

# 东兴兴利债券型证券投资基金

## 2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:东兴基金管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

送出日期:2023 年 08 月 31 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年8月18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2023年1月1日起至2023年6月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	49
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	49
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	49
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12 投资组合报告附注	49
§8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50

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 .....	51
§9 开放式基金份额变动 .....	51
§10 重大事件揭示 .....	51
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	51
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 .....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	52
10.4 基金投资策略的改变 .....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	52
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	52
10.8 其他重大事件 .....	53
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	54
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 .....	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	54
§12 备查文件目录 .....	54
12.1 备查文件目录 .....	54
12.2 存放地点 .....	54
12.3 查阅方式 .....	54

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	东兴兴利债券型证券投资基金		
基金简称	东兴兴利债券		
基金主代码	003545		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2017年04月14日		
基金管理人	东兴基金管理有限公司		
基金托管人	中国农业银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	9,147,080,580.17份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	东兴兴利债券A	东兴兴利债券C	东兴兴利债券D
下属分级基金的交易代码	003545	009617	011024
报告期末下属分级基金的份额总额	1,611,909,127.91份	6,864,288,586.37份	670,882,865.89份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在积极投资、严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期、稳定增值，力争获得超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金通过对我国宏观经济指标、国家产业政策、货币政策和财政政策及我国资本市场的运行状况等深入研究,判断我国宏观经济发展趋势、中短期利率走势、债券市场预期风险水平和相对收益率。在严格控制风险的基础上，通过对宏观经济形势、国家货币和财政政策、利率变化趋势、市场流动性和估值水平等因素的综合分析，据此评价未来一段时间债券市场和股票市场的相对投资价值，动态调整债券、股票类资产的配置比例。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的中低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

### 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	东兴基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司	
信息披露负责人	姓名	李宛霖	秦一楠
	联系电话	400-670-1800	010-66060069
	电子邮箱	xxpl@dexamc.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话	400-670-1800	95599	
传真	010-57307388	010-68121816	
注册地址	北京市丰台区东管头1号院1号楼1-190室	北京市东城区建国门内大街69号	
办公地址	北京市西城区平安里西大街28号中海国际中心6层	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9	
邮政编码	100035	100031	
法定代表人	牛南洁	谷澍	

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.dexamc.cn">http://www.dexamc.cn</a>
基金中期报告备置地点	北京市西城区平安里西大街28号中海国际中心6层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	东兴基金管理有限公司	北京市西城区平安里西大街28号中海国际中心6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 (2023年01月01日-2023年06月30日)		
	东兴兴利债券A	东兴兴利债券C	东兴兴利债券D
本期已实现收益	30,855,914.53	116,034,534.52	10,721,338.76

本期利润	41,495,503.53	152,252,895.36	15,023,985.82
加权平均基金份额本期利润	0.0253	0.0238	0.0239
本期加权平均净值利润率	2.38%	2.23%	2.26%
本期基金份额净值增长率	2.44%	2.42%	2.28%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末 (2023年06月30日)		
期末可供分配利润	67,674,940.23	408,632,944.63	30,266,045.04
期末可供分配基金份额利润	0.0420	0.0595	0.0451
期末基金资产净值	1,733,370,254.07	7,377,989,414.74	715,696,313.21
期末基金份额净值	1.0754	1.0748	1.0668
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末 (2023年06月30日)		
基金份额累计净值增长率	23.84%	13.39%	10.46%

注：1、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。

2、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，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

东兴兴利债券A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.22%	0.01%	0.28%	0.09%	-0.06%	-0.08%
过去三个月	0.93%	0.01%	0.33%	0.08%	0.60%	-0.07%
过去六个月	2.44%	0.02%	1.06%	0.09%	1.38%	-0.07%
过去一年	3.05%	0.02%	-0.23%	0.10%	3.28%	-0.08%
过去三年	13.55%	0.03%	2.34%	0.12%	11.21%	-0.09%
自基金合同	23.84%	0.09%	9.14%	0.12%	14.70%	-0.03%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

## 东兴兴利债券C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值增长 率标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.21%	0.01%	0.28%	0.09%	-0.07%	-0.08%
过去三个月	0.92%	0.01%	0.33%	0.08%	0.59%	-0.07%
过去六个月	2.42%	0.02%	1.06%	0.09%	1.36%	-0.07%
过去一年	3.03%	0.02%	-0.23%	0.10%	3.26%	-0.08%
过去三年	13.50%	0.03%	2.34%	0.12%	11.16%	-0.09%
自基金合同 生效起至今	13.39%	0.03%	2.12%	0.12%	11.27%	-0.09%

注：本基金于2020年5月27日起增设C类基金份额。

## 东兴兴利债券D

阶段	份额净值 增长率①	份额净值增长 率标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①- ③	②-④
过去一个月	0.20%	0.01%	0.28%	0.09%	-0.08%	-0.08%
过去三个月	0.85%	0.01%	0.33%	0.08%	0.52%	-0.07%
过去六个月	2.28%	0.02%	1.06%	0.09%	1.22%	-0.07%
过去一年	2.74%	0.02%	-0.23%	0.10%	2.97%	-0.08%
自基金合同 生效起至今	10.46%	0.03%	1.50%	0.12%	8.96%	-0.09%

