

# 兴华瑞丰混合型证券投资基金

## 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 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：2022 年 3 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 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。

本报告中的财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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>6</b>
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	12
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.9 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	17
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	17
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	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	18
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>18</b>
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>20</b>
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	21

7.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	22
7.4 报表附注 .....	24
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>52</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	52
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	52
8.3 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 .....	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	53
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	55
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	55
8.7 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 .....	55
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	55
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	55
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	56
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	56
8.12 投资组合报告附注 .....	56
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>57</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	57
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	57
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	57
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>58</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b> .....	<b>58</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	58
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	58
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	58
11.4 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	59
11.5 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	59
11.6 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	59
11.7 其他重大事件 .....	60
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>62</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	62
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	63
<b>§ 13 备查文件目录</b> .....	<b>63</b>
13.1 备查文件目录 .....	63
13.2 存放地点 .....	63

13.3 查阅方式 ..... 63

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	兴华瑞丰混合型证券投资基金	
基金简称	兴华瑞丰混合	
基金主代码	010999	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 12 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	
报告期末基金份额总额	6,536,693.53 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分类基金的基金简称	兴华瑞丰混合 A	兴华瑞丰混合 C
下属分类基金的交易代码	010999	011000
报告期末下属分类基金的份额总额	1,415,370.87 份	5,121,322.66 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的投资管理，把握不同时期股票市场和债券市场的投资机会，力争超越业绩比较基准，追求资产净值的长期稳健增值。
投资策略	本基金将采取自上而下的投资策略对各种投资工具进行合理的配置。在风险与收益的匹配方面，力求将信用风险降到最低，并在良好控制利率风险与市场风险的基础上为投资者获取稳定的收益。
业绩比较基准	中债综合指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，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	400-067-8815	0755-82943666
	电子邮箱	wanghaibin@xinghuafund.com.cn	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		400-067-8815	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 号楼 8 层	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
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	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.xinghuafund.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年		2020 年 12 月 30 日(基金合同生效日)-2020 年 12 月 31 日	
	兴华瑞丰混合 A	兴华瑞丰混合 C	兴华瑞丰混合 A	兴华瑞丰混合 C
本期已实现收益	63,077.94	377,350.84	172.88	11,558.80
本期利润	55,297.96	453,392.49	172.88	11,558.80
加权平均基金份额本期利润	0.0299	0.0129	0.0001	0.0001
本期加权平均净值利润率	2.95%	1.28%	0.01%	0.01%
本期基金份额净值增长率	3.53%	3.11%	0.01%	0.01%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末		2020 年末	
期末可供分配利润	32,653.39	96,831.19	172.88	11,558.80

期末可供分配基金份额利润	0.0231	0.0189	0.0001	0.0001
期末基金资产净值	1,465,494.57	5,280,984.74	2,523,037.23	200,704,747.78
期末基金份额净值	1.0354	1.0312	1.0001	1.0001
3.1.3 累计期末指标	2021 年末		2020 年末	
基金份额累计净值增长率	3.54%	3.12%	0.01%	0.01%

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。表中的“期末”均指报告期最后一个自然日，即 12 月 31 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日；

4、本基金合同于 2020 年 12 月 30 日生效，截止本报告期末，本基金成立未满两年，无前年同期可比数据，因此 3.1 主要会计数据和财务指标只列示本期及上期数据。

## 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

兴华瑞丰混合 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	3.78%	0.40%	-0.51%	0.24%	4.29%	0.16%
过去六个月	1.81%	0.36%	-0.16%	0.22%	1.97%	0.14%
过去一年	3.53%	0.33%	0.56%	0.22%	2.97%	0.11%
自基金合同生效起至今	3.54%	0.33%	1.20%	0.22%	2.34%	0.11%

兴华瑞丰混合 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	3.67%	0.40%	-0.51%	0.24%	4.18%	0.16%
过去六个月	1.60%	0.36%	-0.16%	0.22%	1.76%	0.14%
过去一年	3.11%	0.33%	0.56%	0.22%	2.55%	0.11%
自基金合同	3.12%	0.33%	1.20%	0.22%	1.92%	0.11%



生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

注：1. 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；

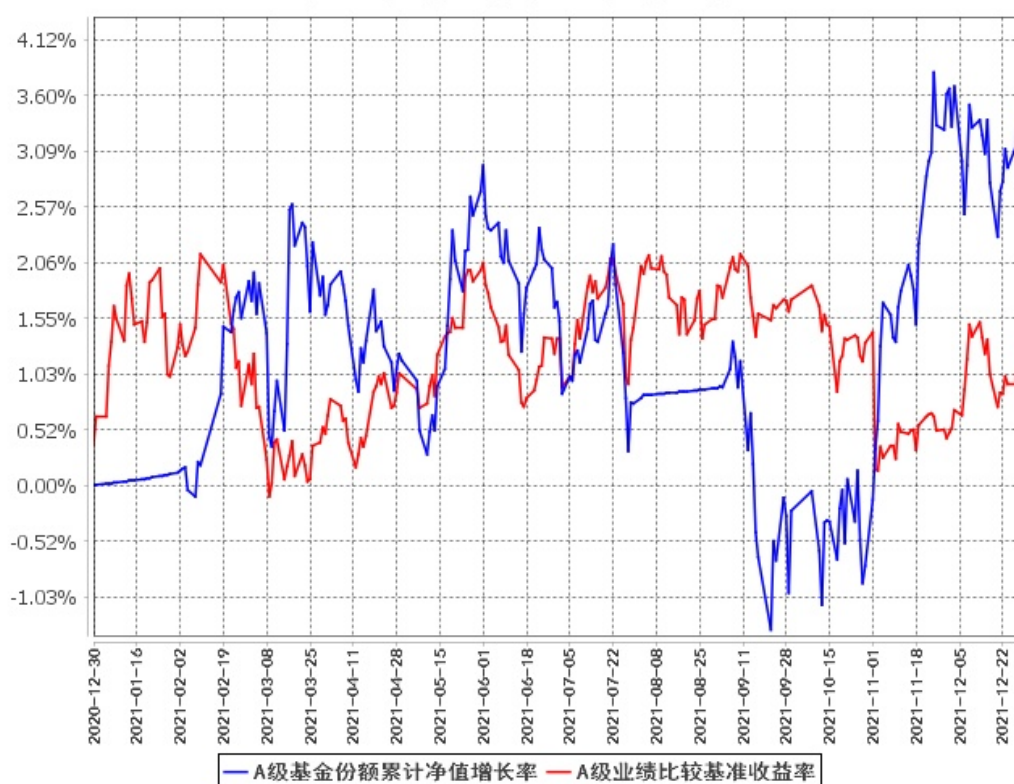
2. 本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

