

# 兴华永兴混合型发起式证券投资基金

## 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

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

送出日期：2021 年 8 月 30 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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 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
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	10
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 .....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	11
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 .....	11
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	11
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	12
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 .....	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表 .....	12
6.2 利润表 .....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	14
6.4 报表附注 .....	15
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	38

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	39
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	42
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	42
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	42
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	42
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	42
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	42
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42
7.12	投资组合报告附注	42
<b>§ 8</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>43</b>
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	43
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	44
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的情况	44
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况	44
<b>§ 9</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>45</b>
<b>§ 10</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>45</b>
10.1	基金份额持有人大会决议	45
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	45
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	45
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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	45
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	46
10.8	其他重大事件	47
<b>§ 11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>48</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	48
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	48
<b>§ 12</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>49</b>
12.1	备查文件目录	49
12.2	存放地点	49
12.3	查阅方式	49

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	兴华永兴混合型发起式证券投资基金	
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	
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	
报告期末基金份额总额	22,710,417.79 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分类基金的基金简称	兴华永兴混合发起式 A	兴华永兴混合发起式 C
下属分类基金的交易代码	010756	010757
报告期末下属分类基金的份额总额	21,936,665.78 份	773,752.01 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	本基金的投资策略可分为资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、金融衍生品投资策略、资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%
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。

### 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		兴华基金管理有限公司	招商证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王海滨	韩鑫普
	联系电话	4000678815	0755-82943666
	电子邮箱	wanghaibin@xinghuafund.com.cn	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		4000678815	95565
传真		0532-80921032	0755-82960794
注册地址		山东省青岛市李沧区金水路 187 号青岛国际院士港产业加速器 2 号楼 8 层	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
办公地址		山东省青岛市李沧区金水路 187 号青岛国际院士港产业加速器 2	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

	号楼 8 层	
邮政编码	266199	518000
法定代表人	张磊	霍达

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.xinghuafund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	兴华基金管理有限公司	山东省青岛市李沧区金水路 187 号青岛国际院士港产业加速器 2 号楼 8 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

基金类别	兴华永兴混合发起式 A	兴华永兴混合发起式 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期（2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日）	报告期（2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	3,255,640.58	100,275.60
本期利润	2,737,417.10	81,528.10
加权平均基金份额本期利润	0.1553	0.1432
本期加权平均净值利润率	14.56%	13.42%
本期基金份额净值增长率	13.43%	13.21%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2021 年 6 月 30 日）	
期末可供分配利润	3,239,773.24	112,360.48
期末可供分配基金份额利润	0.1477	0.1452
期末基金资产净值	25,176,439.02	886,112.49
期末基金份额净值	1.1477	1.1452
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2021 年 6 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	14.77%	14.52%

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) 本报告所列示的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) 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孰低数。

### 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

兴华永兴混合发起式 A

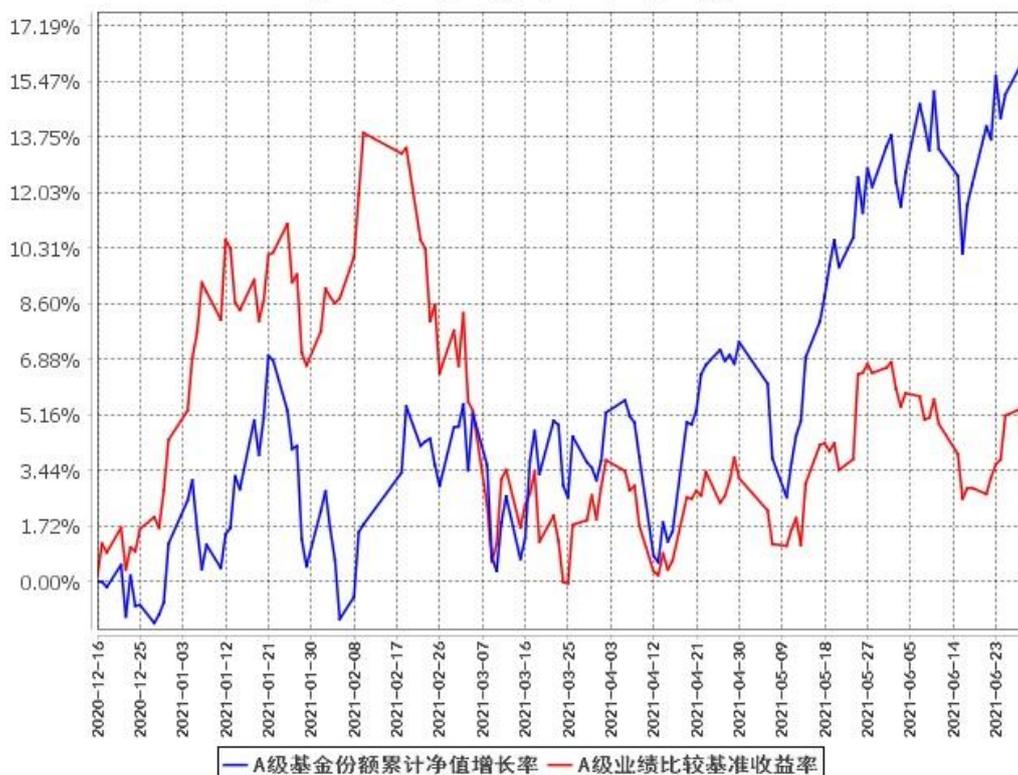
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.15%	1.20%	-1.62%	0.64%	2.77%	0.56%
过去三个月	11.28%	1.15%	2.91%	0.78%	8.37%	0.37%
过去六个月	13.43%	1.23%	0.49%	1.05%	12.94%	0.18%
自基金合同生效起至今	14.77%	1.21%	4.90%	1.03%	9.87%	0.18%