注：本基金于2020年12月18日起增设D类基金份额。

### 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



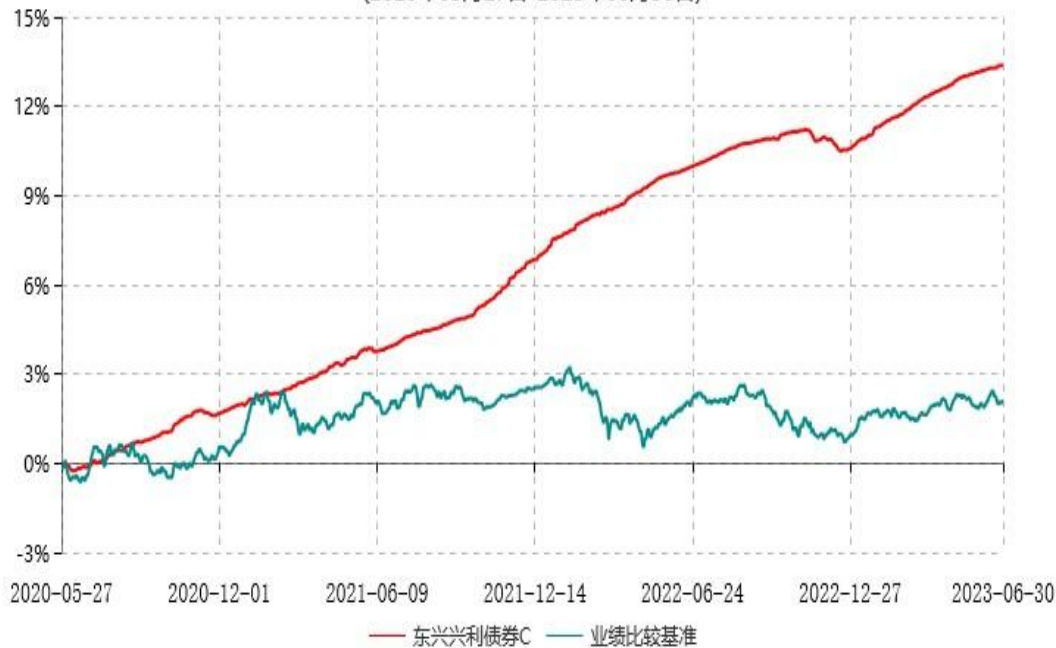
东兴兴利债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2017年04月14日-2023年06月30日)

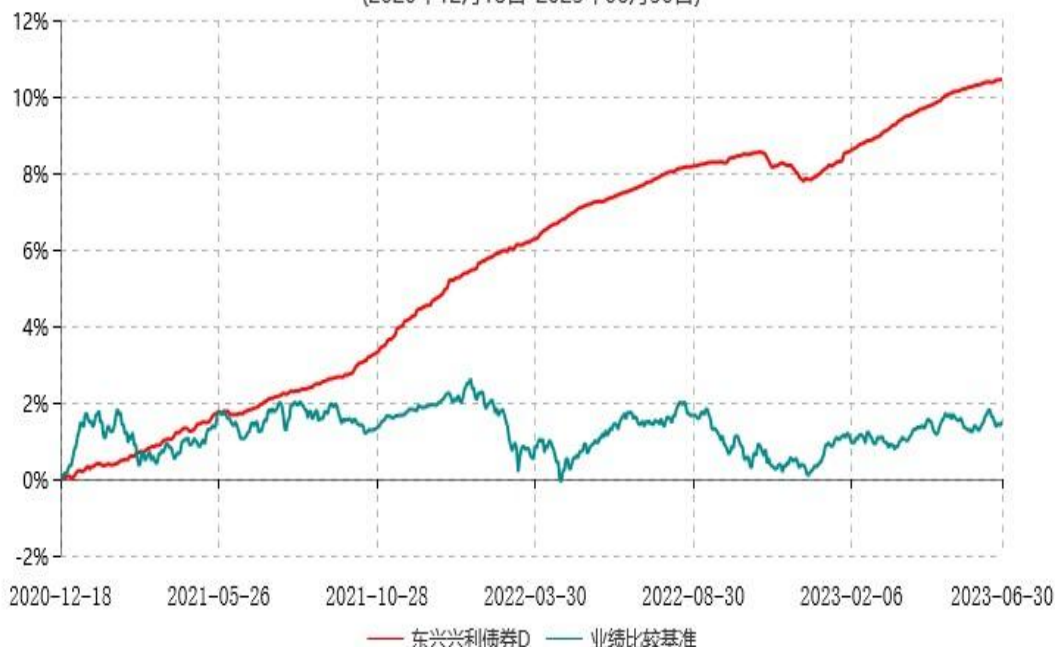


东兴兴利债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020年05月27日-2023年06月30日)



东兴兴利债券D累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2020年12月18日-2023年06月30日)



- 注：1、本基金基金合同生效日为2017年4月14日，根据相关法律法规和基金合同，本基金建仓期为基金合同生效之日起6个月内；
- 2、建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。
- 3、本基金自2020年5月27日起增设C类基金份额，自2020年12月18日起增设D类基金份额。

## §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

东兴基金管理有限公司（以下简称“东兴基金”）成立于2020年3月，注册地北京，注册资本2亿元。东兴证券股份有限公司（以下简称“东兴证券”）持有东兴基金100%股份，其控股股东为中国东方资产管理股份有限公司（以下简称“中国东方”），实际控制人为中国财政部。东兴基金系中国东方下属唯一公募基金业务经营主体，是中国东方金融服务平台的重要组成部分。

东兴基金前身为东兴证券基金业务部，先后在主动权益、固定收益、现金管理和指数类产品方面进行了大量布局，积累了丰富的投资运作经验：

特色指数类产品--在行业指数、量化增强方面进行深入研究设计，致力于打造特色精品指数类基金阵列；

主动管理类产品--以追求绝对收益为目标，贯彻自上而下和自下而上相结合的投研思路，坚持价值投资；

固定收益类产品--坚持守住价值、发现价值的原则，在严格把控信用风险的前提下，充分挖掘市场机会。

东兴基金拥有一支行业经验丰富、具备高度凝聚力、战斗力和专业性的优秀团队。公司大部分员工来自于基金、券商、投资、信评等各类金融机构，90%以上员工具有硕士及以上学历。公司承载中国东方的红色基因，践行诚信、创新、激情、专注、协作的企业文化，坚持以投资者利益为上的原则，致力为客户持续创造价值。