本基金的业绩比较基准： $\text{中债综合指数收益率} \times 80\% + \text{沪深 300 指数收益率} \times 20\%$

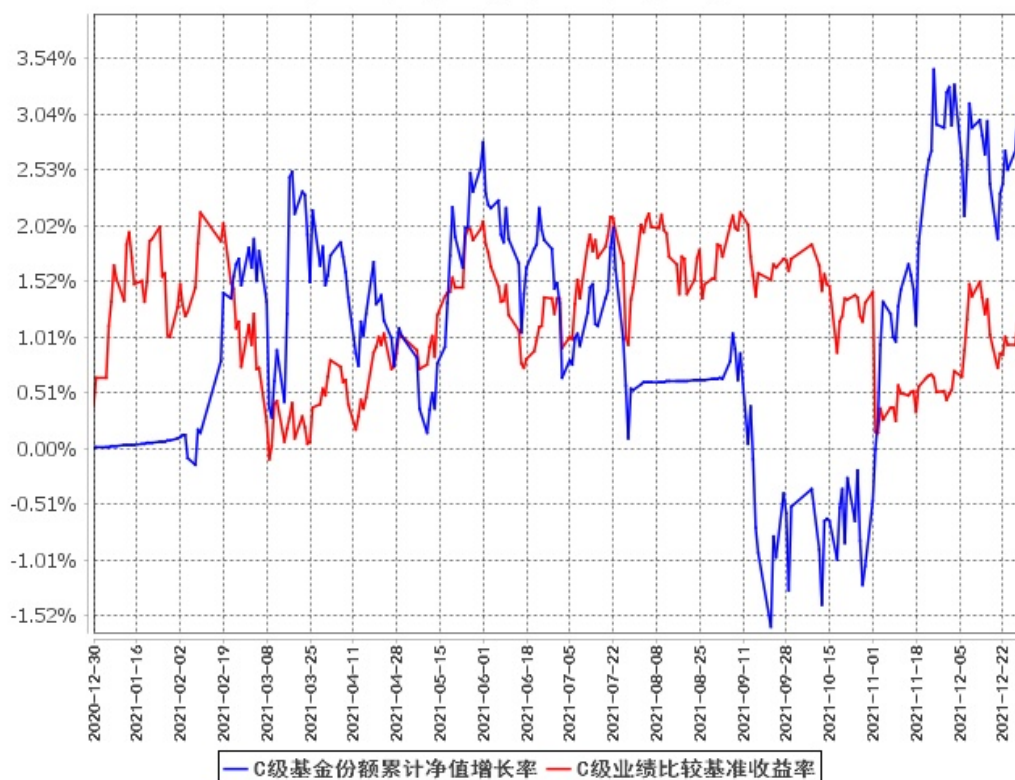
中债综合指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的具有代表性的债券市场指数。沪深 300 指数作为按流通股本加权的跨两市蓝筹股指数，其指数样本股市值覆盖了上交所和深交所上市的所有股票市值的 70%，具有较强的代表意义。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数中中国债券综合指数和沪深 300 指数每日分别计算收益率，然后按 80%、20% 的比例采取再平衡，再用循环计算的方式得到基准指数的时间序列。

### 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

**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 30 日至 2021 年 12 月 31 日)



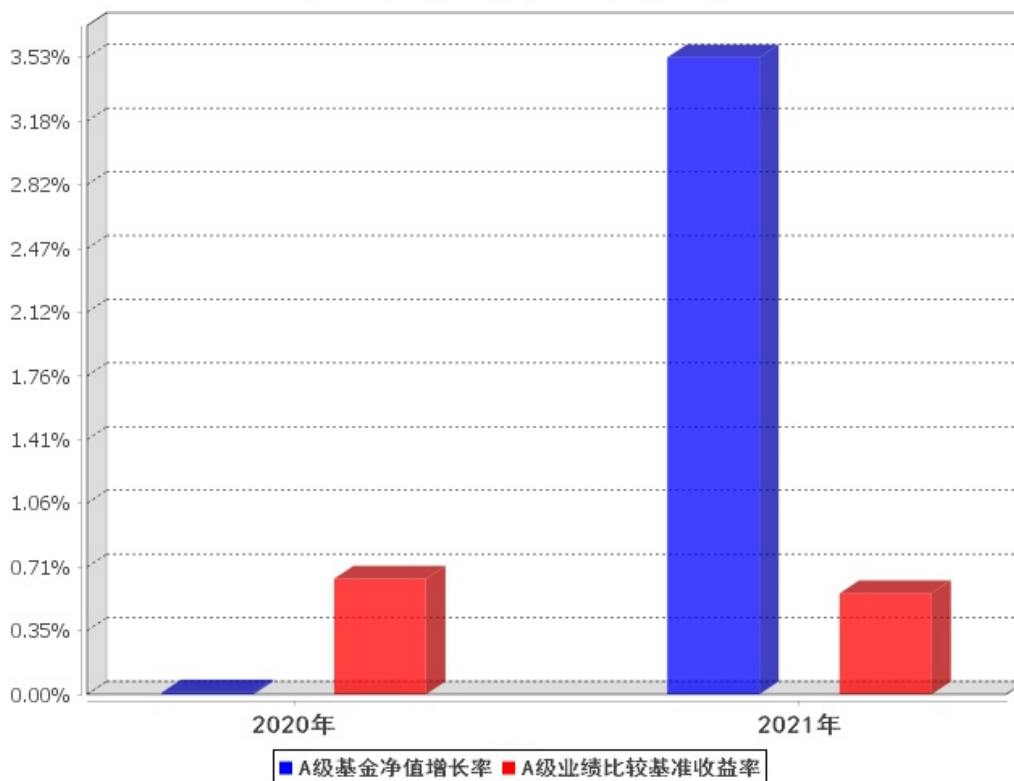
**C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图**  
(2020年12月30日至2021年12月31日)



