.47%        |

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴全恒嘉 30 天持有债券 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      | 0.51%    | 0.01%       | 0.62%      | 0.04%         | -0.11% | -0.03% |
| 过去六个月      | 1.07%    | 0.01%       | 0.91%      | 0.04%         | 0.16%  | -0.03% |
| 过去一年       | 2.14%    | 0.01%       | -0.56%     | 0.06%         | 2.70%  | -0.05% |
| 自基金合同生效起至今 | 4.18%    | 0.02%       | 0.84%      | 0.08%         | 3.34%  | -0.06% |

兴全恒嘉 30 天持有债券 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          | 0.46% | 0.01% | 0.62%  | 0.04% | -0.16% | -0.03% |
| 过去六个月          | 0.96% | 0.01% | 0.91%  | 0.04% | 0.05%  | -0.03% |
| 过去一年           | 1.93% | 0.01% | -0.56% | 0.06% | 2.49%  | -0.05% |
| 自基金合同生效<br>起至今 | 3.86% | 0.02% | 0.84%  | 0.08% | 3.02%  | -0.06% |

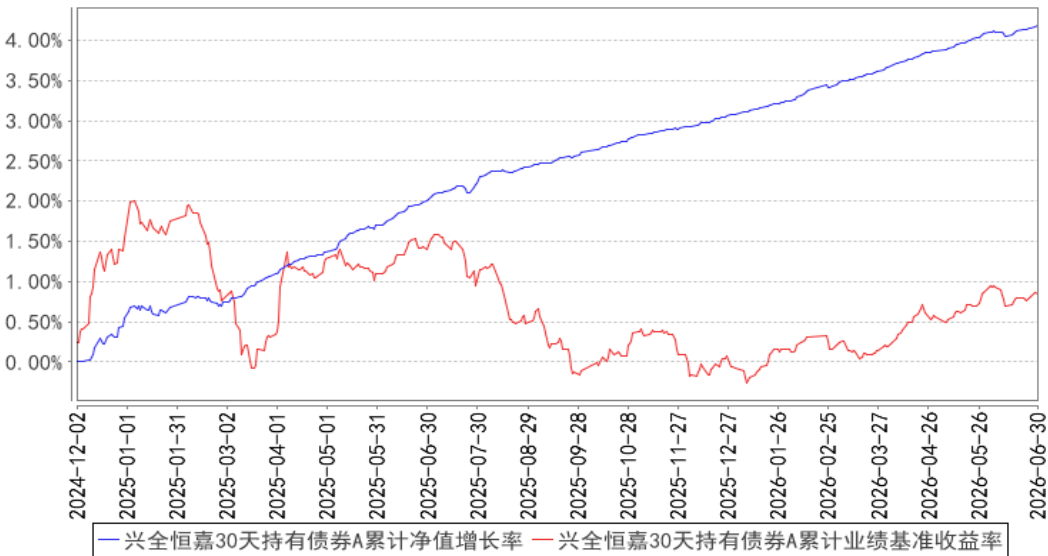
兴全恒嘉 30 天持有债券 E

| 阶段             | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基准<br>收益率标准差<br>④ | ①—③    | ②—④    |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | 0.50%        | 0.01%               | 0.62%              | 0.04%                 | -0.12% | -0.03% |
| 过去六个月          | 1.06%        | 0.01%               | 0.91%              | 0.04%                 | 0.15%  | -0.03% |
| 过去一年           | 2.14%        | 0.01%               | -0.56%             | 0.06%                 | 2.70%  | -0.05% |
| 自基金合同生效<br>起至今 | 3.47%        | 0.02%               | -1.13%             | 0.07%                 | 4.60%  | -0.05% |

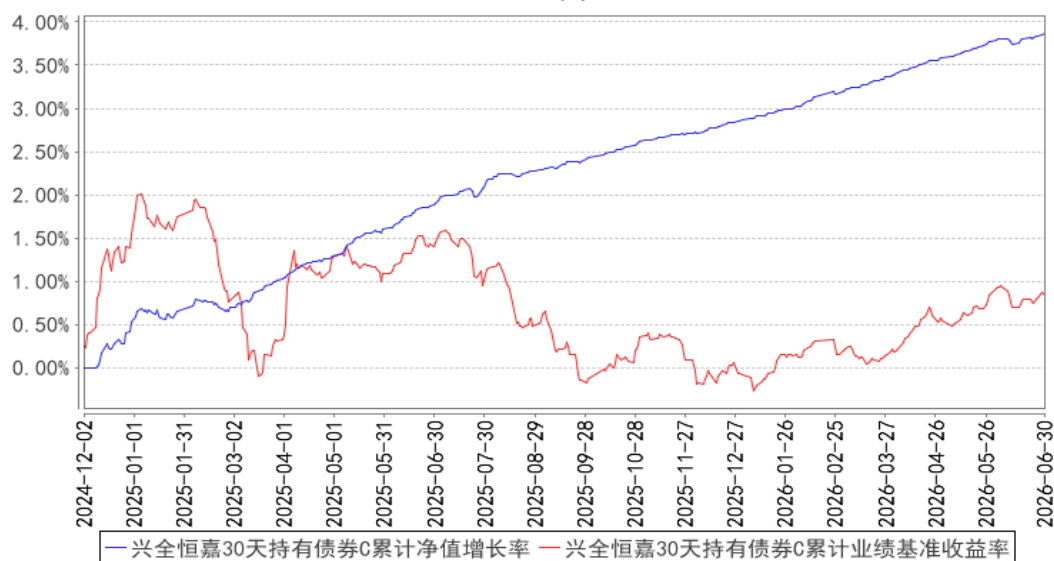
注：本基金业绩比较基准为中债综合全价（总值）指数收益率，是根据基金合同中投资策略及资产配置比例等相关规定构建，能够较好地反映本基金的风险收益特征。本基金每个交易日对业绩比较基准依据合同约定的权重比例进行再平衡处理，并用每日连乘方式计算得到指数基准的时间序列。

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

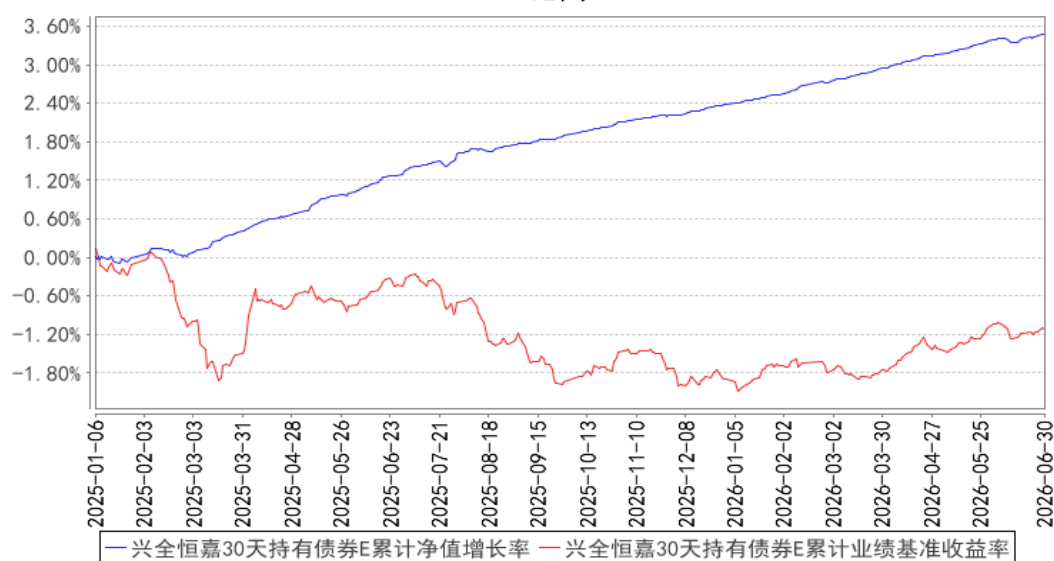
兴全恒嘉30天持有债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