兴华永兴混合发起式 C

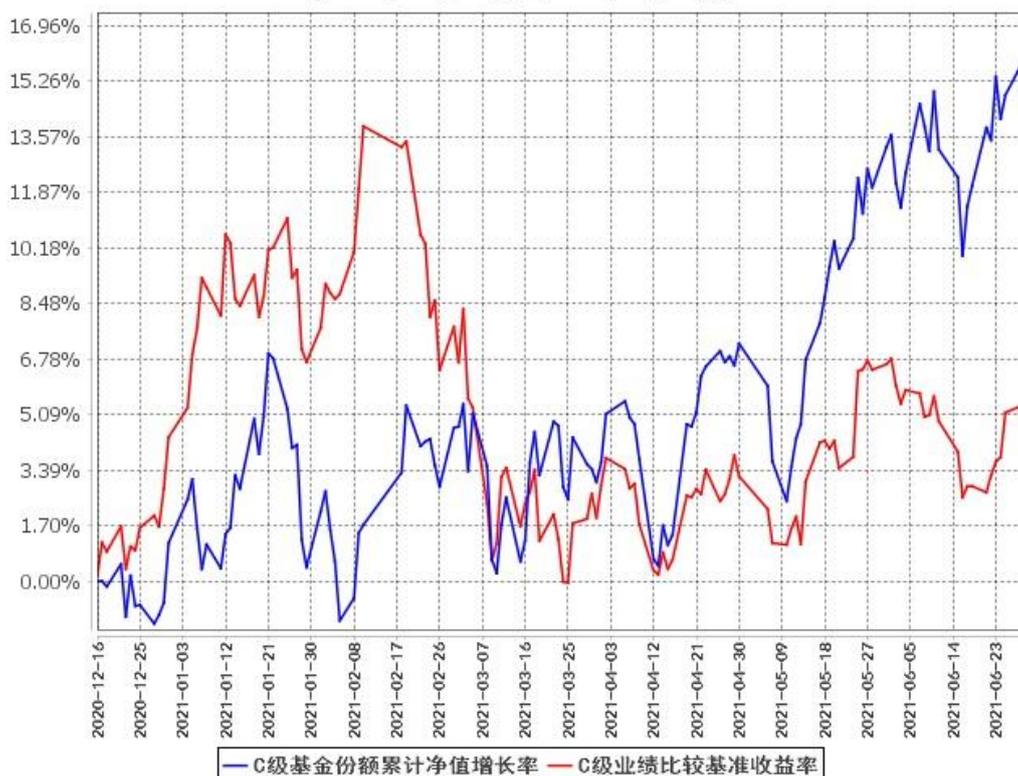
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.12%	1.20%	-1.62%	0.64%	2.74%	0.56%
过去三个月	11.16%	1.15%	2.91%	0.78%	8.25%	0.37%
过去六个月	13.21%	1.23%	0.49%	1.05%	12.72%	0.18%
自基金合同生效起至今	14.52%	1.21%	4.90%	1.03%	9.62%	0.18%

### 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

**A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图**  
(2020年12月16日至2021年6月30日)



**C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图**  
(2020年12月16日至2021年6月30日)



注：(1) 本基金合同于 2020 年 12 月 16 日生效，截至报告期末基金合同生效未满一年。

(2) 按基金合同规定，本基金的建仓期为自基金合同生效之日起 6 个月。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合本基金合同的有关规定。