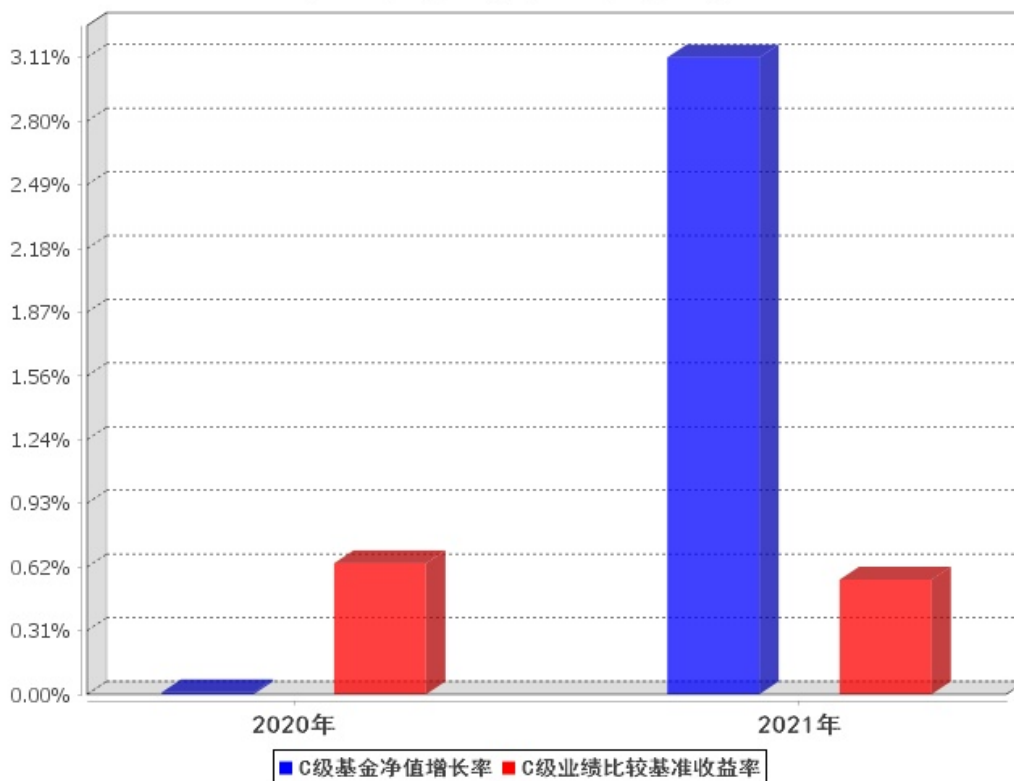
- 注：1. 本基金合同于 2020 年 12 月 30 日生效，截至本报告期末，本基金合同生效已满一年；
2. 按基金合同规定，本基金的建仓期为自基金合同生效之日起 6 个月。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合本基金合同的有关规定。
3. 自 2021 年 11 月 2 日起，变更注册后的《兴华瑞丰混合型证券投资基金基金合同》生效，基金合同变更内容主要包括修改投资范围、投资组合比例、投资策略、投资限制、业绩比较基准、估值对象及估值方法，并增加公开披露的基金信息等。

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

**A级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图**  
(2020年12月30日至2021年12月31日)



**C级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图**  
(2020年12月30日至2021年12月31日)



注：本基金合同于 2020 年 12 月 30 日生效，合同生效当年相关数据和指标按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

兴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 12 月 31 日，本基金管理人共管理 5 只公募基金，分别为：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、兴华安盈一年期定期开放债券型发起式证券投资基金、兴华安恒纯债债券型证券投资基金、兴华创新医疗 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金。

#### 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 30 日	-	15 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总经理。
吕智卓	基金经理	2020 年 12 月 30 日	-	9 年	吕智卓先生，中国国籍，澳大利亚西悉尼大学金融学

					<p>硕士，具有基金从业资格。曾先后就职于天弘基金管理有限公司中央交易室专户交易员，上海久期投资有限公司交易管理部历任交易主管。现任兴华基金管理有限公司固定收益部总经理助理。</p>
--	--	--	--	--	---

注：1. 上述任职日期和离职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

本报告期末，本基金未发生基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人已根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，建立了科学完善的公平交易管理制度，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能发生的利益输送，确保管理的不同受托资产得到公平对待，保护投资者合法权益。股票投资部和投资研究部通过规范的决策流程公平对待不同投资组合。交易管理部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，对于场内交易的非组合指令启用投资管理系统中的公平交易模块；对于场外交易按照时间优先价格优先的原则公平对待不同帐户。监察稽核部风险管理岗对报告期内的交易进行日常监控和分析评估，同时对投资组合的交易价差在不同时间窗(如日内、3日、5日)下进行分析，综合判断各基金之间是否存在不公平交易或利益输送的可能，确保公平交易的实施。