截至2023年6月30日，本公司管理东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金、东兴蓝海财富灵活配置混合型证券投资基金、东兴安盈宝货币市场基金、东兴兴利债券型证券投资基金、东兴兴福一年定期开放债券型证券投资基金、东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金、东兴兴瑞一年定期开放债券型证券投资基金、东兴兴财短债债券型证券投资基金、东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金、东兴中证消费50指数证券投资基金、东兴兴晟混合型证券投资基金、东兴宸瑞量化混合型证券投资基金、东兴鑫享6个月滚动持有债券型发起式证券投资基金、东兴兴盈三个月定期开放债券型证券投资基金、东兴兴源债券型证券投资基金、东兴宸祥量化混合型证券投资基金、东兴连裕6个月滚动持有债券型证券投资基金共17只开放式基金。

#### 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		
司马义买买提先生	本基金基金经理	2021-04-27	-	13年	毕业于上海交通大学计算数学专业，硕士研究生学历。2008年7月至2014年1月，任职中信证券股份有限公司；2015年1月至2017年2月，任职粤开证券（原联讯证券）股份有限公司固定收益业务总部下属资本市场部委员（北京业务部行政负责人）；2017年3月至2019年1月，任职九州证券股份有限公司固定收益资产管理部总经理；2019年1月至2021年2月，任职

				江信基金管理有限公司金融市场总部总经理;2021年3月至2021年5月任职东兴证券股份有限公司基金业务部基金经理;2021年5月至今,任职东兴基金管理有限公司固定收益部基金经理。现任东兴安盈宝货币市场基金基金经理、东兴兴利债券型证券投资基金基金经理、东兴兴福一年定期开放债券型证券投资基金基金经理、东兴兴瑞一年定期开放债券型证券投资基金基金经理、东兴兴盈三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、东兴鑫享6个月滚动持有债券型发起式证券投资基金基金经理、东兴兴源债券型证券投资基金基金经理、东兴连裕6个月滚动持有债券型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	---

注:1、对基金的首任基金经理,其"任职日期"为基金合同生效日,"离任日期"为根据公司决定确定的解聘日期;对此后的非首任基金经理,"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证券监督管理委员会和《东兴兴利债券型证券投资基金基金合同》的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

#### 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

基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,制定了《东兴基金管理有限公司公平交易管理办法》。

基金管理人建立了投资决策的内部控制体系和客观的研究方法，各投资组合经理在授权范围内自主决策，各投资组合共享研究平台，在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

基金管理人实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于交易所公开竞价交易，基金管理人执行交易系统内的公平交易程序；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易，在参与申购之前，各基金经理应在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量。在获配额度确定后，按照价格优先的原则对交易结果进行分配；如果申购价格相同，则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配。债券一级市场申购分配不足最小单位的，可由基金经理协商分配，协商不一致则由投资总监决定；对于银行间市场交易，应按照场外交易流程执行，由各基金经理给出询价区间，交易部根据询价区间在银行间市场上应该按照价格优先、时间优先的原则进行询价并完成交易，并留存询价交易记录备查。

基金管理人定期对不同投资组合不同时间段的同向交易价差、反向交易情况、异常交易情况进行统计分析，投资组合经理对相关交易情况进行合理性解释并留存记录。

我们对本报告期内公司管理的不同投资组合在相同时间窗口下（日内、3日内和5日内）同向交易的价差进行了t分布假设检验，通过对检验结果进行分析，未发现旗下投资组合之间存在可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

本报告期内，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动中公平对待不同投资组合，未直接或通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。本基金运作符合法律法规和公平交易管理制度规定。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，未出现涉及本基金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5%的情况。

### 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，我们选择波段操作及高评级信用债的配置结构，在保持较高的流动性水平同时严控基金的回撤。

下半年，我们将继续以“低回撤”为主要配置目的，在低波动率的基础上争取更高的基金收益。

东兴基金作为本基金管理人，在兼顾流动性充裕、信用风险可控的前提下，努力提升基金综合收益率。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2023年1月1日起至2023年6月30日，本基金A类份额净值增长率为2.44%，业绩比较基准收益率为1.06%，高于业绩比较基准1.38%；本基金C类份额净值增长率为2.42%，业绩比较基准收益率为1.06%，高于业绩比较基准1.36%，本基金D类份额净值增长率为2.28%，业绩比较基准收益率为1.06%，高于业绩比较基准1.22%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在上半年中，宽松的资金环境是支撑市场维持偏强的主要因素。宽松的货币环境叠加经济复苏修复斜率转弱，强预期与弱现实的再次碰撞，一季度的强修复预期也在二季度转弱，市场做多意愿增强。相对于国内利率水平，实体经济预期投资回报率过低，所以再次出现这种资产荒的局面。对于国内经济基本面来说，作为疫情后及贯彻二十大精神的开年，一季度经济修复斜率较高，但是随着政策支持逐步退出，内生动能不足的基本情况也随之凸显，上半年GDP增速低于预期，但勉强符合全年5%左右的增长目标；另外，国外地缘政治风险情况频发，对市场整体风险偏好造成影响。总结来说，上半年市场基本以复苏成色、外部风险为逻辑主线进行分析交易，随着时间的推移最终经济强修复被证伪，最终导致行情进一步的演化。而现在则是基本面维持较弱的态势，但是赔率较差，收益率下行动能不足，随着降息落地，市场便开始围绕政策刺激提振经济进行交易。如果对后续市场进行判断，我们应关注前期的两条主线有没有发生实质性的变化，例如经济修复超预期或者外部风险大幅转好。

展望今年下半年，在市场已经经过了一定的博弈之后，基本达成共识，即目前基本面有利于整体债市，但是点位较低所以赔率较差。即使近期政府释放大量积极信号，但是大的背景和定价逻辑并没有扭转。当前外部地缘政治风险仍然压制风险偏好，结构性矛盾和地产市场弱势或仍然影响市场预期转向积极。后续存在可能政策落地，预期或需求端短时间内或难以出现超预期修复的情况，对于债市来讲趋势延续或仍存在预期差交易机会。

另外，本轮信用风险的概率较2018年以及2020年降低很多，违约造成的系统性风险已经被充分认识，防范系统性风险成为主要目标，政治局会议上表述从严控新增隐性债务变成了优化地方债务，意味着债务问题或在向好的方向发展。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责

估值工作决策和执行的专门机构，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本基金本报告期未进行利润分配。