兴全恒嘉30天持有债券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



兴全恒嘉30天持有债券E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 2026 年 06 月 30 日。

2、按照《兴全恒嘉 30 天持有期债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金建仓期为 2024 年 12 月 02 日起共计六个月。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本基金投资组合的比例范围。

3、本基金 E 类基金份额于 2025 年 01 月 06 日开始运作。

### 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“兴证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 2026 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 89 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 |        |                                                                                                                               |
| 邓娟 | 兴全添利宝货币市场基金基金经理、兴全恒利一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理、兴全恒嘉 30 天持有期债券型证券投资基金基金经理、兴全 | 2024 年 12 月 2 日 | -    | 11 年   | 硕士。历任兴证全球基金管理有限公司固定收益部研究员、交易员，兴全添利宝货币市场基金基金经理助理、兴全天添益货币市场基金基金经理助理和兴全磐稳增利债券型证券投资基金基金经理助理、兴全货币市场基金基金经理、兴证全球恒远债券型证券投资基金基金经理基金经理。 |

|  |                             |  |  |  |  |
|--|-----------------------------|--|--|--|--|
|  | 恒荣债券<br>型证券投<br>资基金基<br>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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本报告期末，本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划的投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全恒嘉 30 天持有期债券型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，债券市场收益整体下行。一季度，国内经济温和复苏，但美伊冲突导致经济不确定性加大，权益市场出现一定调整。二季度，国内经济数据边际走弱，外需较好，内需仍较弱，国

内融资需求仍待改善。与此同时，受美伊冲突影响，油价波动较大，受输入性通胀和基数影响，国内 PPI 走高。在上游价格上涨，下游需求尚未回暖的双重影响下，国内经济承压。在此背景下，国内货币政策维持宽松，财政支出节奏偏慢，债券收益率下行，超长债在通胀担忧和供需格局偏弱的环境下下行幅度较小。

本组合在运作期内，采用稳健的投资策略，平衡好收益和波动，为投资人贡献了一定的投资收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，兴全恒嘉 30 天持有债券 A 的基金份额净值为 1.0418 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.07%，同期业绩比较基准收益率为 0.91%；兴全恒嘉 30 天持有债券 C 的基金份额净值为 1.0386 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.96%，同期业绩比较基准收益率为 0.91%；兴全恒嘉 30 天持有债券 E 的基金份额净值为 1.0416 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.06%，同期业绩比较基准收益率为 0.91%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内经济处于新旧动能切换的关键阶段，以地产为代表的旧经济仍处于筑底阶段。上半年出口对经济形成较大支撑，内需仍偏弱，经济增速放缓。以完成全年经济增长为目标，下半年存量财政政策预计加速落地，但在海外不确定性较大以及国内债务压力偏大的背景下，预计财政刺激力度偏温和，货币政策维持宽松，资金利率低位运行。

在经历上半年下行后，债券资产的性价比有所下降，但在较大的债务压力和宽松的货币政策情况下，大幅调整的可能性较小。我们将在市场出现调整后，积极进行配置。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：1、估值委员会制定旗下基金的估值政策和流程，选取适当的估值方法、定期对估值政策和程序进行评价。采用的基金估值方法、政策和程序应经估值委员会审议，并报管理层批准后方可实施。2、估值方法确立后，由 IT 人员或 IT 人员协助估值系统开发商及时对系统中的参数或模型作相应的调整或对系统进行升级，以适应新的估值方法的需要。3、基金会计具体负责执行估值委员会确定的估值策略，并通过与托管行核对等方法确保估值准确无误；4、投资人员（包括基金经理）积极关注市场环境变化及证券发行机构有关影响证券价格的重大事件等可能对估值造成影响的因素，并就可能带来的影响提出建议和意见；5、合规管理人员参与估值方案的制定，确保估值方案符合相关法律法规及基金合同的约定；负责基金估值业务的定期和临时信息披露。6、审计部对估值流程、估值结果等进行检查，确保估值委员会决议的有效

执行。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《兴全恒嘉 30 天持有期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。

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

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

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对兴全恒嘉 30 天持有期债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对兴全恒嘉 30 天持有期债券型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本报告期内，由兴证全球基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：兴全恒嘉 30 天持有期债券型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产           | 附注号        | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日         |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>   |            |                                |                                  |
| 货币资金          | 6.4.7.1    | 558,120.79                     | 465,646.57                       |
| 结算备付金         |            | -                              | -                                |
| 存出保证金         |            | -                              | 2,184.33                         |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 8,014,093,630.35               | 5,693,737,231.40                 |
| 其中：股票投资       |            | -                              | -                                |
| 基金投资          |            | -                              | -                                |
| 债券投资          |            | 8,014,093,630.35               | 5,693,737,231.40                 |
| 资产支持证券投资      |            | -                              | -                                |
| 贵金属投资         |            | -                              | -                                |
| 其他投资          |            | -                              | -                                |
| 衍生金融资产        | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产      | 6.4.7.4    | -                              | -                                |
| 债权投资          | 6.4.7.5    | -                              | -                                |
| 其中：债券投资       |            | -                              | -                                |
| 资产支持证券投资      |            | -                              | -                                |
| 其他投资          |            | -                              | -                                |
| 其他债权投资        | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 其他权益工具投资      | 6.4.7.7    | -                              | -                                |
| 应收清算款         |            | -                              | -                                |
| 应收股利          |            | -                              | -                                |
| 应收申购款         |            | 14,752,089.35                  | 88,390,904.47                    |
| 递延所得税资产       |            | -                              | -                                |
| 其他资产          | 6.4.7.8    | -                              | -                                |
| 资产总计          |            | 8,029,403,840.49               | 5,782,595,966.77                 |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2026 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2025 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     |            | 1,279,004,177.53               | 611,672,624.23                   |
| 应付清算款         |            | -                              | -                                |
| 应付赎回款         |            | 89,128,409.78                  | 16,363,536.82                    |
| 应付管理人报酬       |            | 1,145,631.94                   | 631,041.09                       |
| 应付托管费         |            | 286,407.97                     | 157,760.29                       |
| 应付销售服务费       |            | 835,076.49                     | 533,275.49                       |
| 应付投资顾问费       |            | -                              | -                                |
| 应交税费          |            | 200,383.66                     | 73,639.94                        |
| 应付利润          |            | -                              | -                                |
| 递延所得税负债       |            | -                              | -                                |