## § 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

兴华基金管理有限公司(以下简称“兴华基金”或“公司”)已于 2020 年 3 月 4 日正式获得中国证监会核准设立批复，2020 年 4 月 28 日取得营业执照，于 2020 年 9 月 14 日取得《经营证券期货业务许可证》。公司注册地及经营地为山东省青岛市，是一家全部由资深专业人士持股的公募基金管理公司，是注册在山东省的首家全国性公募基金管理公司，填补了山东公募基金业的空白，在山东金融发展史上具有里程碑意义。

截至 2021 年 6 月 30 日，兴华基金管理有限公司旗下共管理 2 只公募基金，包括兴华永兴混合型发起式证券投资基金、兴华瑞丰混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券 从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
冷文鹏	基金经 理	2020 年 12 月 16 日	-	16 年	冷文鹏先生，中国国籍，中国人民银行研究生部金融学硕士，具有基金从业资格。曾先后就职于华夏基金管理有限公司高级经理，新华基金管理有限公司研究部研究员，华泰柏瑞基金管理有限公司高级研究员，西部利得基金管理有限公司基金经理，国新投资有限公司投资部、研究部执行总经理。现任兴华基金管理有限公司股票投资部负责人。

注：1、上述任职日期和离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、本基金无基金经理助理。

#### 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

无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，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。本报告期内，本基金运作合规，不存在违反基金合同和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，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

##### 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，市场总体表现为区间震荡行情，波动有所加大，并由流动性驱动转为业绩驱动，风格分化程度明显改善，整体结构趋于均衡，阶段性活跃主题和热点较多，结构性机会较为突出。

本基金风格偏成长，聚焦大科技、大医疗、大制造、大消费赛道，重点布局创新药、自主创新、新能源、消费升级等方向，注重组合的风险收益均衡，优先配置估值与预期收益业绩增速更为匹配的稳健型品种。受益于上市公司业绩增速回升以及市场资金对成长风格偏好增强，通过精选行业与个股，本基金业绩相对市场表现良好。

感谢持有人的支持，您的信任是激励我们前进的最大动力，我们将继续勤勉尽责，努力进取，不忘初心，忠于所托，为信任奉献回报。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末兴华永兴混合发起式 A 的基金份额净值为 1.1477 元，本报告期基金份额净值增长率为 13.43%；截至本报告期末兴华永兴混合发起式 C 的基金份额净值为 1.1452 元，本报告期

基金份额净值增长率为 13.21%；同期业绩比较基准收益率为 0.49%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，随着新冠疫苗全球接种的持续推进，全球经济预计将延续复苏态势，企业盈利也将继续反弹，同时非常态的宽松政策将面临有序退出，在这一背景下，预计 2021 年下半年股票市场将维持业绩驱动特征，企业盈利复苏力度与流动性边际收紧推动的市场风险偏好波动之间的博弈加剧。考虑到新冠疫情仍可能有所反复、企业盈利复苏并非一帆风顺、全球通胀压力增加、流动性边际收紧、中美争端形势复杂等因素，预计市场中枢逐步上移的过程中仍会面临较大波动，总体可能呈现宽幅震荡格局。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会，成员由公司高级管理人员、投资研究部门、基金运营部门、监察稽核部门等相关人员组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，基金经理参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。与估值相关的机构包括但不限于上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司，中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

## § 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，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履

行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：兴华永兴混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,223,220.69	676,600.10
结算备付金		-	-
存出保证金		211,538.04	173,637.52
交易性金融资产	6.4.7.2	24,667,931.90	11,568,870.00
其中：股票投资		24,667,931.90	11,568,870.00
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	594.49	389.24
应收股利		-	-
应收申购款		31,941.17	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		26,135,226.29	12,419,496.86

负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		20,453.76	-
应付管理人报酬		31,750.78	7,506.84
应付托管费		5,291.80	1,251.14
应付销售服务费		301.73	38.49
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	14,876.71	-
负债合计		72,674.78	8,796.47
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	22,710,417.79	12,266,436.69
未分配利润	6.4.7.10	3,352,133.72	144,263.70
所有者权益合计		26,062,551.51	12,410,700.39
负债和所有者权益总计		26,135,226.29	12,419,496.86

注：(1) 报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 22,710,417.79 份，其中兴华永兴混合发起式 A 基金份额净值 1.1477 元，基金份额总额 21,936,665.78 份；兴华永兴混合发起式 C 基金份额净值 1.1452 元，基金份额总额 773,752.01 份。