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人已根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度规定，建立并健全了有效的公平交易执行体系，保证公平对待旗下的每一个基金组合。

在具体执行中，在投资决策流程上，构建统一的研究平台，为所有投资组合公平的提供研究支持。同时，在投资决策过程中，严格遵守公司的各项投资管理制度和投资授权制度，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序。在交易执行环节上，详细规定了面对多个投资组合的投资指令的交易执行的流程和规定，以保证投资执行交易过程的公平性；从事后监控角度上，一方面是定期对股票、债券交易情况进行分析，对不同时间窗口(同日，3日和5日)发生的不同组合对同一投资标的的同向交易及反向交易进行价差分析，并进行统计显著性的检验，以确定交易价差对相关基金的业绩差异的贡献度；同时对下投资组合及其各投资类别的收益率差异的分析；另一方面是公司公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期检查，并对发现的问题进行及时的报告。本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，能够公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内不存在异常交易行为。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

股票投资方面，2021 年，市场总体表现为区间震荡行情，波动有所加大，并由流动性驱动向业绩驱动转变，风格分化程度有所改善，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。本基金股票投资组合注重风险收益均衡，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，并参考绝对收益思路，灵活选择调仓时机以及择机锁定盈利，组合业绩相对市场表现稳健。

固定收益投资方面，本基金在 2021 年以利率债策略为主，以现金管理策略为辅。

投资运作回顾：

1、收益率曲线策略：根据市场流动性松紧的变化和对货币政策的解读和预判，根据期限利差选择“做平收益率曲线”或“做陡收益率曲线”策略。上半年通过拉长组合久期，配置 10 年期国债、政金债活跃券做波段交易；下半年当收益率曲线逐渐平坦化后，逐渐缩短久期，配置 1-5 年国债、政金债活跃券做趋势性交易。

2、杠杆增强策略：当拆借市场的资金价格低于中枢水平时，通过质押融资提高组合的杠杆率进行波段交易，增厚

组合的整体收益率。

3、现金管理策略：当季末、年末市场流动性收紧时，会用 20%-30%的仓位开展逆回购和同业存款业务。

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瑞丰混合 A 的基金份额净值为 1.0354 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.53%；截至本报告期末兴华瑞丰混合 C 的基金份额净值为 1.0312 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.11%；同期业绩比较基准收益率为 0.56%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望国内股票市场，短期来看，市场核心聚焦稳增长，公司盈利速度可能放缓，未来增长面临更大压力，但经济下行风险担忧下，降准、降息等宽货币、宽信用政策有望逐步落地，不过商品价格上涨导致的潜在通胀可能对宽松货币政策形成一定制约。

中长期来看，市场盈利驱动特征未变，高景气行业以及盈利保持较快增长且估值相对合理的板块及个股仍将得到市场资金的青睐，需要注意的是，产业政策导向持续展现较强市场影响力，需加强预判并做好组合调整优化，以更好地把握投资机会。此外，新冠疫情以及中美关系仍面临较大不确定性，可能对市场情绪形成较大扰动。

1、宏观经济展望：房地产投资下行压力仍存；基建投资作为稳增长的主要抓手，有望出现边际改善；出口预计保持较强韧性，但在美国货币政策转向和高基数效应下或将环比回落；消费难以出现明显改善；通胀压力整体可控，预计 PPI 持续回落，CPI 温和反弹。展望 2022 年，经济下行压力增大，但在“稳增长”的经济诉求下，政策面预计加强、加快发力，经济增速触底反弹，但反弹的高度有限。全年 GDP 增速预计落在 5.00%-5.30%的区间内。

2、债市的预判：上半年货币政策稳中偏松支撑债市走强，宽信用政策逐渐奏效和美联储加息预期提前对债市形成扰动性，长端利率在 1 月至 2 月磨底、3 月至 5 月回调（V 字型）。下半年中国经济企稳回升的概率较大，收益率上行压力增大。但考虑到地产、城投债务严监管的约束，传统行业对经济基本面“托而不举”；叠加经济转型期需要低息环境呵护，预计长端利率回调的幅度有限，利率见顶后债市在四季度将呈现震荡行情。全年看债券利率呈现出“W”型的走势，收益率曲线逐渐“陡峭化”。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2021 年度，本基金管理人在为基金份额持有人谋求最大利益的同时，始终将合规运作、防范风

险工作放在各项工作的首位。依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察稽核部按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1) 全面开展基金运作合规监察工作，确保基金投资的独立性、公平性及合法合规

主要措施有：严格执行集中交易制度，各基金相互独立，交易指令由中央交易室统一执行完成；对基金投资交易系统的事先合规性设置，并由监察稽核部风险管理岗进行实时监控，杜绝出现违规行为；严格检查基金的投资决策、研究支持、交易过程是否符合规定的程序；通过以上措施，保证了投资运作遵循投资决策程序与业务流程，保证了基金投资组合符合相关法规及基金合同规定，确保了基金投资行为的独立、公平及合法合规。

(2) 开展定期和专项监察稽核工作，确保各项业务活动的合法合规

本年度公司监察稽核部开展了对公司基金投资、研究、销售、后台运营、反洗钱等方面的专项监察稽核活动。对稽核中发现问题及时发出合规提示函，要求相关部门限期整改，并对改进情况安排后续跟踪检查，确保各项业务开展合法合规。

(3) 促进公司各项内部管理制度的完善

按照相关法规、证监会等监管机关的相关规定和公司业务的发展的要求，公司监察稽核部及时要求各部门制订或修改相应制度，促进公司各项内部管理制度的进一步完善。

(4) 通过各种合规培训提高员工合规意识

本年度公司监察稽核部通过对公司所有新入职员工进行入职前合规培训、对全体人员开展行为规范培训、对基金投资管理人员进行专项合规培训、对员工进行反洗钱培训等，有效提高了公司员工的合规意识。

