

兴华永兴混合型发起式证券投资基金 清算报告

基金管理人：兴华基金管理有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

报告出具日期：二〇二三年十二月二十五日

报告公告日期：二〇二三年十二月三十日

1、重要提示

1.1 重要提示

兴华永兴混合型发起式证券投资基金（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”）2020年11月11日证监许可[2020]3016号文准予注册，并经中国证监会2023年7月31日证监许可[2023]1663号文变更注册，基金管理人为兴华基金管理有限公司，基金托管人为招商证券股份有限公司。

根据《兴华永兴混合型发起式证券投资基金基金合同》“第五部分 基金备案”之“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定：“《基金合同》生效满3年之日（指自然日），若基金资产净值低于2亿元，无需召开基金份额持有人大会审议，基金合同应当终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。”本基金《基金合同》生效日为2020年12月16日，其生效之日起满三年后的对应日为2023年12月16日。经本基金的登记机构确认，截至2023年12月16日日终，本基金基金资产净值低于2亿元，触发上述基金合同终止情形。本基金将根据《基金合同》约定进入基金财产清算程序，无需召开基金份额持有人大会。

本基金自2023年12月17日起进入清算程序。本基金清算期为2023年12月17日至2023年12月22日，由本基金基金管理人、基金托管人、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）、上海市通力律师事务所组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

2、基金概况

2.1 基金基本情况

基金简称	兴华永兴混合发起式	
基金主代码	010756	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年12月16日	
2023年12月16日日终基金份额总额	32,572,369.89份	
基金管理人	兴华基金管理有限公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	兴华永兴混合发起式 A	兴华永兴混合发起式 C
下属分级基金的交易代码	010756	010757
2023年12月16日日终下属分级基金的份额总额	31,918,500.75份	653,869.14份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险、确保基金资产良好流动性的前提下，追求较高投资回报率，力争实现基金资产长期稳健增值。
投资策略	1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、港股通标的股票投资策略；4、存托凭证投资策略；5、债券投资策略；6、金融衍生品投资策略；7、资产支持证券投资策略；8、融资投资策略
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*65%+中债综合指数收益率*20%+恒生指数（人民币）收益率*15%
风险收益特征	本基金为混合型基金，一般而言，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

3、基金运作情况说明

3.1 基金基本情况

本基金经中国证监会证监许可[2020]3016号《关于准予兴华永兴混合型发起式证券投资基金注册的批复》准予注册，由兴华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《兴华永兴混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共计人民币12,264,303.66

元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第1090号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《兴华永兴混合型发起式证券投资基金基金合同》于2020年12月16日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为12,266,436.69份基金份额，其中认购资金利息折合2,133.03份基金份额。本基金的基金管理人为兴华基金管理有限公司，基金托管人为招商证券股份有限公司。

本基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，并于2023年9月11日计票并表决通过了《关于兴华永兴混合型发起式证券投资基金变更投资范围有关事项的议案》，内容包括修改投资范围、投资组合比例、投资策略、投资限制、业绩比较基准、估值方法，并增加公开披露的基金信息等。上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效，自2023年9月12日起，变更注册后的《兴华永兴混合型发起式证券投资基金基金合同》生效。

根据《兴华永兴混合型发起式证券投资基金基金合同》，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，但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；在投资者认购/申购时不收取认购/申购费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，并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。本基金A类、C类基金份额分别设置代码，分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《兴华永兴混合型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、二级资本债、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券）、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、金融衍生品（包括股指期货、国债期货、股票期权）以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金可根据相关法律法规和《基金合同》的约定，参与融资业务。基金的投资组合比例为：本基金股票投资及存托凭证资产占基金资产的比例范围为60%-95%（其中港股通标的股票占股票资产的比例不超过50%）。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，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：沪深 300 指数收益率*65%+中债综合指数收益率*20%+恒生指数（人民币）收益率*15%。

3.2 清算原因

根据《兴华永兴混合型发起式证券投资基金基金合同》“第五部分 基金备案”之“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定：“《基金合同》生效满 3 年之日（指自然日），若基金资产净值低于 2 亿元，无需召开基金份额持有人大会审议，基金合同应当终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。”本基金《基金合同》生效日为 2020 年 12 月 16 日，其生效之日起满三年后的对应日为 2023 年 12 月 16 日。经本基金的登记机构确认，截至 2023 年 12 月 16 日日终，本基金基金资产净值低于 2 亿元，触发上述基金合同终止情形。本基金将根据《基金合同》约定进入基金财产清算程序，无需召开基金份额持有人大会。

3.3 清算起始日

根据《关于兴华永兴混合型发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金于 2023 年 12 月 17 日起进入清算程序。

4、财务报告

4.1 资产负债表(已经审计)

基金最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：兴华永兴混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2023年12月16日

单位：人民币元

资产	2023年12月16日 (基金最后运作日)
资产：	
银行存款	3,127,919.09
存出保证金	20,698,747.53
买入返售金融资产	-527.46
资产总计	23,826,139.16
负债：	
应付赎回款	487.86
应付管理人报酬	13,662.86