|          |          |                  |                  |
|----------|----------|------------------|------------------|
| 其他负债     | 6.4.7.9  | 259,293.81       | 278,581.46       |
| 负债合计     |          | 1,370,859,381.18 | 629,710,459.32   |
| 净资产:     |          |                  |                  |
| 实收基金     | 6.4.7.10 | 6,405,093,536.47 | 5,006,669,659.33 |
| 其他综合收益   | 6.4.7.11 | -                | -                |
| 未分配利润    | 6.4.7.12 | 253,450,922.84   | 146,215,848.12   |
| 净资产合计    |          | 6,658,544,459.31 | 5,152,885,507.45 |
| 负债和净资产总计 |          | 8,029,403,840.49 | 5,782,595,966.77 |

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，兴全恒嘉 30 天持有债券 A 基金份额净值 1.0418 元，基金份额总额 2,023,894,088.25 份；兴全恒嘉 30 天持有债券 C 基金份额净值 1.0386 元，基金份额总额 4,380,177,139.67 份；兴全恒嘉 30 天持有债券 E 基金份额净值 1.0416 元，基金份额总额 1,022,308.55 份。兴全恒嘉 30 天持有债券份额总额合计为 6,405,093,536.47 份。

6.2 利润表

会计主体：兴全恒嘉 30 天持有期债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                   | 附注号      | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025<br>年 6 月 30 日 |
|-----------------------|----------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 一、营业总收入               |          | 83,699,676.59                            | 4,950,553.01                                  |
| 1. 利息收入               |          | 1,610,441.23                             | 35,777.36                                     |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.13 | 1,242,892.60                             | 6,257.69                                      |
| 债券利息收入                |          | -                                        | -                                             |
| 资产支持证券利息收入            |          | -                                        | -                                             |
| 买入返售金融资产收入            |          | 367,548.63                               | 29,519.67                                     |
| 其他利息收入                |          | -                                        | -                                             |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）     |          | 82,733,945.57                            | 5,244,800.05                                  |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.14 | -                                        | -                                             |
| 基金投资收益                |          | -                                        | -                                             |
| 债券投资收益                | 6.4.7.15 | 82,733,945.57                            | 5,244,800.05                                  |
| 资产支持证券投资              | 6.4.7.16 | -                                        | -                                             |
| 收益                    |          |                                          |                                               |
| 贵金属投资收益               | 6.4.7.17 | -                                        | -                                             |
| 衍生工具收益                | 6.4.7.18 | -                                        | -                                             |
| 股利收益                  | 6.4.7.19 | -                                        | -                                             |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 |          | -                                        | -                                             |

|                            |            |               |              |
|----------------------------|------------|---------------|--------------|
| 其他投资收益                     |            | -             | -            |
| 3. 公允价值变动收益<br>(损失以“-”号填列) | 6.4.7.20   | -644,710.21   | -330,024.40  |
| 4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)         |            | -             | -            |
| 5. 其他收入(损失以“-”号填列)         | 6.4.7.21   | -             | -            |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 21,573,335.52 | 1,109,349.82 |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 6,345,369.75  | 262,845.41   |
| 其中：暂估管理人报酬                 |            | -             | -            |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 1,586,342.44  | 65,711.39    |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 4,831,713.88  | 119,720.85   |
| 4. 投资顾问费                   |            | -             | -            |
| 5. 利息支出                    |            | 8,583,819.86  | 542,967.54   |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 8,583,819.86  | 542,967.54   |
| 6. 信用减值损失                  | 6.4.7.22   | -             | -            |
| 7. 税金及附加                   |            | 93,543.51     | 10,595.72    |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.23   | 132,546.08    | 107,508.91   |
| <b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b> |            | 62,126,341.07 | 3,841,203.19 |
| 减：所得税费用                    |            | -             | -            |
| <b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>   |            | 62,126,341.07 | 3,841,203.19 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | -             | -            |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | 62,126,341.07 | 3,841,203.19 |

6.3 净资产变动表

会计主体：兴全恒嘉 30 天持有期债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |        |                |                  |
|-----------|---------------------------------------|--------|----------------|------------------|
|           | 实收基金                                  | 其他综合收益 | 未分配利润          | 净资产合计            |
| 一、上期期末净资产 | 5,006,669,659.33                      | -      | 146,215,848.12 | 5,152,885,507.45 |
| 加：会计政策变更  | -                                     | -      | -              | -                |
| 前期差错更正    | -                                     | -      | -              | -                |

|                                          |                                            |        |                 |                   |
|------------------------------------------|--------------------------------------------|--------|-----------------|-------------------|
| 其他                                       | -                                          | -      | -               | -                 |
| 二、本期期初净资产                                | 5,006,669,659.33                           | -      | 146,215,848.12  | 5,152,885,507.45  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | 1,398,423,877.14                           | -      | 107,235,074.72  | 1,505,658,951.86  |
| (一)、综合收益总额                               | -                                          | -      | 62,126,341.07   | 62,126,341.07     |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)      | 1,398,423,877.14                           | -      | 45,108,733.65   | 1,443,532,610.79  |
| 其中：1. 基金申购款                              | 8,208,617,989.64                           | -      | 278,547,116.48  | 8,487,165,106.12  |
| 2. 基金赎回款                                 | -6,810,194,112.50                          | -      | -233,438,382.83 | -7,043,632,495.33 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | -                                          | -      | -               | -                 |
| (四)、其他综合收益结转留存收益                         | -                                          | -      | -               | -                 |
| 四、本期期末净资产                                | 6,405,093,536.47                           | -      | 253,450,922.84  | 6,658,544,459.31  |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |        |                 |                   |
|                                          | 实收基金                                       | 其他综合收益 | 未分配利润           | 净资产合计             |
| 一、上期期末净资产                                | 272,456,804.64                             | -      | 1,444,652.16    | 273,901,456.80    |
| 加：会计政策变更                                 | -                                          | -      | -               | -                 |
| 前期差错更正                                   | -                                          | -      | -               | -                 |
| 其他                                       | -                                          | -      | -               | -                 |

|                                          |                     |   |               |                 |
|------------------------------------------|---------------------|---|---------------|-----------------|
| 二、本期期初净资产                                | 272,456,804.64      | - | 1,444,652.16  | 273,901,456.80  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | 5,501,442.80        | - | 3,916,684.93  | 9,418,127.73    |
| (一)、综合收益总额                               | -                   | - | 3,841,203.19  | 3,841,203.19    |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)      | 5,501,442.80        | - | 75,481.74     | 5,576,924.54    |
| 其中：1. 基金申购款                              | 555,521,559.35      | - | 6,394,556.47  | 561,916,115.82  |
| 2. 基金赎回款                                 | -<br>550,020,116.55 | - | -6,319,074.73 | -556,339,191.28 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | -                   | - | -             | -               |
| (四)、其他综合收益结转留存收益                         | -                   | - | -             | -               |
| 四、本期期末净资产                                | 277,958,247.44      | - | 5,361,337.09  | 283,319,584.53  |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