通过以上工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生违规情形，基金运作整体合法合规。在今后的工作中，本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，以风险防范为核心，切实保障基金安全、合规运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、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。

本基金管理人设有产品估值委员会，产品估值委员会由基金估值业务分管领导、督察长、基金估值核算负责人、基金会计、监察稽核部人员及相关投研人员等组成。在特殊情况下，公司召集产品估值委员会会议，讨论和决策特殊估值事项，产品估值委员会集体决策，需到会的三分之二产品估值委员会成员表决通过。产品估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理、投资经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行，一切以维护基金持有人利益为准则。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场债券品种的估值数据及交易所交易的债券品种的估值数据。

#### 4.8 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。

#### 4.9 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

截至本报告期末，本基金已出现连续六十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。本基金管理人已根据法律法规和基金合同的约定向中国证监会及其派出机构进行了报告。本基金于 2021 年 11 月 1 日召开了基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于兴华瑞丰混合型证券投资基金持续运作有关事项的议案》和《关于兴华瑞丰混合型证券投资基金变更投资范围有关事项的议案》。自 2021 年 11 月 1 日起，经基金份额持有人大会授权，公司将根据市场情况，持续开展本基金的营销工作。同时，本基金变更投资范围后，更有助于投资策略的多元化以及在目前震荡的市场行情下施行基金的投资思路并进行持续运作。基于以上原因，公司决定将继续坚持投资者利益最大化的原则，维持本基金的投资运作策略，积极开展持续营销，力争基金规模持续稳定增长，为投资者创造稳定的投资回报。

## § 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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人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 审计报告

## 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2022)第 24294 号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	兴华瑞丰混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了兴华瑞丰混合型证券投资基金(以下简称“兴华瑞丰混合基金”)的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日和 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度和 2020 年 12 月 30 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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，公允反映了兴华瑞丰混合基金 2021 年 12 月 31 日和 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度和 2020 年 12 月 30 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况</p>
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充

	<p>分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于兴华瑞丰混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>兴华瑞丰混合基金的基金管理人兴华基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估兴华瑞丰混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算兴华瑞丰混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督兴华瑞丰混合基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对兴华瑞丰混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致兴华瑞丰混合基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>

会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	单峰	沈俐
会计师事务所的地址	上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼	
审计报告日期	2022 年 3 月 29 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：兴华瑞丰混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	338,351.92	180,781,539.26
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	3,861,040.50	-
其中：股票投资		2,011,673.00	-
基金投资		-	-
债券投资		1,849,367.50	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	2,697,053.81	22,400,560.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	28,592.46	18,367.23
应收股利		-	-
应收申购款		799.70	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	33,954.07
资产总计		6,925,838.39	203,234,420.56
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,029.05	-
应付管理人报酬		3,411.28	3,331.56
应付托管费		1,137.09	1,110.52
应付销售服务费		1,781.66	2,193.47
应付交易费用	7.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	172,000.00	-
负债合计		179,359.08	6,635.55
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	6,536,693.53	203,216,053.33
未分配利润	7.4.7.10	209,785.78	11,731.68
所有者权益合计		6,746,479.31	203,227,785.01
负债和所有者权益总计		6,925,838.39	203,234,420.56

注：1. 报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额总额 6,536,693.53 份。其中兴华瑞丰混合型证券投资基金 A 类基金份额净值 1.0354 元，基金份额总额 1,415,370.87 份；兴华瑞丰混合型证券投资基金 C 类基金份额净值 1.0312 元，基金份额总额 5,121,322.66 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2021 年度和 2020 年 12 月 30 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间。

## 7.2 利润表

会计主体：兴华瑞丰混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 12 月 30 日(基金 合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		1,252,532.33	18,367.23
1. 利息收入		785,866.17	18,367.23
其中：存款利息收入	7.4.7.11	352,103.51	18,367.23
债券利息收入		143,376.66	-
资产支持证券 利息收入		-	-
买入返售金融		290,386.00	-

资产收入			
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		391,403.48	-
其中：股票投资收益	7.4.7.12	134,374.23	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	163,737.06	-
资产支持证券投资	7.4.7.13.3	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	93,292.19	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	68,261.67	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	7,001.01	-
<b>减：二、费用</b>		743,841.88	6,635.55
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	221,207.41	3,331.56
2. 托管费	7.4.10.2.2	73,735.79	1,110.52
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	139,910.30	2,193.47
4. 交易费用	7.4.7.19	70,990.43	-
5. 利息支出		11,597.95	-
其中：卖出回购金融			
资产支出		11,597.95	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.20	226,400.00	-
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		508,690.45	11,731.68
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		508,690.45	11,731.68

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴华瑞丰混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	203,216,053.33	11,731.68	203,227,785.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	508,690.45	508,690.45
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-196,679,359.80	-310,636.35	-196,989,996.15
其中：1. 基金申购款	46,076,097.70	263,933.72	46,340,031.42
2. 基金赎回款	-242,755,457.50	-574,570.07	-243,330,027.57
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	6,536,693.53	209,785.78	6,746,479.31
项目	上年度可比期间 2020 年 12 月 30 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	203,216,053.33	-	203,216,053.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	11,731.68	11,731.68
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	203,216,053.33	11,731.68	203,227,785.01

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

韩光华	何美劲	肖霜然
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

兴华瑞丰混合型证券投资基金(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”)证监许可[2020]3283 号《关于准予兴华瑞丰混合型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《兴华瑞丰混合型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募集人民币 203,182,099.26 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 1143 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《兴华瑞丰混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 12 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 203,216,053.33 份基金份额,其中认购资金利息折合 33,954.07 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(以下简称“招商证券”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《兴华瑞丰混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括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、证券公司短期公司债券、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)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:股票资产占基金资产的比例为 0-30%;本基金投资同业存单不超过基金资产的 20%;每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金保留现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中债综合指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×20%