(2) 本基金合同于 2020 年 12 月 16 日生效，无上年度可比期间。

## 6.2 利润表

会计主体：兴华永兴混合型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		3,053,254.38
1. 利息收入		7,418.25
其中：存款利息收入	6.4.7.11	7,391.00
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		27.25
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,574,710.89
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,459,228.04
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	115,482.85
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-536,970.98
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	8,096.22
<b>减：二、费用</b>		234,309.18
1. 管理人报酬		143,061.16
2. 托管费		23,843.50
3. 销售服务费		1,195.33
4. 交易费用	6.4.7.19	51,332.48
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.20	14,876.71
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		2,818,945.20
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		2,818,945.20

注：本基金合同于 2020 年 12 月 16 日生效，无上年度可比期间。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴华永兴混合型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	12,266,436.69	144,263.70	12,410,700.39



不从本类别基金资产中计提销售服务费的为 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为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 10,001,800.18 份基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

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基金合同》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)、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。基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例范围为 60%-95%；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×80%+中债综合指数收益率×20%

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《兴华永兴混合型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2021 年 1 月 1 日至 2021 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、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

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

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和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负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金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，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的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。

对于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；对于应

收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：

- (1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- (2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- (3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，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金融工具价格的重大事件，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

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 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，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

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

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若基金份额持有人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，同一类别内的每一

基金份额享有同等分配权。

经公告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期间无需说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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]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《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《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》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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，股票的股息、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) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适

用比例计算缴纳。

#### 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 2021年6月30日
活期存款	1,223,220.69
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	1,223,220.69

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	25,048,268.16	24,667,931.90	-380,336.26
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	25,048,268.16	24,667,931.90	-380,336.26

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末，本基金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

本报告期末，本基金未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	583.49
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	11.00
合计	594.49

#### 6.4.7.6 其他资产

本报告期末，本基金无其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

本报告期末，本基金无应付交易费用。

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	14,876.71
合计	14,876.71

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

兴华永兴混合发起式 A		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	12,030,502.49	12,030,502.49
本期申购	11,030,271.39	11,030,271.39
本期赎回(以“-”号填列)	-1,124,108.10	-1,124,108.10
本期末	21,936,665.78	21,936,665.78

金额单位：人民币元

兴华永兴混合发起式 C		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	235,934.20	235,934.20
本期申购	1,356,098.69	1,356,098.69
本期赎回(以“-”号填列)	-818,280.88	-818,280.88
本期末	773,752.01	773,752.01

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

兴华永兴混合发起式 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-12,095.34	153,622.58	141,527.24
本期利润	3,255,640.58	-518,223.48	2,737,417.10
本期基金份额交易产生的变动数	560,291.47	-199,462.57	360,828.90
其中：基金申购款	670,901.38	-219,892.07	451,009.31
基金赎回款	-110,609.91	20,429.50	-90,180.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,803,836.71	-564,063.47	3,239,773.24

单位：人民币元

兴华永兴混合发起式 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-275.68	3,012.14	2,736.46
本期利润	100,275.60	-18,747.50	81,528.10
本期基金份额交易产生的变动数	32,241.71	-4,145.79	28,095.92
其中：基金申购款	105,570.96	-24,575.16	80,995.80

基金赎回款	-73,329.25	20,429.37	-52,899.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	132,241.63	-19,881.15	112,360.48

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日 至2021年6月30日
活期存款利息收入	6,987.55
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	403.45
合计	7,391.00

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日 至2021年6月30日
卖出股票成交总额	22,946,615.85
减：卖出股票成本总额	19,487,387.81
买卖股票差价收入	3,459,228.04

#### 6.4.7.13 债券投资收益

本报告期，本基金无债券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本报告期，本基金无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本报告期，本基金无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日 至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	115,482.85
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	115,482.85

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日 至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-536,970.98
——股票投资	-536,970.98
——债券投资	-
——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	-536,970.98

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日 至2021年6月30日
基金赎回费收入	8,096.22
合计	8,096.22

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	51,332.48
银行间市场交易费用	-
合计	51,332.48

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	14,876.71
信息披露费	-
证券出借违约金	-
其他	-
合计	14,876.71

#### 6.4.7.21 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的重大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没有发生变化。

##### 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
兴华基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
招商证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
张磊	基金管理人的股东

韩光华	基金管理人的股东
-----	----------

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金成立于 2020 年 12 月 16 日，因此无上年度可比期间数据。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
招商证券股份有限公司	56,070,036.54	100.00%