#### 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

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日出现基金持有人数量不满二百人或者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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人-东兴基金管理有限公司2023年1月1日至2023年6月30日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，东兴基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，东兴基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

### §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：东兴兴利债券型证券投资基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,274,298.71	3,828,277.95
结算备付金		1,516,112.18	3,781,331.11
存出保证金		48,049.17	67,067.74
交易性金融资产	6.4.7.2	9,085,188,669.86	5,664,909,924.34
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		9,085,188,669.86	5,664,909,924.34
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	730,131,743.78	6,222,194.45
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		45,702,983.31	13,346,068.47
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		9,863,861,857.01	5,692,154,864.06



负债和净资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
<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		-	1,063,275,973.81
应付清算款		-	2,191,171.59
应付赎回款		27,358,341.47	12,367,605.76
应付管理人报酬		6,335,003.67	3,415,970.89
应付托管费		1,810,001.05	975,991.70
应付销售服务费		244,590.74	290,823.18
应付投资顾问费		-	-
应交税费		899,714.09	692,088.06
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	158,223.97	293,799.71
负债合计		36,805,874.99	1,083,503,424.70
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	9,147,080,580.17	4,396,096,460.73
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	679,975,401.85	212,554,978.63
净资产合计		9,827,055,982.02	4,608,651,439.36
负债和净资产总计		9,863,861,857.01	5,692,154,864.06

注：报告截止日2023年6月30日，东兴兴利债券A基金份额净值1.0754元，基金份额总额1,611,909,127.91份；东兴兴利债券C基金份额净值1.0748元，基金份额总额6,864,288,586.37份；东兴兴利债券D基金份额净值1.0668元，基金份额总额670,882,865.89份。

## 6.2 利润表

会计主体：东兴兴利债券型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至202 2年06月30日
一、营业总收入		253,438,844.52	235,611,405.73
1.利息收入		9,141,608.10	4,805,449.41
其中：存款利息收入	6.4.7.9	198,126.72	125,602.29
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		8,943,481.38	4,679,847.12
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		192,764,592.49	163,567,429.82
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	192,764,592.49	163,567,429.82
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	-	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	51,160,596.90	66,496,284.94
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	372,047.03	742,241.56
<b>减：二、营业总支出</b>		44,666,459.81	44,213,044.39
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	31,750,368.25	28,959,010.87
2. 托管费	6.4.10.2.2	9,071,533.74	8,274,003.11
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,327,408.76	4,824,724.79
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,844,354.15	1,487,334.03
其中：卖出回购金融资产支出		1,844,354.15	1,487,334.03
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		545,375.75	537,784.27
8. 其他费用	6.4.7.19	127,419.16	130,187.32
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		208,772,384.71	191,398,361.34
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		208,772,384.71	191,398,361.34
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		208,772,384.71	191,398,361.34

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：东兴兴利债券型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06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（基金净值）	4,396,096,460.73	-	212,554,978.63	4,608,651,439.36

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	4,396,096,460.73	-	212,554,978.63	4,608,651,439.36
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	4,750,984,119.44	-	467,420,423.22	5,218,404,542.66
（一）、综合收益总额	-	-	208,772,384.71	208,772,384.71
（二）、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）	4,750,984,119.44	-	258,648,038.51	5,009,632,157.95
其中：1.基金申购款	14,014,647,615.54	-	878,798,538.52	14,893,446,154.06
2.基金赎回款	-9,263,663,496.10	-	-620,150,500.01	-9,883,813,996.11
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	9,147,080,580.17	-	679,975,401.85	9,827,055,982.02
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06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（基金净值）	2,623,530,925.12	-	91,559,618.85	2,715,090,543.97
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	2,623,530,925.12	-	91,559,618.85	2,715,090,543.97
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	13,043,906,701.92	-	879,017,337.18	13,922,924,039.10

（一）、综合收益总额	-	-	191,398,361.34	191,398,361.34
（二）、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）	13,043,906,701.92	-	687,618,975.84	13,731,525,677.76
其中：1.基金申购款	21,611,892,816.67	-	1,162,065,449.72	22,773,958,266.39
2.基金赎回款	-8,567,986,114.75	-	-474,446,473.88	-9,042,432,588.63
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	15,667,437,627.04	-	970,576,956.03	16,638,014,583.07

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：

牛南洁

郝洁

王广辉

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

东兴兴利债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据2016年9月9日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予东兴兴利债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2016]2073号）的批复，自2017年3月9日至2017年4月10日公开募集设立。本基金为债券型证券投资基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集342,299,036.24元人民币，业经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）“瑞华验字[2017]第01460002号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《东兴兴利债券型证券投资基金基金合同》于2017年4月14日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为342,334,360.30份，其中认购资金利息折合35,324.06份。本基金基金管理人为东兴基金管理有限公司（本基金原基金管理人为东兴证券股份有限公司，自2021年5月24日起变更为东兴基金管理有限公司），基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东兴兴利债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券(包括国债、央行票据、金融债券、地方政府债、企业债券、公司债券、短期

融资券、超短期融资券、中期票据、次级债、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换公司债券、证券公司的短期公司债)、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、权证、股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)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)。本基金可投资股票,持有可转换公司债券转股所得的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证,也可直接买入权证等中国证监会、允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为:债券资产占基金资产的比例不低于80%,本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。当法律法规的相关规定变更时,基金管理人根据法律从法规的规定或在履行适当程序后对上述资产配置比例进行适当调整。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的会计报表按照财政部2006年2月15日颁布的《企业会计准则--基本准则》(财政部令第33号发布、财政部令第76号修订)、于2006年2月15日及其后颁布和修订的42项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证券投资基金业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第3号-半年度报告的内容与格式》、《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》、《证券投资基金信息披露编报规则第3号-会计报表附注的编制及披露》及中国证监会颁布的其他相关规定编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合企业会计准则及其他有关规定要求,真实、完整地反映了本基金2023年6月30日的财务状况以及2023年1月1日至2023年6月30日的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与上一年年度报告相一致。