兴全恒嘉 30 天持有期债券型证券投资基金（原名“兴证全球恒嘉 30 天持有期债券型证券投资基金”）（以下简称“本基金”），经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）于 2024 年 9 月 19 日印发的证监许可[2024]1317 号文的核准公开募集，由兴证全球基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法规和《兴证全球恒嘉 30 天持有期债券型证券投资

基金基金合同》发售，基金合同于 2024 年 12 月 2 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 272,456,804.64 份基金份额。本基金的基金管理人为兴证全球基金管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。本基金于 2025 年 12 月 1 日起更名为兴全恒嘉 30 天持有期债券型证券投资基金。

根据基金管理人兴证全球基金管理有限公司 2025 年 1 月 3 日《关于兴证全球恒嘉 30 天持有期债券型证券投资基金增设 E 类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告》的规定，经与基金托管人协商一致，自 2025 年 1 月 3 日起本基金增加 E 类份额并相应修改基金合同。本基金根据申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。其中，在投资者申购基金份额时收取申购费用，而不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；在投资者申购基金份额时不收取申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额、E 类基金份额。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，主要投资于债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债、证券公司短期公司债、可分离交易可转债的纯债部分）、资产支持证券、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、信用衍生品、国债期货、现金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）。本基金不投资于股票，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。

基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，本基金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持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计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。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，其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，本基金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持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计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：中债综合全价（总值）指数收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则

和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《公开募集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》、《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 30 日的财务状况、自 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

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 [2008] 1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2025] 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

- a) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，

按照 3%的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖债券取得的收入，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，免征增值税；对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。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对本基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

d) 对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 558,120.79             |
| 等于：本金          | 554,937.74             |
| 加：应计利息         | 3,183.05               |
| 减：坏账准备         | -                      |
| 定期存款           | -                      |
| 等于：本金          | -                      |
| 加：应计利息         | -                      |
| 减：坏账准备         | -                      |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -                      |
| 存款期限 1-3 个月    | -                      |
| 存款期限 3 个月以上    | -                      |
| 其他存款           | -                      |
| 等于：本金          | -                      |
| 加：应计利息         | -                      |
| 减：坏账准备         | -                      |
| 合计             | 558,120.79             |

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |               |                  |               |
|---------------|-------|------------------------|---------------|------------------|---------------|
|               |       | 成本                     | 应计利息          | 公允价值             | 公允价值变动        |
| 股票            |       | -                      | -             | -                | -             |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                      | -             | -                | -             |
| 债券            | 交易所市场 | 70,763,027.12          | 1,218,191.78  | 71,682,191.78    | -299,027.12   |
|               | 银行间市场 | 7,854,063,528.44       | 92,415,538.57 | 7,942,411,438.57 | -4,067,628.44 |
|               | 合计    | 7,924,826,555.56       | 93,633,730.35 | 8,014,093,630.35 | -4,366,655.56 |
| 资产支持证券        |       | -                      | -             | -                | -             |
| 基金            |       | -                      | -             | -                | -             |
| 其他            |       | -                      | -             | -                | -             |
| 合计            |       | 7,924,826,555.56       | 93,633,730.35 | 8,014,093,630.35 | -4,366,655.56 |

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

## 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

## 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

## 6.4.7.4 买入返售金融资产

## 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末无买入返售金融资产。

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未通过买断式逆回购交易取得债券。

## 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

## 6.4.7.5 债权投资

## 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

**6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况**

注：本基金本报告期内未发生债权投资减值准备。

**6.4.7.6 其他债权投资****6.4.7.6.1 其他债权投资情况**

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

**6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况**

注：本基金本报告期内未发生其他债权投资减值准备。

**6.4.7.7 其他权益工具投资****6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

注：本基金本报告期末无其他权益工具。

**6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况**

注：本基金本报告期末无其他权益工具。

**6.4.7.8 其他资产**

注：本基金本报告期末无其他资产。

**6.4.7.9 其他负债**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | 4.84                   |
| 应付证券出借违约金   | -                      |
| 应付交易费用      | 166,978.29             |
| 其中：交易所市场    | -                      |
| 银行间市场       | 166,978.29             |
| 应付利息        | -                      |
| 预提费用        | 92,310.68              |
| 合计          | 259,293.81             |

**6.4.7.10 实收基金**

金额单位：人民币元

兴全恒嘉 30 天持有债券 A

| 项目            | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |                   |
|---------------|---------------------------------------|-------------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额              |
| 上年度末          | 1,223,689,274.53                      | 1,223,689,274.53  |
| 本期申购          | 1,932,870,958.78                      | 1,932,870,958.78  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,132,666,145.06                     | -1,132,666,145.06 |
| 基金拆分/份额折算前    | -                                     | -                 |

|               |                  |                  |
|---------------|------------------|------------------|
| 基金拆分/份额折算调整   | -                | -                |
| 本期申购          | -                | -                |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -                | -                |
| 本期末           | 2,023,894,088.25 | 2,023,894,088.25 |

兴全恒嘉 30 天持有债券 C

| 项目            | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |                   |
|---------------|---------------------------------------|-------------------|
|               | 基金份额(份)                               | 账面金额              |
| 上年度末          | 3,781,986,921.91                      | 3,781,986,921.91  |
| 本期申购          | 6,275,718,185.20                      | 6,275,718,185.20  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -5,677,527,967.44                     | -5,677,527,967.44 |
| 基金拆分/份额折算前    | -                                     | -                 |
| 基金拆分/份额折算调整   | -                                     | -                 |
| 本期申购          | -                                     | -                 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -                                     | -                 |
| 本期末           | 4,380,177,139.67                      | 4,380,177,139.67  |

兴全恒嘉 30 天持有债券 E

| 项目            | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |              |
|---------------|---------------------------------------|--------------|
|               | 基金份额(份)                               | 账面金额         |
| 上年度末          | 993,462.89                            | 993,462.89   |
| 本期申购          | 28,845.66                             | 28,845.66    |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -                                     | -            |
| 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           | 1,022,308.55                          | 1,022,308.55 |

注：申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末无其他综合收益。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

兴全恒嘉 30 天持有债券 A

| 项目       | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
|----------|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末     | 40,488,122.93 | -2,755,962.87 | 37,732,160.06 |
| 加：会计政策变更 | -             | -             | -             |
| 前期差错更正   | -             | -             | -             |
| 其他       | -             | -             | -             |
| 本期期初     | 40,488,122.93 | -2,755,962.87 | 37,732,160.06 |
| 本期利润     | 16,129,228.89 | -301,986.62   | 15,827,242.27 |

|                |                |               |                |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 32,612,262.55  | -1,663,205.78 | 30,949,056.77  |
| 其中：基金申购款       | 75,788,168.03  | -4,344,495.29 | 71,443,672.74  |
| 基金赎回款          | -43,175,905.48 | 2,681,289.51  | -40,494,615.97 |
| 本期已分配利润        | -              | -             | -              |
| 本期末            | 89,229,614.37  | -4,721,155.27 | 84,508,459.10  |