本财务报表由本基金的基金管理人兴华基金管理有限公司于 2022 年 3 月 29 日批准报出。



## 7.4.2 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》、《兴华瑞丰混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定,开放式基金在基金合同生效后,连续 60 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,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2021 年 12 月 31 日,本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形,本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案,故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

## 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年度和 2020 年 12 月 30 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间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 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度和 2020 年 12 月 30 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2021 年度和 2020 年 12 月 30 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 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股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产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或资产支持证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；或者(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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 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)。

#### 7.4.4.9 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。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券

投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下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。

#### 7.4.4.10 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。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 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、债券投资和资产支持证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(可转换债券和可交换债券除外)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(可转换债券和可交换债券除外)，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。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第14号—收入》，本基金于2021年1月1日起执行。本基金在编制2021年度财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

##### 7.4.5.2 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。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

## 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	125,251.89	140,780,799.26
定期存款	-	40,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	40,000,000.00
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	213,100.03	740.00
合计	338,351.92	180,781,539.26

注：其他存款为本基金存放在开立于招商证券的证券账户内的存款。

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,944,877.74	2,011,673.00	66,795.26
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,847,901.09	1,849,367.50
	银行间市场	-	-
	合计	1,847,901.09	1,849,367.50
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	3,792,778.83	3,861,040.50	68,261.67
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	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	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	-	-	-

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	2,697,053.81	-
银行间市场	-	-
合计	2,697,053.81	-
项目	上年度末 2020年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	22,400,560.00	-
银行间市场	-	-
合计	22,400,560.00	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	167.25	15,478.33
应收定期存款利息	-	2,888.89
应收其他存款利息	13.69	0.01
应收结算备付金利息	-	-
应收债券利息	28,241.13	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	170.39	-
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	-	-
合计	28,592.46	18,367.23



## 7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
其他应收款	-	33,954.07
待摊费用	-	-
合计	-	33,954.07

注：本基金本报告期末无其他资产，上年度末其他资产为应收募集期利息。

## 7.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末及上年度末无应付交易费用。

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 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	172,000.00	-
合计	172,000.00	-

注：预提费用包括审计费、账户维护费、信息披露费。

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

兴华瑞丰混合 A		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,522,864.35	2,522,864.35
本期申购	962,772.63	962,772.63
本期赎回(以“-”号填列)	-2,070,266.11	-2,070,266.11
本期末	1,415,370.87	1,415,370.87

金额单位：人民币元

兴华瑞丰混合 C		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	200,693,188.98	200,693,188.98

本期申购	45,113,325.07	45,113,325.07
本期赎回(以“-”号填列)	-240,685,191.39	-240,685,191.39
本期末	5,121,322.66	5,121,322.66

注：1. 申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

2. 本基金自 2020 年 12 月 14 日至 2020 年 12 月 28 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 203,182,099.26 元。根据《兴华瑞丰混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 33,954.07 元在本基金成立后，折算为 33,954.07 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

3. 根据《兴华瑞丰混合型证券投资基金基金合同》、《兴华瑞丰混合型证券投资基金招募说明书》及《兴华瑞丰混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定投业务的公告》的相关规定，本基金于 2020 年 12 月 30 日(基金合同生效日)至 2021 年 1 月 31 日止期间暂不向投资人开放基金交易，申购、赎回及转换业务自 2021 年 2 月 1 日起开始办理。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

兴华瑞丰混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	172.88	-	172.88
本期利润	63,077.94	-7,779.98	55,297.96
本期基金份额交易产生的变动数	-30,597.43	25,250.29	-5,347.14
其中：基金申购款	17,115.11	4,837.54	21,952.65
基金赎回款	-47,712.54	20,412.75	-27,299.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	32,653.39	17,470.31	50,123.70

单位：人民币元

兴华瑞丰混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	11,558.80	-	11,558.80
本期利润	377,350.84	76,041.65	453,392.49
本期基金份额交易产生的变动数	-292,078.45	-13,210.76	-305,289.21
其中：基金申购款	183,716.32	58,264.75	241,981.07
基金赎回款	-475,794.77	-71,475.51	-547,270.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	96,831.19	62,830.89	159,662.08

## 7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2020年12月30日(基金合同生效 日) 至2020年12月31日
活期存款利息收入	196,130.65	15,478.33
定期存款利息收入	154,495.40	2,888.89
其他存款利息收入	1,477.46	0.01
结算备付金利息收入	-	-
其他	-	-
合计	352,103.51	18,367.23

## 7.4.7.12 股票投资收益

## 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

项目	本期 2021年1月1日 至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年12月30日(基金合 同生效日) 至2020年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	134,374.23	-
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	134,374.23	-

注：本基金上年度可比期间未投资股票。

## 7.4.7.12.2 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12月31日	上年度可比期间 2020年12月30日(基金合 同生效日) 至2020年12月31日
卖出股票成交总额	16,380,091.27	-
减：卖出股票成本总额	16,245,717.04	-
买卖股票差价收入	134,374.23	-

## 7.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无基金投资收益。

#### 7.4.7.14 债券投资收益

##### 7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

项目	本期 2021年1月1日 至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年12月30日(基金合 同生效日) 至2020年12月31日
债券投资收益——买卖债券(、债转股及债券到期兑付)差价收入	163,737.06	-
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	163,737.06	-

##### 7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日 至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年12月30日(基金合 同生效日) 至2020年12月31日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	717,041,076.65	-
减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	708,620,076.78	-
减：应收利息总额	8,257,262.81	-
买卖债券差价收入	163,737.06	-