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日。本期财务报表的实际编制期间为2023年1月1日至2023年6月30日。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### 1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：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其他综合收益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产。在通常情况下，本基金所持有的金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产。

基金持有的股票投资、债券投资、基金投资、资产支持证券投资等金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，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。

基金持有的以摊余成本计量的、按照返售协议约定先买入再按固定价格返售的票据、证券等金融资产所融出的资金分类为买入返售金融资产。

基金采用买入并持有至到期策略的金融资产，即到期日固定、回收金额固定或可确定，且有明确意图和能力持有至到期的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产，在债权投资中核算。

基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### 2、金融负债的分类

金融负债分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以及以摊余成本计量的金融负债两类。基金持有的未划分为以摊余成本计量的金融负债通常以公允价值计量且其变动计入当期损益，列示为交易性金融负债。基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按取得时的公允价值作为初始确认金额。取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，期间取得的利息或现金股利，确认为当期收益。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以成本进行后续计量，在摊销时产生的利得或损失，应当确认为当期收益。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产；金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

1、对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2、对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

3、如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时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时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金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。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，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。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计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认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

##### （1）利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

分类为以摊余成本计量的金融资产利息收入在持有期内，按金融资产的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由金融资产发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认金融资产利息收入。其中：贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入；买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息收入。

##### （2）投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本和对应投资品种产生的交易费用的差额确认。

债券、资产支持证券、同业存单等固定收益类金融资产的投资收益分为：

① 持有期间的利息收入：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利息收入在持有期内，按金融资产的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由金融资产发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认金融资产投资收益。其中：贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认投资收益；

② 交易日按卖出金融资产交易日的成交总额扣除应结转的投资成本与应计利息(若有)和对应投资品种产生的交易费用后的差额确认投资收益。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本和对应投资品种产生的交易费用后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

##### （3）公允价值变动损益

公允价值变动损益系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性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，并于相关金融资产或金融负债卖出或到期时转出计入投资收益。

#### (4) 其他收入

其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量时确认。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 根据基金合同，基金管理费按前一日基金资产净值的0.70%的年费率逐日计提；

(2) 根据基金合同，基金托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率逐日计提；

(3) 自2020年5月27日起，本基金C类基金份额的销售服务费按前一日基金资产净值的年费率0.01%逐日计提并确认；自2020年12月18日起，本基金D类基金份额的销售服务费按前一日基金资产净值的年费率0.30%逐日计提并确认；

(4) 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费用；基金份额持有人大会费用、基金的证券交易或结算费用；基金的银行汇划费用；证券账户开户费用、银行账户维护费用、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为6次，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；每次基金收益分配比例不低于该次可分配收益的30%；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；选择采取红利再投资形式的，分红资金将按红利发放日的基金份额净值转成相应的基金份额，红利再投资的份额免收申购费。如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，则登记机构将以投资者在各销售机构最后一次选择的分红方式为准；

3、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；

4、同一类别每一基金份额享有同等分配权；

5、分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红，分红权益登记日申请赎回的基金份额享受当次分红；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他需要披露的重要会计政策和会计估计。

### 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

本基金在本报告期无需说明的重大会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期无需说明的重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期无需说明的重大会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税【2004】78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税【2008】1号《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》、2008年4月23日发布的《上海、深圳证券交易所关于做好交易相关系统印花税率参数调整的通知》、2008年9月18日发布的《上海、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【2012】85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税【2015】101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税【2016】36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税【2016】70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》、财税【2016】140号《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《财政部、国家税务总局关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税【2017】56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作、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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》，主要税项列示如下：

1.于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。自2018年1月1日起，在基金运营过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

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

3.对基金取得的股票股息、红利收入，自2015年9月8日起，基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4.对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5.对于基金从事A股买卖，自2008年09月19日起，由出让方按0.1%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税。

6.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、现金等对价，暂免于缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
活期存款	1,274,298.71
等于：本金	1,219,507.50
加：应计利息	54,791.21
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	1,274,298.71

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06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	1,049,785,754.59	22,659,304.33	1,071,569,747.13	-875,311.79
	银行间市场	7,834,539,982.87	121,328,572.73	8,013,618,922.73	57,750,367.13
	合计	8,884,325,737.46	143,987,877.06	9,085,188,669.86	56,875,055.34
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	8,884,325,737.46	143,987,877.06	9,085,188,669.86	56,875,055.34	

#### 6.4.7.3 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。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-

银行间市场	730,131,743.78	-
合计	730,131,743.78	-

#### 6.4.7.4.2 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持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	839.96
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	79,455.59
其中：交易所市场	-
银行间市场	79,455.59
应付利息	-
预提费用	77,928.42
合计	158,223.97

注：预提费用为按日计提的审计费、信息披露费和账户维护费。

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 6.4.7.7.1 东兴兴利债券A

金额单位：人民币元

项目 (东兴兴利债券A)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,490,381,286.12	1,490,381,286.12
本期申购	955,775,795.92	955,775,795.92

本期赎回（以“-”号填列）	-834,247,954.13	-834,247,954.13
本期末	1,611,909,127.91	1,611,909,127.91

#### 6.4.7.7.2 东兴兴利债券C

金额单位：人民币元

项目 (东兴兴利债券C)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,106,105,211.22	2,106,105,211.22
本期申购	12,727,432,478.08	12,727,432,478.08
本期赎回（以“-”号填列）	-7,969,249,102.93	-7,969,249,102.93
本期末	6,864,288,586.37	6,864,288,586.37

#### 6.4.7.7.3 东兴兴利债券D

金额单位：人民币元

项目 (东兴兴利债券D)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	799,609,963.39	799,609,963.39
本期申购	331,439,341.54	331,439,341.54
本期赎回（以“-”号填列）	-460,166,439.04	-460,166,439.04
本期末	670,882,865.89	670,882,865.89

#### 6.4.7.8 未分配利润

##### 6.4.7.8.1 东兴兴利债券A

单位：人民币元

项目 (东兴兴利债券A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	34,633,298.46	39,582,358.84	74,215,657.30
本期利润	30,855,914.53	10,639,589.00	41,495,503.53
本期基金份额交易产生的变动数	2,185,727.24	3,564,238.09	5,749,965.33