应付托管费	2,277.13
应付销售服务费	94.09
其他负债	28,066.50
负债合计	44,588.44
所有者权益：	
实收基金	32,572,369.89
未分配利润	-8,790,819.17
所有者权益合计	23,781,550.72
负债和所有者权益总计	23,826,139.16

注：1. 报告截止日 2023 年 12 月 16 日(基金最后运作日)，基金份额总额 32,572,369.89 份。

其中兴华永兴混合型发起式证券投资基金 A 类基金份额净值 23,309,914.13 元，基金份额总额 31,918,500.75 份；兴华永兴混合型发起式证券投资基金 C 类基金份额净值 471,636.59 元，基金份额总 653,869.14 份。

2. 本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制的。基金管理人编制清算报表是为了供兴华永兴混合型发起式证券投资基金全体持有人以及中国证监会使用。因此，清算报表可能不适用于其他用途。自本基金最后运作日起，资产负债按清算价格计价。由于报告性质所致，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

5、清算情况

5.1 资产负债清算情况

清算期间自 2023 年 12 月 17 日至 2023 年 12 月 22 日止，兴华永兴混合型发起式证券投资基金基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。各项资产负债清算情况如下：

5.1.1 资产处置情况

1、本基金最后运作日银行存款及其应计利息总和为人民币 3,127,919.09 元，其中托管户存款为 3,124,253.99 元，应计银行存款利息 3,665.10 元。应计利息已于 2023 年 12 月 21 日结息时收到。

2、本基金最后运作日存出保证金及其应计利息总和为人民币 20,698,747.53 元，其中应计招商证券券商保证金利息 828.55 元；应计中信证券券商保证金利息 254.16 元，招商证券应计利息及中信证券应计利息已于 2023 年 12 月 20 日销户时收到。

3、本基金最后运作日买入返售金融资产总和为人民币-527.46 元，系上交所质押式回购应计利息余额，该回购已于 2023 年 12 月 15 日到期且款项划回存出保证金账户。按照市

场交易规则，应计利息已于 2023 年 12 月 17 日摊销归零。

5.1.2 负债的清偿情况

1、本基金最后运作日应付赎回款为人民币 487.86 元，该款项已于 2023 年 12 月 18 日支付。

2、本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 13,662.86 元，该款项已于 2023 年 12 月 20 日支付。

3、本基金最后运作日应付托管费为人民币 2,277.13 元，该款项已于 2023 年 12 月 20 日支付。

4、本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 94.09 元，该款项已于 2023 年 12 月 20 日支付。

5、本基金最后运作日其他负债为人民币 28,066.50 元，包含预提的审计费、律师费和汇划手续费。其中，预提审计费为人民币 23,000.00 元，该款项预计 2023 年 12 月 29 日安排支付；预提律师费为人民币 5,000.00 元，该款项预计 2023 年 12 月 29 日安排支付；预提汇划手续费人民币 66.50 元，与托管户开户行协商，2023 年 12 月 16 日之后手续费减免，该款项预计销户时支付。

5.2 清算损益表

项目	2023 年 12 月 17 日至 2023 年 12 月 22 日 (清算期间)
一、清算收益	3,550.16
1. 利息收入	3,022.70
2. 买入返售金融资产	527.46
二、清算费用	-
三、清算收益（损失）总额	3550.16

注：1. 利息收入系计提的自 2023 年 12 月 17 日至 2023 年 12 月 22 日止清算期间的银行存款利息收入、存出保证金利息收入。其中，银行存款利息收入人民币 2,692.75 元；招商证券存出保证金利息收入人民币 298.64 元；中信证券存出保证金利息收入人民币 31.31 元。

2. 买入返售金融资产系清算期间本基金收到的上交所质押式逆回购应计利息。

5.3 截至本次清算期结束日的剩余财产情况及剩余财产分配安排

项目	金额
一、最后运作日 2023 年 12 月 16 日 基金净资产	23,781,550.72
加：清算期间净收益	3,550.16
减：基金净赎回金额（于 2023 年 12	5,273.80

月 18 日确认的投资者赎回申请)	
二、2023 年 12 月 22 日基金净资产	23,779,827.08

截至本次清算期结束日 2023 年 12 月 22 日，本基金剩余财产为人民币 23,779,827.08 元。自本次清算期结束日次日至清算款划出前一日的收益和费用由基金份额持有人享有和承担。为了提高清算效率，及时向基金份额持有人分配剩余财产，基金管理人以自有资金对未到账的应收利息进行垫付。基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

5.4 清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核，将与会计师事务所出具的清算审计报告、律师事务所出具的法律意见书一并报中国证监会备案后向基金份额持有人公告。清算报告公告后，基金管理人将遵照法律法规、基金合同等规定及时进行分配。

6、备查文件目录

6.1 备查文件目录

6.1.1 兴华永兴混合型发起式证券投资基金清算财务报表及审计报告

6.1.2 关于《兴华永兴混合型发起式证券投资基金清算报告》的法律意见

6.2 存放地点

基金管理人处

6.3 查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅

兴华永兴混合型发起式证券投资基金基金财产清算小组

二〇二三年十二月二十五日