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本报告期，本基金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

本报告期，本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 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 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
招商证券股份有限公司	190,000.00	100.00%

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的 比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总 额的比例

招商证券 股份有限 公司	23,416.26	100.00%	0.00	0.00%
--------------------	-----------	---------	------	-------

#### 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 2021年1月1日 至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	143,061.16
其中：支付销售机构的客户维护费	9,502.68

注：(1) 支付基金管理人兴华基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

(2) 客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日 至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	23,843.50

注：支付基金托管人招商证券的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴华永兴混合发起式 A	兴华永兴混合发起式 C	合计
兴华基金管理有 限公司	-	364.37	364.37
合计	-	364.37	364.37

注：(1)本基金 C 类基金份额销售服务费年费率为 0.4%，每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日 C 类基金销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 × 0.4% / 当年天数。

(2)本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。

#### 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

本报告期，本基金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

本报告期内，本基金未与关联方进行转融通证券出借业务。

#### 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 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 6 月 30 日	
	兴华永兴混合发起式 A	兴华永兴混合发起式 C
基金合同生效日（2020 年 12 月 16 日）持有的基金份额	10,001,800.18	-
报告期初持有的基金份额	10,001,800.18	-
报告期间申购/买入总份额	9,631,224.42	-
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	19,633,024.60	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	89.50%	-

##### 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

份额单位：份

兴华永兴混合发起式 A				
关联方名称	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
韩光华	10,992.67	0.05%	9,989.45	0.08%
张磊	1,977.44	0.01%	998.98	0.01%

#### 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
招商证券股份有限公司	1,223,220.69	6,987.55

注：本基金的活期银行存款由基金托管人招商证券股份有限公司保管，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

本报告期内，本基金没有在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本报告期内，本基金未实施利润分配。

#### 6.4.12 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

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

本报告期末，本基金未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本报告期末，本基金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

本报告期末，本基金无银行间市场债券正回购。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末，本基金无交易所市场债券正回购。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本报告期末，本基金无转融通证券出借业务余额。

## 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

本基金为偏股混合型基金，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。本基金投资的金融工具主要为股票投资。本基金在日常经营活动中面临的相关风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在科学的风险管理的前提下，实现基金财产的安全和增值。

本基金管理人通过建立行之有效的风险管理体系和风险管理制度，充分揭示各类风险，并采取有效措施将风险管理控制在合理水平，保证基金投资业务稳健运行，保障公司发展战略和经营目标得以实现。公司的风险管理体系由公司董事会、监事、风险控制委员会、经营管理层、风险管理委员会、督察长、监察稽核部共同组成，形成高效运转、有效制衡的监督约束机制，保证风险管理的贯彻执行。

公司的各个部门作为各项工作的执行者，是所在部门风险的防范者，各部门风险管理的第一责任人，履行一线风险管理职能。各业务部门均备有符合法律法规、公司政策的业务流程，其中包含与其业务相关的风险控制措施、风险管理计划、工作流程和管理责任。这些流程均得到公司管理层的批准。

为保障风险管理体系的持续性和有效性，保证风险管理目标得到全面实现，公司制定了可操作的风险管理程序，包括：风险识别、风险评估、风险报告、风险控制等环节。公司定期对风险、风险控制措施及执行情况进行总结，不断提高防范和化解各项风险的能力，不断完善各项内部控制措施，提高风险控制水平。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险可能产生的损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存

款存放在本基金的托管人招商证券开立于招商银行股份有限公司的托管账户，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券投资和资产支持证券投资。

### 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。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，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

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的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，不得超过该上市公司可流通股票的 30% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2021 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 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未来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。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整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和存出保证金。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,223,220.69	-	-	-	1,223,220.69
存出保证金	211,538.04	-	-	-	211,538.04
交易性金融资产	-	-	-	24,667,931.90	24,667,931.90
应收利息	-	-	-	594.49	594.49
应收申购款	-	-	-	31,941.17	31,941.17
资产总计	1,434,758.73	-	-	24,700,467.56	26,135,226.29
负债					
应付赎回款	-	-	-	20,453.76	20,453.76
应付管理人报酬	-	-	-	31,750.78	31,750.78
应付托管费	-	-	-	5,291.80	5,291.80
应付销售服务费	-	-	-	301.73	301.73
其他负债	-	-	-	14,876.71	14,876.71
负债总计	-	-	-	72,674.78	72,674.78
利率敏感度缺口	1,434,758.73	-	-	24,627,792.78	26,062,551.51
上年度末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	676,600.10	-	-	-	676,600.10
存出保证金	173,637.52	-	-	-	173,637.52
交易性金融资产	-	-	-	11,568,870.00	11,568,870.00
应收利息	-	-	-	389.24	389.24
资产总计	850,237.62	-	-	11,569,259.24	12,419,496.86
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	7,506.84	7,506.84
应付托管费	-	-	-	1,251.14	1,251.14
应付销售服务费	-	-	-	38.49	38.49
负债总计	-	-	-	8,796.47	8,796.47
利率敏感度缺口	850,237.62	-	-	11,560,462.77	12,410,700.39