其中：基金申购款	31,532,701.91	29,976,749.69	61,509,451.60
基金赎回款	-29,346,974.67	-26,412,511.60	-55,759,486.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	67,674,940.23	53,786,185.93	121,461,126.16

#### 6.4.7.8.2 东兴兴利债券C

单位：人民币元

项目 (东兴兴利债券C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	86,122,641.40	17,855,136.97	103,977,778.37
本期利润	116,034,534.52	36,218,360.84	152,252,895.36
本期基金份额交易产生的变动数	206,475,768.71	50,994,385.93	257,470,154.64
其中：基金申购款	633,803,933.06	163,708,281.60	797,512,214.66
基金赎回款	-427,328,164.35	-112,713,895.67	-540,042,060.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	408,632,944.63	105,067,883.74	513,700,828.37

#### 6.4.7.8.3 东兴兴利债券D

单位：人民币元

项目 (东兴兴利债券D)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	22,425,542.53	11,936,000.43	34,361,542.96
本期利润	10,721,338.76	4,302,647.06	15,023,985.82
本期基金份额交易产生的变动数	-2,880,836.25	-1,691,245.21	-4,572,081.46
其中：基金申购款	13,009,448.32	6,767,423.94	19,776,872.26
基金赎回款	-15,890,284.57	-8,458,669.15	-24,348,953.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	30,266,045.04	14,547,402.28	44,813,447.32

#### 6.4.7.9 存款利息收入



单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
活期存款利息收入	139,348.17
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	58,237.10
其他	541.45
合计	198,126.72

注：其他为结算保证金利息收入。

**6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入**

本基金本报告期无股票投资收益。

**6.4.7.11 债券投资收益****6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
债券投资收益——利息收入	172,559,157.20
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	20,205,435.29
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	192,764,592.49

**6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	13,277,398,137.81
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本	13,080,004,305.44

总额	
减：应计利息总额	177,118,687.08
减：交易费用	69,710.00
买卖债券差价收入	20,205,435.29

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年01月01日至2023年06月 30日
1.交易性金融资产	51,160,596.90
——股票投资	-
——债券投资	51,160,596.90
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	51,160,596.90

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
基金赎回费收入	361,075.82
转换费收入	10,971.21
合计	372,047.03

**6.4.7.18 信用减值损失**

本基金本报告期无信用减值损失。

**6.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	9,421.05
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	39,890.74
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	127,419.16

注：其他为银行间账户查询费。

**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**

本基金本报告期末不存在需要说明的或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至本基金报告报出日，本基金不存在需要说明的资产负债表日后事项。

**6.4.9 关联方关系**

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

关联方名称	与本基金的关系
中国东方资产管理股份有限公司	基金管理人的实际控制人
东兴证券股份有限公司	基金管理人的控股股东、基金销售机构
东兴基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
大连银行股份有限公司	与基金管理人同一实际控制人的关联方、基金销售机构

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

**6.4.10.1.2 权证交易**

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

**6.4.10.1.3 债券交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月3 0日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月3 0日	
	成交金额	占当期债券 买卖成交总 额的比例	成交金额	占当期债 券买卖成 交总额的 比例
东兴证券股份有限公司	630,383,654.00	100.00%	1,423,579,005.46	100.00%

**6.4.10.1.4 债券回购交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06
-------	-------------------------------	--------------------------------

			月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
东兴证券股份有限公司	2,656,600,000.00	100.00%	1,101,200,000.00	100.00%

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方的佣金费用，期末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 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	31,750,368.25	28,959,010.87
其中：支付销售机构的客户维护费	14,431,504.08	13,958,071.81

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.70%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
----	-------------------------------	------------------------------------

当期发生的基金应支付的托管费	9,071,533.74	8,274,003.11
----------------	--------------	--------------

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期			
	2023年01月01日至2023年06月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	东兴兴利债券A	东兴兴利债券C	东兴兴利债券D	合计
东兴基金管理有限公司	0.00	3,035.06	0.00	3,035.06
东兴证券股份有限公司	0.00	42,085.06	0.00	42,085.06
大连银行股份有限公司	0.00	8,224.86	993,319.86	1,001,544.72
合计	0.00	53,344.98	993,319.86	1,046,664.84
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间			
	2022年01月01日至2022年06月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	东兴兴利债券A	东兴兴利债券C	东兴兴利债券D	合计
东兴基金管理有限公司	0.00	11.84	0.00	11.84
东兴证券股份有限公司	0.00	26,464.21	0.00	26,464.21
大连银行股份有限公司	0.00	20,680.00	4,604,866.95	4,625,546.95
合计	0.00	47,156.05	4,604,866.95	4,652,023.00

注：1、本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.01%的年费率计提。C类基金份额销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.01\% \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E为前一日的C类基金份额基金资产净值

D类基金份额的销售服务费按前一日D类基金份额的基金资产净值的0.30%的年费率计提。D类基金份额销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H为D类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E为前一日的C类基金份额基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取，由基金管理人支付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2、本基金于2020年5月27日起增设C类基金份额，于2020年12月18日起增设D类基金份额。

#### 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

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

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间，未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间，未发生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。

#### 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

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

#### 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 2023年01月01日至2023年0 6月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月3 0日	
	期末余额	当期利息 收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	1,274,298.71	139,348.17	10,802,463.69	109,711.68

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间，本基金无其他关联事项的说明。

#### 6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本基金本报告期未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023年06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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 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

本基金本报告期末未持有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无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

本基金投资风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险和操作风险及其他不可抗拒的风险。其中在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

对于上述风险本基金管理人建立了系统化、流程化和数量化的风险管理体系，确保投资组合在获取较高收益的同时承受尽可能低的风险，从而实现本基金的投资目标。本基金设立了由风险控制委员会、投资决策委员会、风险管理部门组成的风险管理组织体系，该体系通过分工合作的制度对风险进行管理控制。本基金通过事前的风险识别，事中的风险测量和处理以及事后的风险评估和调整风险实行全程风险控制。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、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；本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的百分之十，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，不超过该证券的百分之十。