## 兴全恒嘉 30 天持有债券 C

| 项目             | 已实现部分           | 未实现部分          | 未分配利润合计         |
|----------------|-----------------|----------------|-----------------|
| 上年度末           | 116,967,731.40  | -8,514,551.88  | 108,453,179.52  |
| 加：会计政策变更       | -               | -              | -               |
| 前期差错更正         | -               | -              | -               |
| 其他             | -               | -              | -               |
| 本期期初           | 116,967,731.40  | -8,514,551.88  | 108,453,179.52  |
| 本期利润           | 46,630,873.52   | -342,624.18    | 46,288,249.34   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 15,510,670.24   | -1,352,157.70  | 14,158,512.54   |
| 其中：基金申购款       | 221,389,078.46  | -14,286,799.06 | 207,102,279.40  |
| 基金赎回款          | -205,878,408.22 | 12,934,641.36  | -192,943,766.86 |
| 本期已分配利润        | -               | -              | -               |
| 本期末            | 179,109,275.16  | -10,209,333.76 | 168,899,941.40  |

## 兴全恒嘉 30 天持有债券 E

| 项目             | 已实现部分     | 未实现部分     | 未分配利润合计   |
|----------------|-----------|-----------|-----------|
| 上年度末           | 32,746.64 | -2,238.10 | 30,508.54 |
| 加：会计政策变更       | -         | -         | -         |
| 前期差错更正         | -         | -         | -         |
| 其他             | -         | -         | -         |
| 本期期初           | 32,746.64 | -2,238.10 | 30,508.54 |
| 本期利润           | 10,948.87 | -99.41    | 10,849.46 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 1,212.14  | -47.80    | 1,164.34  |
| 其中：基金申购款       | 1,212.14  | -47.80    | 1,164.34  |
| 基金赎回款          | -         | -         | -         |
| 本期已分配利润        | -         | -         | -         |
| 本期末            | 44,907.65 | -2,385.31 | 42,522.34 |

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 1,229,783.87                          |
| 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 | -                                     |
| 其他        | 13,108.73                             |

|    |              |
|----|--------------|
| 合计 | 1,242,892.60 |
|----|--------------|

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无股票投资收益。

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益买卖股票差价收入。

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益证券出借差价收入。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 91,795,956.53              |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -9,062,010.96              |
| 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                           | 82,733,945.57              |

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 17,240,303,469.57          |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 17,105,699,744.68          |
| 减：应计利息总额               | 143,474,147.35             |
| 减：交易费用                 | 191,588.50                 |
| 买卖债券差价收入               | -9,062,010.96              |

##### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益赎回差价收入。

##### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益申购差价收入。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

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

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益买卖资产支持证券差价收入。

##### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益赎回差价收入。

##### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益申购差价收入。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

##### 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益买卖贵金属差价收入。

##### 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益赎回差价收入。

##### 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益申购差价收入。

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

##### 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

#### 6.4.7.19 股利收益

注：本基金本报告期内无股利收益。

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期                              |
|------------|---------------------------------|
|            | 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
| 1. 交易性金融资产 | -644,710.21                     |
| 股票投资       | -                               |
| 债券投资       | -644,710.21                     |

|                        |             |
|------------------------|-------------|
| 资产支持证券投资               | -           |
| 基金投资                   | -           |
| 贵金属投资                  | -           |
| 其他                     | -           |
| 2. 衍生工具                | -           |
| 权证投资                   | -           |
| 3. 其他                  | -           |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -           |
| 合计                     | -644,710.21 |

#### 6.4.7.21 其他收入

注：本基金本报告期内无其他收入。

#### 6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用    | 23,803.31                             |
| 信息披露费   | 59,507.37                             |
| 证券出借违约金 | -                                     |
| 银行费用    | 30,635.40                             |
| 账户维护费用  | 18,000.00                             |
| 其他      | 600.00                                |
| 合计      | 132,546.08                            |

#### 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，本基金无需要在财务报表附注中说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

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

#### 6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期内与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                  | 与本基金的关系             |
|------------------------|---------------------|
| 兴证全球基金管理有限公司（“兴证全球基金”） | 基金管理人、基金销售机构、注册登记机构 |

|                        |                 |
|------------------------|-----------------|
| 上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”） | 基金托管人、基金销售机构    |
| 兴业证券股份有限公司（“兴业证券”）     | 基金管理人的股东、基金销售机构 |

注：下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

##### 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>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|------------------|---------------------------------------|--------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 6,345,369.75                          | 262,845.41                                 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 2,734,418.13                          | 72,493.52                                  |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 3,610,951.62                          | 190,351.89                                 |

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

计算方法如下：每日应支付的基金管理费=前一日基金资产净值×0.20%/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>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------|--------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,586,342.44                          | 65,711.39                                  |

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

计算方法如下：每日应支付的基金托管费=前一日基金资产净值×0.05%/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<br>各关联方名称 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日      |                     |                     |           |
|--------------------|--------------------------------------------|---------------------|---------------------|-----------|
|                    | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |                     |                     |           |
|                    | 兴全恒嘉 30 天<br>持有债券 A                        | 兴全恒嘉 30 天<br>持有债券 C | 兴全恒嘉 30 天<br>持有债券 E | 合计        |
| 浦发银行               | -                                          | 22,478.22           | -                   | 22,478.22 |
| 兴业证券               | -                                          | 1,162.71            | -                   | 1,162.71  |
| 兴证全球基金             | -                                          | 452.35              | 50.88               | 503.23    |
| 合计                 | -                                          | 24,093.28           | 50.88               | 24,144.16 |
| 获得销售服务费的<br>各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |                     |                     |           |
|                    | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |                     |                     |           |
|                    | 兴全恒嘉 30 天<br>持有债券 A                        | 兴全恒嘉 30 天<br>持有债券 C | 兴全恒嘉 30 天<br>持有债券 E | 合计        |
| 浦发银行               | -                                          | 72,655.37           | -                   | 72,655.37 |
| 兴证全球基金             | -                                          | 152.39              | 54.09               | 206.48    |
| 合计                 | -                                          | 72,807.76           | 54.09               | 72,861.85 |

注：A 类份额不收取销售服务费，C、E 类份额的基金销售服务费按前一日 C、E 类基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算方法如下：每日应支付的 C、E 类基金份额销售服务费=C 类/E 类基金份额前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。2025 年 1 月 3 日至 2025 年 5 月 6 日期间，及 2025 年 5 月 8 日起至 2026 年 6 月 30 日期间基金管理人对 E 类基金份额开展销售服务费优惠活动，优惠期间 E 类基金份额年销售服务费率为 0.01%。