#### 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

其他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，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的 60-95%，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。本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	24,667,931.90	94.65	11,568,870.00	93.22
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	24,667,931.90	94.65	11,568,870.00	93.22

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
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(2021年6月30日)	上年度末(2020年12月31日)
	业绩比较基准上	1,242,532.06	606,935.31

	升 500 基点		
	业绩比较基准下 降 500 基点	-1, 242, 532. 06	-606, 935. 31

#### 6. 4. 14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 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。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 24, 667, 931. 90 元，无属于第二层次的余额，无属于第三层次的余额。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

##### (d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	24,667,931.90	94.39
	其中：股票	24,667,931.90	94.39
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	1,223,220.69	4.68
8	其他各项资产	244,073.70	0.93
9	合计	26,135,226.29	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	16,824,541.90	64.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	677,000.00	2.60
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,145,660.00	19.74
J	金融业	-	-
K	房地产业	285,720.00	1.10
L	租赁和商务服务业	1,082,150.00	4.15
M	科学研究和技术服务业	652,860.00	2.50
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-

S	综合	-	-
	合计	24,667,931.90	94.65

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通标的股票。

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002422	科伦药业	78,000	1,556,100.00	5.97
2	000921	海信家电	90,000	1,293,300.00	4.96
3	000513	丽珠集团	24,000	1,200,480.00	4.61
4	300122	智飞生物	6,200	1,157,726.00	4.44
5	002653	海思科	52,000	1,119,040.00	4.29
6	000739	普洛药业	38,000	1,117,200.00	4.29
7	000066	中国长城	76,000	1,109,600.00	4.26
8	002027	分众传媒	115,000	1,082,150.00	4.15
9	002439	启明星辰	34,000	986,340.00	3.78
10	002368	太极股份	49,000	982,940.00	3.77
11	603158	腾龙股份	83,000	971,100.00	3.73
12	000100	TCL 科技	120,000	918,000.00	3.52
13	300379	东方通	32,000	911,680.00	3.50
14	002979	雷赛智能	30,000	860,100.00	3.30
15	002241	歌尔股份	20,000	854,800.00	3.28
16	300383	光环新网	50,000	719,500.00	2.76
17	300003	乐普医疗	22,000	706,640.00	2.71
18	002352	顺丰控股	10,000	677,000.00	2.60
19	600703	三安光电	21,000	673,050.00	2.58
20	300682	朗新科技	40,000	672,800.00	2.58
21	002465	海格通信	70,000	662,200.00	2.54
22	603859	能科股份	18,000	652,860.00	2.50
23	600496	精工钢构	120,000	489,600.00	1.88
24	002126	银轮股份	45,000	468,000.00	1.80
25	688106	金宏气体	16,000	432,480.00	1.66
26	002938	鹏鼎控股	12,000	430,560.00	1.65
27	600584	长电科技	10,000	376,800.00	1.45
28	300770	新媒股份	7,000	340,900.00	1.31
29	000002	万科 A	12,000	285,720.00	1.10
30	300578	会畅通讯	10,000	284,300.00	1.09
31	002675	东诚药业	11,995	252,734.65	0.97