##### 7.4.7.14.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

##### 7.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.16 衍生工具收益

##### 7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

## 7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日 至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年12月30日(基金合 同生效日) 至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	93,292.19	-
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	93,292.19	-

## 7.4.7.18 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12月31日	上年度可比期间 2020年12月30日(基金合 同生效日) 至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	68,261.67	-
——股票投资	66,795.26	-
——债券投资	1,466.41	-
——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	68,261.67	-

## 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日 至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年12月30日(基金合 同生效日) 至2020年12月31日
基金赎回费收入	6,937.67	-
其他收入_基金转出费	63.34	-

合计	7,001.01	-
----	----------	---

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 50% 归入基金资产。

2. 部分基金之间的转换费采用固定转换费率，不低于转换费总额的 25% 归入转出基金的基金资产；部分基金之间的转换费由赎回费和申购补差费两部分构成，其中不低于赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 12 月 30 日(基金合 同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	47,540.43	-
银行间市场交易费用	23,450.00	-
合计	70,990.43	-

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 12 月 30 日(基金合 同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	30,000.00	-
信息披露费	137,500.00	-
证券出借违约金	-	-
账户维护费	13,500.00	-
其他	5,400.00	-
律师费	30,000.00	-
持有人大会费	10,000.00	-
合计	226,400.00	-

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
兴华基金管理有限公司(“兴华基金”)	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(“招商证券”)	基金托管人、基金销售机构
张磊	基金管理人的股东
唐骏	基金管理人的股东
韩光华	基金管理人的股东
宿迁信仁企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
宿迁信智企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
宿迁信忠企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
宿迁信礼企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
宿迁信勇企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
宿迁信良企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2020年12月30日(基金合同生效日) 至2020年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
招商证券	34,557,326.05	100.00	-	-

##### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日 至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
招商证券	64,459,251.70	100.00

## 7.4.10.1.3 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12月31日		上年度可比期间 2020年12月30日(基金合同生效日) 至2020年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
招商证券	1,038,030,000.00	100.00	22,400,000.00	100.00

## 7.4.10.1.4 基金交易

本基金本年度及上年度可比期间未通过关联方进行基金交易。

## 7.4.10.1.5 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方进行权证交易。

## 7.4.10.1.6 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12月31日			
	当期佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
招商证券	41,414.03	100.00	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年12月30日(基金合同生效日)至2020年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
招商证券	560.00	100.00	-	-

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

## 7.4.10.2 关联方报酬

## 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日 至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年12月30日(基金合 同生效日) 至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	221,207.41	3,331.56
其中：支付销售机构的客户维护费	40,411.69	763.60



注：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 0.60%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×0.60%/当年天数。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日 至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年12月30日(基金合 同生效日) 至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	73,735.79	1,110.52

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 0.20%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×0.20%/当年天数。

#### 7.4.10.2.3 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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴华瑞丰混合 A	兴华瑞丰混合 C	合计
招商证券	-	55,902.05	55,902.05
合计	-	55,902.05	55,902.05
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 12 月 30 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴华瑞丰混合 A	兴华瑞丰混合 C	合计
招商证券	-	1,640.42	1,640.42
合计	-	1,640.42	1,640.42

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费=前一日 C 类基金资产净值 0.40%/当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

金额单位：人民币元

银行间市场 交易的各关 联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日					
	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
招商证券	-	30,612,564.60	-	-	-	-
上年度可比期间 2020 年 12 月 30 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日						

银行间市场交易的各关联方名称	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
-	-	-	-	-	-	-

注：本基金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。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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

本基金本报告期内及上年度可比期间未参与转融通证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自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12月31日	
	兴华瑞丰混合 A	兴华瑞丰混合 C
基金合同生效日（2020年12月30日）持有的基金份额	-	20,000,900.00
报告期初持有的基金份额	-	20,000,900.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	15,115,000.00
报告期末持有的基金份额	-	4,885,900.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	74.75%

项目	上年度可比期间 2020年12月30日(基金合同生效日) 至2020年12月31日	
	兴华瑞丰混合 A	兴华瑞丰混合 C
基金合同生效日（2020年12月30日）持有的基金份额	-	20,000,900.00
报告期初持有的基金份额	-	20,000,900.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-

减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	20,000,900.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	9.84%

注：基金管理人兴华基金投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

#### 7.4.10.5.2 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

兴华瑞丰混合 A				
关联方名称	本期末 2021 年 12 月 31 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	496.37	0.03%	-	-
张磊	495.19	0.03%	-	-

#### 7.4.10.6 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2020 年 12 月 30 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商证券	213,100.03	1,477.46	740.00	0.01

注：基金托管人招商证券受托作为本基金的证券经纪商。上述款项为本基金存放于基金托管人基金专用证券账户中的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 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无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 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暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购，因此没有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购，因此没有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 7.4.12.4 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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为偏债混合型基金，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包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的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 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。

#### 7.4.13.2 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。本基金的银行存款存放于具有基金托管资格的招商银行股份有限公司，其他存款存放于本基金的托管人招商证券，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 7.4.13.2.1 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 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	239,946.00	-

合计	239,946.00	-
----	------------	---

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级部分为国债。

#### 7.4.13.2.2 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按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.3 按短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短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 7.4.13.2.4 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 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	1,609,421.50	-
合计	1,609,421.50	-

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级部分为国债、政策性金融债。

#### 7.4.13.2.5 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按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 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列示的同业存单投资。

#### 7.4.13.3 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。

于本报告期末，本基金所承担的全部金融负债的合同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，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 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期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上市公司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 7.4.12。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 12 月 31 日，本基金无持有的流动性受限资产。