#### 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

单位：人民币元

| 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日      |               |                |       |      |                  |            |
|--------------------------------------------|---------------|----------------|-------|------|------------------|------------|
| 银行间市场交易的<br>各关联方名称                         | 债券交易金额        |                | 基金逆回购 |      | 基金正回购            |            |
|                                            | 基金买入          | 基金卖出           | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额             | 利息支出       |
| 浦发银行                                       | 70,246,248.50 | 192,546,189.45 | -     | -    | 7,473,370,000.00 | 570,692.80 |
| 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |               |                |       |      |                  |            |
| 银行间市场交易的                                   | 债券交易金额        |                | 基金逆回购 |      | 基金正回购            |            |

| 各关联方名称 | 基金买入          | 基金卖出          | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
|--------|---------------|---------------|------|------|------|------|
| 浦发银行   | 20,851,856.68 | 19,984,009.57 | -    | -    | -    | -    |

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

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

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

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

份额单位：份

| 项目                                  | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日      |                 |                                     |
|-------------------------------------|--------------------------------------------|-----------------|-------------------------------------|
|                                     | 兴全恒嘉 30 天持有债券 A                            | 兴全恒嘉 30 天持有债券 C | 兴全恒嘉 30 天持有债券 E                     |
| 基金合同生效日<br>(2024 年 12 月 2 日)持有的基金份额 | -                                          | -               | -                                   |
| 报告期初持有的基金份额                         | 77,927,233.03                              | -               | 993,344.59                          |
| 报告期间申购/买入总份额                        | 28,804,609.45                              | -               | -                                   |
| 报告期间因拆分变动份额                         | -                                          | -               | -                                   |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额                      | -                                          | -               | -                                   |
| 报告期末持有的基金份额                         | 106,731,842.48                             | -               | 993,344.59                          |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例                 | 1.6664%                                    | -%              | 0.0155%                             |
| 项目                                  | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |                 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 6 日(基金合同生效日)至 |

|                                        |                 |                 | 2025 年 6 月 30 日 |
|----------------------------------------|-----------------|-----------------|-----------------|
|                                        | 兴全恒嘉 30 天持有债券 A | 兴全恒嘉 30 天持有债券 C | 兴全恒嘉 30 天持有债券 E |
| 基金合同生效日<br>( 2024 年 12 月 2 日 ) 持有的基金份额 | -               | -               | -               |
| 报告期初持有的基金份额                            | -               | -               | -               |
| 报告期间申购/买入总份额                           | 48,545,279.65   | -               | 993,344.59      |
| 报告期间因拆分变动份额                            | -               | -               | -               |
| 减: 报告期间赎回/卖出总份额                        | -               | -               | -               |
| 报告期末持有的基金份额                            | 48,545,279.65   | -               | 993,344.59      |
| 报告期末持有的基金份额<br>占基金总份额比例                | 17.4650%        | -%              | 0.3574%         |

注: 1. 期间申购/买入总份额含红利再投资、转换入份额, 期间赎回/卖出总份额含转换出份额。  
2. 关联方投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定, 符合公允性要求。

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本报告期末及上年度末均未投资本基金。

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>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月<br>30 日 |              | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 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 |
| 浦发银行  | 558,120.79                               | 1,229,783.87 | 171,511.64                                 | 614.56 |

注: 本基金的银行存款由基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司保管, 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: 本基金本报告期内及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注: 本基金本报告期内未进行过利润分配。

#### 6.4.12 期末（2026 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

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 1,279,004,177.53 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<br>单价 | 数量（张）      | 期末估值总额           |
|---------|---------------|----------------|------------|------------|------------------|
| 2120110 | 21 北京银行永续债 02 | 2026 年 7 月 1 日 | 103.13     | 3,416,000  | 352,303,310.69   |
| 220208  | 22 国开 08      | 2026 年 7 月 1 日 | 101.42     | 600,000    | 60,852,328.77    |
| 240202  | 24 国开 02      | 2026 年 7 月 1 日 | 101.66     | 322,000    | 32,736,046.19    |
| 240303  | 24 进出 03      | 2026 年 7 月 1 日 | 100.98     | 800,000    | 80,784,438.36    |
| 267709  | 26 贴现国开 09    | 2026 年 7 月 1 日 | 99.73      | 890,000    | 88,757,620.11    |
| 2120110 | 21 北京银行永续债 02 | 2026 年 7 月 6 日 | 103.13     | 1,788,000  | 184,402,318.36   |
| 2128036 | 21 平安银行二级     | 2026 年 7 月 6 日 | 103.14     | 1,404,000  | 144,803,420.98   |
| 2120107 | 21 浙商银行永续债    | 2026 年 7 月 7 日 | 103.22     | 2,148,000  | 221,718,972.82   |
| 2128047 | 21 招商银行永续债    | 2026 年 7 月 7 日 | 103.02     | 2,106,000  | 216,951,822.94   |
| 合计      |               |                |            | 13,474,000 | 1,383,310,279.22 |

###### 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因债券正回购交易而作为抵押的交易所市场债券。

##### 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

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

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

### 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同责任，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>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | -                      | -                        |
| A-1 以下 | -                      | -                        |
| 未评级    | 1,845,919,768.63       | 1,285,567,360.41         |
| 合计     | 1,845,919,768.63       | 1,285,567,360.41         |

#### 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>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA    | 3,478,809,553.99       | 2,037,897,585.77         |
| AAA 以下 | 427,958,669.04         | 362,443,637.25           |

|     |                  |                  |
|-----|------------------|------------------|
| 未评级 | 1,401,710,315.46 | 317,019,715.90   |
| 合计  | 5,308,478,538.49 | 2,717,360,938.92 |

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA    | -                      | -                        |
| AAA 以下 | -                      | -                        |
| 未评级    | 516,574,345.12         | 841,884,690.98           |
| 合计     | 516,574,345.12         | 841,884,690.98           |

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。

本基金所持证券均在证券交易所或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

本基金每份基金份额设有最短持有期。对于基金份额持有人而言，存在投资本基金后，在最短持有期内无法赎回的风险。本基金管理人针对基金特定的运作方式，建立了相应的流动性风险监控与预警机制。本基金管理人每日预测基金的流动性需求，通过独立的风险管理部门设置流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，并按照基金类型建立并定期开展专项的流动性压力测试工作，对流动性风险进行预警。本基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款及强制赎回费条款，同时控制每日确认的净赎回申请不超过本基金投资组合 7 个工作日可变现资产的可变现价值，减少赎回业务对本基金的流动性冲击，从而控制流动性风险。此外，本基金通过预留一定的现金头寸，并且可在需要时通过卖出回购金融资产方式借入短期资金，以缓解流动性风险。

本基金所持的证券在证券交易所上市或可于银行间同业市场交易。截止本报告期末，单一投资者持有基金份额比例未超过基金总份额 50%。本报告期末，除完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合以外，本基金管理人管理的全部开