32	300166	东方国信	20,000	247,200.00	0.95
33	300502	新易盛	5,601	175,031.25	0.67

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300122	智飞生物	2,071,658.00	16.69
2	000921	海信家电	1,344,299.00	10.83
3	002653	海思科	1,328,439.00	10.70
4	000066	中国长城	1,228,859.00	9.90
5	002979	雷赛智能	1,162,774.00	9.37
6	002027	分众传媒	1,136,420.00	9.16
7	000513	丽珠集团	1,129,218.00	9.10
8	000739	普洛药业	1,100,076.00	8.86
9	603158	腾龙股份	1,086,327.00	8.75
10	002422	科伦药业	1,079,828.00	8.70
11	002368	太极股份	1,057,423.00	8.52
12	300003	乐普医疗	1,008,161.50	8.12
13	300379	东方通	1,007,850.00	8.12
14	300014	亿纬锂能	973,758.00	7.85
15	000100	TCL 科技	928,318.00	7.48
16	000858	五粮液	909,219.00	7.33
17	002352	顺丰控股	896,755.00	7.23
18	002241	歌尔股份	809,594.00	6.52
19	600703	三安光电	808,560.00	6.52
20	688037	芯源微	782,755.27	6.31
21	603233	大参林	755,627.92	6.09
22	002439	启明星辰	737,463.00	5.94
23	002465	海格通信	695,898.00	5.61
24	300059	东方财富	638,050.00	5.14
25	600496	精工钢构	627,300.00	5.05
26	600584	长电科技	550,850.00	4.44
27	300776	帝尔激光	542,203.00	4.37
28	688106	金宏气体	504,065.14	4.06
29	300274	阳光电源	473,969.00	3.82
30	300383	光环新网	423,210.00	3.41
31	300487	蓝晓科技	412,492.00	3.32
32	300770	新媒股份	386,999.00	3.12
33	603859	能科股份	375,379.00	3.02

34	688298	东方生物	354,553.84	2.86
35	002531	天顺风能	344,800.00	2.78
36	000002	万科 A	331,480.00	2.67
37	300682	朗新科技	297,559.00	2.40
38	002810	山东赫达	265,757.00	2.14
39	300601	康泰生物	264,500.00	2.13

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	688037	芯源微	1,314,924.31	10.60
2	300014	亿纬锂能	1,256,163.00	10.12
3	002810	山东赫达	1,231,589.60	9.92
4	300122	智飞生物	1,221,195.13	9.84
5	300776	帝尔激光	1,127,825.00	9.09
6	000858	五粮液	1,079,155.00	8.70
7	688300	联瑞新材	846,725.13	6.82
8	300059	东方财富	823,890.00	6.64
9	603233	大参林	818,562.80	6.60
10	600703	三安光电	739,310.00	5.96
11	000513	丽珠集团	702,264.00	5.66
12	300274	阳光电源	640,586.00	5.16
13	002531	天顺风能	634,956.00	5.12
14	603987	康德莱	579,473.00	4.67
15	002698	博实股份	565,093.50	4.55
16	300413	芒果超媒	557,055.00	4.49
17	000100	TCL 科技	531,130.00	4.28
18	002352	顺丰控股	519,868.00	4.19
19	002080	中材科技	511,278.00	4.12
20	300487	蓝晓科技	501,250.00	4.04
21	601628	中国人寿	489,624.00	3.95
22	002475	立讯精密	464,160.00	3.74
23	300166	东方国信	443,070.00	3.57
24	601318	中国平安	432,157.00	3.48
25	600529	山东药玻	386,522.00	3.11
26	688298	东方生物	368,522.54	2.97
27	300379	东方通	328,259.23	2.64
28	300003	乐普医疗	308,497.52	2.49
29	002979	雷赛智能	307,082.00	2.47
30	300502	新易盛	270,020.00	2.18

31	300601	康泰生物	268,000.00	2.16
32	002653	海思科	264,780.00	2.13

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	33,123,420.69
卖出股票收入（成交）总额	22,946,615.85

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 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

本基金本报告期末未持有债券。

### 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未参与股指期货投资。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未参与国债期货投资。

### 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本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内本基金投资的海思科(002653)在本报告编制日前一年内因在公司治理方面、信息披露方面存在违规问题，被中国证券监督管理委员会西藏证监局采取出具警示函的行政监管措施。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和他分析，认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响，因此本基金管理人对上述证券的投资判断未发生变化。

本基金投资上述主体相关证券的决策流程符合公司投资制度的规定。

本基金投资的其余前九名证券的发行主体本期未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。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票未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	211,538.04
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	594.49
5	应收申购款	31,941.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	244,073.70

### 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

## § 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

份额类别	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

兴华 永兴 混合 发起 式 A	185	118,576.57	19,633,024.60	89.50%	2,303,641.18	10.50%
兴华 永兴 混合 发起 式 C	138	5,606.90	-	-	773,752.01	100.00%
合计	323	70,310.89	19,633,024.60	86.45%	3,077,393.19	13.55%

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额类别	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	兴华永兴混合发起式 A	1,378,148.53	6.2824%
	兴华永兴混合发起式 C	52,273.92	6.7559%
	合计	1,430,422.45	6.2985%