除通过上述投资限定控制相应信用风险外，本基金在交易所进行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，发生违约风险的可能性很低；本基金也可在银行间同业市场进行交易，在交易前均会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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	243,420,543.47	-
A-1以下	-	-
未评级	3,775,841,460.46	1,920,285,451.75
合计	4,019,262,003.93	1,920,285,451.75

注：以上按短期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有资产支持证券。

**6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	1,088,539,389.30	447,238,529.84
合计	1,088,539,389.30	447,238,529.84

**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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	1,154,253,168.85	1,609,642,192.05
AAA以下	797,427,576.43	898,337,112.34
未评级	993,159,120.06	483,970,679.46
合计	2,944,839,865.34	2,991,949,983.85

注：以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

**6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年度末未持有资产支持证券。

**6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级的同业存单投资。

**6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人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，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。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的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注6.4.12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，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。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投资的公允价值。

本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约约定剩余到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

#### **6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本报告所称流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险，风险管理的目标是确保基金组合资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。基金管理人在报告期内综合考虑投资标的流动性、投资策略、投资限制、销售渠道、潜在投资者类型与风险偏好、投资者结构等因素，综合进行流动性风险管理。

基金管理人坚持按照"组合管理、分散投资"的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制进行投资管理，通过灵活配置的二级市场投资策略、分散化的投资原则、严格的投资比例限制等投资安排，使基金组合资产的流动性安排与基金申赎安排相匹配，报告期内未发生流动性风险事件。

#### **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**

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金基金管理人在利率风险管理方面，定期监控本基金面临的利率风险敞口，并通过调整基金投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年06月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5 年 以 上	不计息	合计
<b>资产</b>							
银行存款	1,219,507.50	-	-	-	-	54,791.21	1,274,298.71
结算备付金	1,515,430.28	-	-	-	-	681.90	1,516,112.18
存出保证金	48,027.57	-	-	-	-	21.60	48,049.17
交易性金融资产	1,045,708,300.00	1,517,684,250.00	5,194,568,600.00	1,183,239,642.80	-	143,987,877.06	9,085,188,669.86
买入返售金融资产	729,985,894.98	-	-	-	-	145,848.80	730,131,743.78
应收申购款	-	-	-	-	-	45,702,983.31	45,702,983.31
资产总计	1,778,477,160.33	1,517,684,250.00	5,194,568,600.00	1,183,239,642.80	-	189,892,203.88	9,863,861,857.01
<b>负债</b>							
应付赎回款	-	-	-	-	-	27,358,341.47	27,358,341.47
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	6,335,003.67	6,335,003.67
应付托管费	-	-	-	-	-	1,810,001.05	1,810,001.05
应付销售服务费	-	-	-	-	-	244,590.74	244,590.74
应交税费	-	-	-	-	-	899,714.09	899,714.09
其他负债	-	-	-	-	-	158,223.97	158,223.97
负债总计	-	-	-	-	-	36,805,874.99	36,805,874.99
利率敏感度缺口	1,778,477,160.33	1,517,684,250.00	5,194,568,600.00	1,183,239,642.80	-	153,086,328.89	9,827,055,982.02
<b>上年度末 2022年12月31日</b>							
<b>资产</b>							
银行存款	3,812,029.91	-	-	-	-	16,248.04	3,828,277.95
结算备付金	3,779,460.23	-	-	-	-	1,870.88	3,781,331.11
存出保证金	67,034.52	-	-	-	-	33.22	67,067.74
交易性金融资产	598,570,000.00	1,004,474,200.00	2,554,595,130.00	1,397,879,132.20	-	109,391,462.14	5,664,909,924.34
买入返售金融资产	6,220,209.33	-	-	-	-	1,985.12	6,222,194.45
应收申购款	-	-	-	-	-	13,346,068.47	13,346,068.47
资产总计	612,448,733.99	1,004,474,200.00	2,554,595,130.00	1,397,879,132.20	-	122,757,667.87	5,692,154,864.06
<b>负债</b>							
卖出回购金融资产款	1,063,050,257.42	-	-	-	-	225,716.39	1,063,275,973.81
应付清算款	-	-	-	-	-	2,191,171.59	2,191,171.59
应付赎回款	-	-	-	-	-	12,367,605.76	12,367,605.76
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,415,970.89	3,415,970.89
应付托管费	-	-	-	-	-	975,991.70	975,991.70
应付销售服务费	-	-	-	-	-	290,823.18	290,823.18
应交税费	-	-	-	-	-	692,088.06	692,088.06
其他负债	-	-	-	-	-	293,799.71	293,799.71
负债总计	1,063,050,257.42	-	-	-	-	20,453,167.28	1,083,503,424.70
利率敏感度缺口	-450,601,523.43	1,004,474,200.00	2,554,595,130.00	1,397,879,132.20	-	102,304,500.59	4,608,651,439.36

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；2、所有期限的利率均以相同幅度变动25个基点，其他市场变量均不发生变化；3、银行存款、结算备付金、存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益、而对其本身的公允价值无重大影响；4、该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	1、市场利率上升25个基点	-17,343,914.49	-8,197,827.11
2、市场利率下降25个基点	17,451,043.63	8,234,908.68	

#### 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是市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 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 2023年06月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	-	-	-	-

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	9,085,188,669.86	92.45	5,664,909,924.34	122.92
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	9,085,188,669.86	92.45	5,664,909,924.34	122.92

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	市场其他变量保持不变，只有业绩比较基准所对应的市场组合价格发生合理、可能的变动；		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	业绩比较基准变动+5%	26,798,200.27	-4,902,065.81
	业绩比较基准变动-5%	-26,798,200.27	4,902,065.81

#### 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的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：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

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	9,085,188,669.86	5,664,909,924.34
第三层次	-	-
合计	9,085,188,669.86	5,664,909,924.34