放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的 30%，本基金投资未违背法律法规对流通受限资产的相关比例要求。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2026 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                        |                  |                  |                  |                  |       |                |                  |
| 货币资金                      | 558,120.79       | -                | -                | -                | -     | -              | 558,120.79       |
| 交易性金融资产                   | 266,791,402.20   | 1,315,239,685.82 | 4,505,664,515.65 | 1,926,398,026.68 | -     | -              | 8,014,093,630.35 |
| 应收申购款                     | -                | -                | -                | -                | -     | 14,752,089.35  | 14,752,089.35    |
| 资产总计                      | 267,349,522.99   | 1,315,239,685.82 | 4,505,664,515.65 | 1,926,398,026.68 | -     | 14,752,089.35  | 8,029,403,840.49 |
| 负债                        |                  |                  |                  |                  |       |                |                  |
| 应付赎回款                     | -                | -                | -                | -                | -     | 89,128,409.78  | 89,128,409.78    |
| 应付管理人报酬                   | -                | -                | -                | -                | -     | 1,145,631.94   | 1,145,631.94     |
| 应付托管费                     | -                | -                | -                | -                | -     | 286,407.97     | 286,407.97       |
| 卖出回购金融资产款                 | 1,279,004,177.53 | -                | -                | -                | -     | -              | 1,279,004,177.53 |
| 应付销售服务费                   | -                | -                | -                | -                | -     | 835,076.49     | 835,076.49       |
| 应交税费                      | -                | -                | -                | -                | -     | 200,383.66     | 200,383.66       |
| 其他负债                      | -                | -                | -                | -                | -     | 259,293.81     | 259,293.81       |
| 负债总计                      | 1,279,004,177.53 | -                | -                | -                | -     | 91,855,203.65  | 1,370,859,381.18 |
| 利率敏感度缺口                   | 1,011,654,654.54 | 1,315,239,685.82 | 4,505,664,515.65 | 1,926,398,026.68 | -     | -77,103,114.30 | 6,658,544,459.31 |

| 上年度末<br>2025 年 12 月<br>31 日 | 1 个月以内         | 1-3 个月         | 3 个月-1 年         | 1-5 年          | 5 年以上 | 不计息           | 合计               |
|-----------------------------|----------------|----------------|------------------|----------------|-------|---------------|------------------|
| 资产                          |                |                |                  |                |       |               |                  |
| 货币资金                        | 465,646.57     | -              | -                | -              | -     | -             | 465,646.57       |
| 存出保证金                       | 2,184.33       | -              | -                | -              | -     | -             | 2,184.33         |
| 交易性金融资产                     | 133,523,193.44 | 445,429,036.43 | 4,224,780,897.70 | 890,004,103.83 | -     | -             | 5,693,737,231.40 |
| 应收申购款                       | -              | -              | -                | -              | -     | 88,390,904.47 | 88,390,904.47    |
| 资产总计                        | 133,991,024.34 | 445,429,036.43 | 4,224,780,897.70 | 890,004,103.83 | -     | 88,390,904.47 | 5,782,595,966.77 |
| 负债                          |                |                |                  |                |       |               |                  |
| 应付赎回款                       | -              | -              | -                | -              | -     | 16,363,536.82 | 16,363,536.82    |
| 应付管理人报酬                     | -              | -              | -                | -              | -     | 631,041.09    | 631,041.09       |
| 应付托管费                       | -              | -              | -                | -              | -     | 157,760.29    | 157,760.29       |
| 卖出回购金融资产款                   | 611,672,624.23 | -              | -                | -              | -     | -             | 611,672,624.23   |
| 应付销售服务费                     | -              | -              | -                | -              | -     | 533,275.49    | 533,275.49       |
| 应交税费                        | -              | -              | -                | -              | -     | 73,639.94     | 73,639.94        |
| 其他负债                        | -              | -              | -                | -              | -     | 278,581.46    | 278,581.46       |
| 负债总计                        | 611,672,624.23 | -              | -                | -              | -     | 18,037,835.09 | 629,710,459.32   |
| 利率敏感度缺口                     | 477,681,599.89 | 445,429,036.43 | 4,224,780,897.70 | 890,004,103.83 | -     | 70,353,069.38 | 5,152,885,507.45 |

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 其他影响债券公允价值的变量保持不变，仅利率发生变动；     |                             |                        |
|----|--------------------------------|-----------------------------|------------------------|
|    | 假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化（即平移收益率曲线） |                             |                        |
| 分析 | 相关风险变量的变动                      | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                        |
|    |                                | 本期末（2026 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2025 年 12 月 31 日） |
|    | 市场利率下降 1%                      | 58,953,274.08               | 39,409,870.65          |
|    | 市场利率上升 1%                      | -57,673,877.39              | -38,760,440.94         |

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

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，且本期期末未持有股票和在交易所交易的可转换债券，因此无重大市场价格风险。

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>2026 年 6 月 30 日 |                  | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |                  |
|---------------|------------------------|------------------|--------------------------|------------------|
|               | 公允价值                   | 占基金资产净值<br>比例（%） | 公允价值                     | 占基金资产净值<br>比例（%） |
| 交易性金融资产—股票投资  | —                      | —                | —                        | —                |
| 交易性金融资产—基金投资  | —                      | —                | —                        | —                |
| 交易性金融资产—债券投资  | 8,014,093,630.35       | 120.36           | 5,693,737,231.40         | 110.50           |
| 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            | 8,014,093,630.35       | 120.36           | 5,693,737,231.40         | 110.50           |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有交易性权益类投资，因此除市场利率以外的市场价格因素的变动对于本基金净资产无重大影响，所以未进行市场价格风险的敏感性分析。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次

的输入值。三个层次输入值的定义如下：

- 第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；
- 第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；
- 第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | -                      | -                        |
| 第二层次          | 8,014,093,630.35       | 5,693,737,231.40         |
| 第三层次          | -                      | -                        |
| 合计            | 8,014,093,630.35       | 5,693,737,231.40         |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具 (2025 年 12 月 31 日：无)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目    | 金额 | 占基金总资产的比例<br>(%) |
|----|-------|----|------------------|
| 1  | 权益投资  | -  | -                |
|    | 其中：股票 | -  | -                |

|   |                   |                  |        |
|---|-------------------|------------------|--------|
| 2 | 基金投资              | -                | -      |
| 3 | 固定收益投资            | 8,014,093,630.35 | 99.81  |
|   | 其中：债券             | 8,014,093,630.35 | 99.81  |
|   | 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      | 558,120.79       | 0.01   |
| 8 | 其他各项资产            | 14,752,089.35    | 0.18   |
| 9 | 合计                | 8,029,403,840.49 | 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

无。

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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