## 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的情况

项目	份额类别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、 基金投资和部门负 责人持有本开放式基金	兴华永兴混合发起式 A	0~10
	兴华永兴混合发起式 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本 开放式基金	兴华永兴混合发起式 A	0
	兴华永兴混合发起式 C	0
	合计	0

## 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额 占基金总 份额比例	发起份额总数	发起份额 占基金总 份额比例	发起份额 承诺持有 期限
基金管理人固有资金	19,633,024.60	86.45%	10,001,800.18	44.04%	3 年
基金管理人高级管理人员	65,248.82	0.29%	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	22,710,417.79	86.74%	10,001,800.18	44.04%	3 年

注：本基金发起式资金提供方仅为基金管理人固有资金，基金管理人高级管理人员的基金份额不属

于发起份额。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	兴华永兴混合发起式 A	兴华永兴混合发起式 C
基金合同生效日（2020 年 12 月 16 日）基金份额总额	12,030,502.49	235,934.20
本报告期期初基金份额总额	12,030,502.49	235,934.20
本报告期基金总申购份额	11,030,271.39	1,356,098.69
减：本报告期基金总赎回份额	1,124,108.10	818,280.88
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	21,936,665.78	773,752.01

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，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

本报告期内本基金管理人无重大人事变动。

2021 年 5 月 4 日，本基金托管人招商证券股份有限公司聘牛中强、张志斌任托管部副总经理。

### 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、公募基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务，无改聘情况。

### 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

本报告期内，本基金的管理人、托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券股份有限公司	2	56,070,036.54	100.00%	23,416.26	100.00%	-

注：1、报告期内未新增或退租证券公司交易单元。

2、本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

3、基金交易单元的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券股份有限公司	-	-	190,000.00	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	兴华基金管理有限公司关于兴华永兴混合型发起式证券投资基金投资科创板上市股票及相关风险揭示的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 1 月 8 日
2	兴华永兴混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定投业务的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 1 月 15 日
3	兴华基金管理有限公司关于在直销柜台、直销网上交易(含微信交易)渠道开展费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 1 月 18 日
4	兴华基金管理有限公司关于调整直销网上交易(含微信交易)单笔认(申)购、定投申请最低金额的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 1 月 19 日
5	兴华基金管理有限公司关于设立北京分公司的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 2 月 22 日
6	兴华基金管理有限公司关于使用固有资金投资公司旗下基金的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 3 月 6 日
7	兴华基金管理有限公司关于使用固有资金投资公司旗下基金的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 3 月 9 日
8	兴华基金管理有限公司关于使用固有资金投资公司旗下基金的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 4 月 1 日
9	兴华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增京东肯特瑞基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 4 月 8 日
10	兴华基金管理有限公司关于使用固有资金投资公司旗下基金的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 4 月 10 日
11	兴华永兴混合型发起式证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2021 年 4 月 16 日
12	兴华基金管理有限公司旗下部分基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定媒介	2021 年 4 月 16 日
13	兴华基金管理有限公司关于北京分公司负责人变更的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 4 月 17 日
14	兴华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华鑫证券有限责任公司为销售机构的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 4 月 29 日
15	兴华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增浙江同花顺基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 5 月 26 日
16	兴华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增蚂蚁(杭州)基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 6 月 2 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	1	2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日	10,001,800.18	9,631,224.42	0.00	19,633,024.60	86.45%
个人	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

##### 1、净值大幅波动的风险

由于本基金份额净值的计算保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。因此该机构投资者大额赎回时，有可能导致基金份额净值大幅波动，剩余的持有人存在大幅亏损的风险。

##### 2、出现巨额赎回的风险

该机构投资者在开放日大额赎回时可能导致本基金发生巨额赎回，当基金出现巨额赎回时，根据基金当时资产组合状况，基金管理人有可能对部分赎回申请延期办理或对已确认的赎回进行部分延期支付。其他投资者的赎回申请也可能同时面临部分延期办理的风险或对已确认的赎回进行部分延期支付的风险。当连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，本基金管理人有可能暂停接受赎回申请，已接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日。投资者可能面临赎回申请无法确认或者无法及时收到赎回款项的风险。

##### 3、基金规模过小的风险

根据基金合同的约定，基金合同生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案。机构投资者在开放日大额赎回后，可能出现本基金的基金资产净值连续 60 个工作日低于 5,000 万元情形。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、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
- 2、《兴华永兴混合型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《兴华永兴混合型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 5、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 6、中国证监会规定的其他文件

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 12.3 查阅方式

投资者可以在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

兴华基金管理有限公司

2021 年 8 月 30 日