**6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动**

本基金本报告期内不存在持有的金融工具公允价值所属层次间发生重大变动的情况。

**6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

本基金本报告期内不存在持有非持续以公允价值计量的金融工具的情况。

**6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明**

本基金本报告期内不存在持有不以公允价值计量的金融工具的情况。

**6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

截至本报告报出日，本基金无需要披露的有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

**§7 投资组合报告****7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,085,188,669.86	92.11
	其中：债券	9,085,188,669.86	92.11
	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	730,131,743.78	7.40
	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	2,790,410.89	0.03
8	其他各项资产	45,751,032.48	0.46

9	合计	9,863,861,857.01	100.00
---	----	------------------	--------

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

## 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

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

本基金本报告期末未买入股票。

### 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

本基金本报告期末未卖出股票。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末投资股票。

## 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	493,441,795.61	5.02
2	央行票据	-	-
3	金融债券	539,105,615.68	5.49
	其中：政策性金融债	539,105,615.68	5.49
4	企业债券	609,562,814.53	6.20
5	企业短期融资券	4,019,262,003.93	40.90
6	中期票据	2,335,277,050.81	23.76
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	1,088,539,389.30	11.08
9	其他	-	-
10	合计	9,085,188,669.86	92.45



**7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019688	22国债23	2,780,000	281,111,543.55	2.86
2	019694	23国债01	2,100,000	212,330,252.06	2.16
3	012284354	22电网SCP022	2,000,000	202,290,904.11	2.06
4	230201	23国开01	2,000,000	201,940,273.22	2.05
5	112315058	23民生银行CD058	2,000,000	198,427,604.40	2.02

**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**

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**

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**

本基金本报告期末未持有权证。

**7.10 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期末未投资股指期货。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**7.12 投资组合报告附注****7.12.1**

本基金投资的前十名证券的发行主体中，本期未出现被监管部门立案调查的情形；中国民生银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、平安银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、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。

**7.12.2**

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

**7.12.3 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	48,049.17
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	45,702,983.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	45,751,032.48

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末未持有股票。

**§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
东兴兴利债券A	29,846	54,007.54	907,477,120.48	56.30%	704,432,007.43	43.70%
东兴兴利债券C	152,220	45,094.52	434,568,415.43	6.33%	6,429,720,170.94	93.67%
东兴兴利债券D	5,398	124,283.60	0.00	0.00%	670,882,865.89	100.00%
合计	187,464	48,793.80	1,342,045,535.91	14.67%	7,805,035,044.26	85.33%

**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	东兴兴利债券A	2,246.86	0.00%
	东兴兴利债券C	247,620.45	0.00%
	东兴兴利债券D	0.00	0.00%
	合计	249,867.31	0.00%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

	东兴兴利债券A	东兴兴利债券C	东兴兴利债券D
基金合同生效日(2017年04月14日)基金份额总额	342,334,360.30	-	-
本报告期期初基金份额总额	1,490,381,286.12	2,106,105,211.22	799,609,963.39
本报告期基金总申购份额	955,775,795.92	12,727,432,478.08	331,439,341.54
减：本报告期基金总赎回份额	834,247,954.13	7,969,249,102.93	460,166,439.04
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,611,909,127.91	6,864,288,586.37	670,882,865.89

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内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**

本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

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。

**10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

本报告期内，无涉及基金管理人、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**

本报告期内基金投资策略未发生改变。

**10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

本基金本报告期内未更换会计师事务所。

**10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况****10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

**10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

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

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东兴证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

注：1、此处的佣金指本基金通过券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计,不单指股票交易佣金。

**2、交易单元的选择标准和程序**

券商选择标准：财务状况良好、经营行为规范、研究实力较强的证券公司。其中财务状况良好、经营行为规范以最近一年证券公司分类评介在C类或C类以上，且近一年内无重大违法违规事件为主要判断依据。研究实力较强以公司的评价意见为主要判断依据。

券商选择程序：①对符合选择标准的券商的服务进行评价；②拟定租用对象：由投研部门根据以上评价结果拟定备选的券商；③签约：拟定备选的券商后，按公司签约程序与备选券商签约。签约时，要明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等。

3、本基金本报告期内未新增交易单元。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东兴证券股份有限公司	630,383,654.00	100.00%	2,656,600,000.00	100.00%	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东兴兴利债券型证券投资基金2022年第4季度报告	指定报刊、指定网站	2023-01-20
2	关于增加中证金牛（北京）基金销售有限公司为东兴基金管理有限公司公开募集证券投资基金的销售机构的公告	指定报刊、指定网站	2023-01-30
3	关于增加浙江同花顺基金销售有限公司为东兴基金管理有限公司公开募集证券投资基金的销售机构的公告	指定报刊、指定网站	2023-03-15
4	东兴兴利债券型证券投资基金2022年年度报告	指定报刊、指定网站	2023-03-31
5	东兴兴利债券型证券投资基金2023年第1季度报告	指定报刊、指定网站	2023-04-21
6	关于东兴兴利债券型证券投资基金调整大额申购（含转换转入）业务限额的公告	指定报刊、指定网站	2023-04-21
7	东兴兴利债券型证券投资基金基金产品资料概要更新	指定报刊、指定网站	2023-05-24
8	东兴兴利债券型证券投资基金招募说明书（更新）（2023年第1号）	指定报刊、指定网站	2023-05-24
9	关于增加麦高证券有限责任公司为东兴基金管理有限公司公开募集证券投资基金的销售机构的公告	指定报刊、指定网站	2023-05-25

## §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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 一、中国证监会核准东兴兴利债券型证券投资基金募集的文件
- 二、《东兴兴利债券型证券投资基金基金合同》
- 三、《东兴兴利债券型证券投资基金托管协议》
- 四、《东兴兴利债券型证券投资基金招募说明书》
- 五、中国证监会颁发的经营证券期货业务许可证、营业执照、公司章程

### 12.2 存放地点

北京市西城区平安里西大街28号中海国际中心6层

### 12.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（[www.dxamc.cn](http://www.dxamc.cn)）查阅。

东兴基金管理有限公司  
二〇二三年八月三十一日