注：本基金本报告期末未持有股票。

## 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

注：无。

### 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

注：无。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：无。

## 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      | -                | -            |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 3,994,838,230.74 | 60.00        |
|    | 其中：政策性金融债 | 343,120,978.11   | 5.15         |
| 4  | 企业债券      | 71,682,191.78    | 1.08         |
| 5  | 企业短期融资券   | 1,845,919,768.63 | 27.72        |
| 6  | 中期票据      | 1,585,079,094.08 | 23.81        |

|    |           |                  |        |
|----|-----------|------------------|--------|
| 7  | 可转债（可交换债） | -                | -      |
| 8  | 同业存单      | 516,574,345.12   | 7.76   |
| 9  | 其他        | -                | -      |
| 10 | 合计        | 8,014,093,630.35 | 120.36 |

## 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<br>(张) | 公允价值           | 占基金资产净值比例<br>(%) |
|----|---------|-------------------|-----------|----------------|------------------|
| 1  | 2120110 | 21 北京银行<br>永续债 02 | 5,600,000 | 577,546,410.96 | 8.67             |
| 2  | 2128047 | 21 招商银行<br>永续债    | 5,000,000 | 515,080,301.37 | 7.74             |
| 3  | 2120092 | 21 徽商银行<br>二级 01  | 3,500,000 | 362,576,084.93 | 5.45             |
| 4  | 2120107 | 21 浙商银行<br>永续债    | 2,600,000 | 268,374,920.55 | 4.03             |
| 5  | 2121062 | 21 北京农商<br>二级     | 2,400,000 | 246,873,415.89 | 3.71             |

## 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：本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.10.1 本期国债期货投资政策

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

### 7.10.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货，故此项不适用。

### 7.10.3 报告期末基金持有的全部公开募集不动产投资信托基金情况

注：本基金本报告期末未持有公开募集不动产投资信托基金。

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

前十名证券的发行主体中，未见其他发行主体有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

按照基金合同的约定，本基金不投资股票。

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 | -             |
| 2  | 应收清算款 | -             |
| 3  | 应收股利  | -             |
| 4  | 应收利息  | -             |
| 5  | 应收申购款 | 14,752,089.35 |
| 6  | 其他应收款 | -             |
| 7  | 待摊费用  | -             |
| 8  | 其他    | -             |
| 9  | 合计    | 14,752,089.35 |

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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(%) |
| 兴全恒嘉 30 天持有债券 A | 13,447   | 150,508.97 | 1,181,322,816.57 | 58.37     | 842,571,271.68   | 41.63     |
| 兴全恒嘉 30 天持有债券 C | 105,907  | 41,358.71  | 86,998.55        | 0.00      | 4,380,090,141.12 | 100.00    |
| 兴全恒嘉 30 天持有债券 E | 6        | 170,384.76 | 993,344.59       | 97.17     | 28,963.96        | 2.83      |
| 合计              | 119,360  | 53,661.98  | 1,182,403,159.71 | 18.46     | 5,222,690,376.76 | 81.54     |

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）。

8.2 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 | 兴全恒嘉 30 天持有债券 A | 1,233,019.00 | 0.0609      |
|                  | 兴全恒嘉 30 天持有债券 C | 211,979.12   | 0.0048      |
|                  | 兴全恒嘉 30 天持有债券 E | 9.93         | 0.0010      |
|                  | 合计              | 1,445,008.05 | 0.0226      |

注：“占基金总份额比例”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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金 | 兴全恒嘉 30 天持有债券 A | 0                 |
|                                | 兴全恒嘉 30 天持有债券 C | 0                 |
|                                | 兴全恒嘉 30 天持有债券 E | 0                 |
|                                | 合计              | 0                 |

|                     |                 |      |
|---------------------|-----------------|------|
| 本基金基金经理持有<br>本开放式基金 | 兴全恒嘉 30 天持有债券 A | >100 |
|                     | 兴全恒嘉 30 天持有债券 C | 0    |
|                     | 兴全恒嘉 30 天持有债券 E | 0    |
|                     | 合计              | >100 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                                        | 兴全恒嘉 30 天持有债券<br>A | 兴全恒嘉 30 天持有债券<br>C | 兴全恒嘉 30 天持有债券<br>E |
|-------------------------------------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| 基金合同生效<br>日（2024 年<br>12 月 2 日）<br>基金份额总额 | 69,559,319.49      | 202,897,485.15     | —                  |
| 本报告期期初<br>基金份额总额                          | 1,223,689,274.53   | 3,781,986,921.91   | 993,462.89         |
| 本报告期基金<br>总申购份额                           | 1,932,870,958.78   | 6,275,718,185.20   | 28,845.66          |
| 减：本报告期<br>基金总赎回份<br>额                     | 1,132,666,145.06   | 5,677,527,967.44   | —                  |
| 本报告期基金<br>拆分变动份额                          | —                  | —                  | —                  |
| 本报告期末<br>基金份额总额                           | 2,023,894,088.25   | 4,380,177,139.67   | 1,022,308.55       |

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

|                                                                                                                       |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>（1）本报告期内，基金管理人重大人事变动：</p> <p>2026 年 3 月 19 日，基金管理人的财务负责人由陈锦泉先生变更为马亚静女士。</p> <p>（2）本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。</p> |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

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

报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金管理人的相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：报告期内，托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：报告期内，托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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 (%) |    |
| 华泰证券 | 2      | -    | -                | -         | -              | -  |

- 注：1. 报告期内无租用证券公司交易单元变更；
2. 上表列示交易单元数量为截至本报告期末本基金租用数量，成交金额及佣金为本报告期间数；
3. 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 基金租用或者通过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 (%) |
|      |      |                  |        |                    |      |                  |

|      |               |        |   |   |   | 例(%) |
|------|---------------|--------|---|---|---|------|
| 华泰证券 | 70,763,027.12 | 100.00 | - | - | - | -    |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                       | 法定披露方式        | 法定披露日期          |
|----|--------------------------------------------|---------------|-----------------|
| 1  | 关于旗下公募基金产品直销渠道认（申）购费优惠活动的公告                | 上海证券报、指定互联网网站 | 2026 年 1 月 26 日 |
| 2  | 兴证全球基金管理有限公司高级管理人员变更公告                     | 上海证券报、指定互联网网站 | 2026 年 3 月 20 日 |
| 3  | 兴证全球基金管理公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度） | 上海证券报、指定互联网网站 | 2026 年 3 月 30 日 |
| 4  | 关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告       | 上海证券报、指定互联网网站 | 2026 年 6 月 5 日  |

§ 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

|                                                                                                                                                                                                                         |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>本基金每份基金份额的最短持有期为 30 天。对于每份基金份额，最短持有期指自基金合同生效日（对认购份额而言，下同）或基金份额申购确认日（对申购份额而言，下同）起，至基金合同生效日或基金份额申购申请日起满 30 天（自然天数，下同）后的下一工作日。本基金每份基金份额自其最短持有期到期日（含该日）起，基金份额持有人方可就该基金份额提出赎回申请。因此，对于基金份额持有人而言，存在投资本基金后 30 天内无法赎回的风险。</p> |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金募集注册的文件；
- 2、《兴全恒嘉 30 天持有期债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《兴全恒嘉 30 天持有期债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、关于申请募集基金之法律意见；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

### 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、基金托管人住所免费查阅。

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

2026 年 8 月 31 日