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 12 月 31 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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、债券投资和买入返售金融资产等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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	338,351.92	-	-	-	338,351.92
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	921,304.00	672,338.00	255,725.50	2,011,673.00	3,861,040.50
买入返售金融资产	2,697,053.81	-	-	-	2,697,053.81
应收利息	-	-	-	28,592.46	28,592.46
应收申购款	-	-	-	799.70	799.70
资产总计	3,956,709.73	672,338.00	255,725.50	2,041,065.16	6,925,838.39
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,029.05	1,029.05
应付管理人报酬	-	-	-	3,411.28	3,411.28
应付托管费	-	-	-	1,137.09	1,137.09
应付销售服务费	-	-	-	1,781.66	1,781.66
其他负债	-	-	-	172,000.00	172,000.00
负债总计	-	-	-	179,359.08	179,359.08
利率敏感度缺口	3,956,709.73	672,338.00	255,725.50	1,861,706.08	6,746,479.31
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	180,781,539.26	-	-	-	180,781,539.26



存出保证金	0.00	-	-	-	0.00
买入返售金融资产	22,400,560.00	-	-	-	22,400,560.00
应收利息	-	-	-	18,367.23	18,367.23
其他资产	-	-	-	33,954.07	33,954.07
资产总计	203,182,099.26	-	-	52,321.30	203,234,420.56
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	3,331.56	3,331.56
应付托管费	-	-	-	1,110.52	1,110.52
应付销售服务费	-	-	-	2,193.47	2,193.47
负债总计	-	-	-	6,635.55	6,635.55
利率敏感度缺口	203,182,099.26	-	-	45,685.75	203,227,785.01

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
	市场利率上升 25 个基点	-13,262.03	-
	市场利率下降 25 个基点	13,846.29	-

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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；同时采用“自下而上”的策略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。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0-30%；本基金投资同业存单不超过基金资产的 20%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。此外，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，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 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	2,011,673.00	29.82	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	2,011,673.00	29.82	-	-

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)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 12 月 31 日)	上年度末(2020 年 12 月 31 日)
		业绩比较基准上 升 500 基点	49,019.98
	业绩比较基准下 降 500 基点	-49,019.98	-

#### 7.4.14 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

于本报告期末，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 2,011,673.00 元，属于第二层次的余额为 1,849,367.50 元，无第三层级余额(上年度末：无第一、第二和第三层次余额)。

(ii) 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。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(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

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：同)。

(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) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021 年的比较数据将不作重述。

(3)除公允价值和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,011,673.00	29.05
	其中：股票	2,011,673.00	29.05
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,849,367.50	26.70
	其中：债券	1,849,367.50	26.70
	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	2,697,053.81	38.94
	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	338,351.92	4.89
8	其他各项资产	29,392.16	0.42
9	合计	6,925,838.39	100.00

注：其他资产包括：应收利息、应收申购款。

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	855,782.00	12.68
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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	475,749.00	7.05
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	409,500.00	6.07
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	270,642.00	4.01
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	2,011,673.00	29.82

## 8.2.2 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。

## 8.3 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002027	分众传媒	50,000	409,500.00	6.07
2	300379	东方通	9,300	274,629.00	4.07
3	002979	雷赛智能	10,600	274,222.00	4.06
4	600323	瀚蓝环境	12,900	270,642.00	4.01
5	600699	均胜电子	11,300	248,261.00	3.68
6	300253	卫宁健康	12,000	201,120.00	2.98
7	600584	长电科技	4,600	142,692.00	2.12
8	300782	卓胜微	300	98,040.00	1.45
9	300433	蓝思科技	3,100	71,238.00	1.06
10	002531	天顺风能	1,100	21,329.00	0.32

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	002422	科伦药业	1,629,409.00	0.80
2	600419	天润乳业	1,005,752.00	0.49
3	002727	一心堂	852,502.00	0.42
4	600745	闻泰科技	814,258.00	0.40
5	601318	中国平安	807,890.00	0.40
6	600114	东睦股份	801,395.00	0.39
7	000066	中国长城	789,850.00	0.39
8	603859	能科科技	721,630.00	0.36
9	000661	长春高新	702,463.00	0.35

10	002777	久远银海	690,771.00	0.34
11	002126	银轮股份	584,825.00	0.29
12	000921	海信家电	564,887.00	0.28
13	600036	招商银行	545,440.00	0.27
14	688300	联瑞新材	505,148.00	0.25
15	000725	京东方 A	504,100.00	0.25
16	300682	朗新科技	502,235.00	0.25
17	601088	中国神华	492,816.00	0.24
18	300776	帝尔激光	485,971.00	0.24
19	300379	东方通	467,673.00	0.23
20	002027	分众传媒	437,191.00	0.22

#### 8.4.2 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	002422	科伦药业	1,490,857.00	0.73
2	600114	东睦股份	923,530.00	0.45
3	000066	中国长城	866,520.00	0.43
4	600419	天润乳业	832,228.00	0.41
5	600745	闻泰科技	815,944.00	0.40
6	603859	能科科技	788,136.00	0.39
7	002777	久远银海	705,562.00	0.35
8	002727	一心堂	659,430.00	0.32
9	688300	联瑞新材	630,551.95	0.31
10	300682	朗新科技	628,241.50	0.31
11	002126	银轮股份	624,360.00	0.31
12	601318	中国平安	596,235.00	0.29
13	000725	京东方 A	569,000.00	0.28
14	600036	招商银行	561,869.00	0.28
15	601088	中国神华	560,719.99	0.28
16	000661	长春高新	554,497.00	0.27
17	300776	帝尔激光	513,809.00	0.25
18	000921	海信家电	468,000.00	0.23
19	605123	派克新材	444,585.00	0.22
20	000739	普洛药业	411,183.00	0.20

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	18,190,594.78
--------------	---------------

卖出股票收入（成交）总额	16,380,091.27
--------------	---------------

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

### 8.5 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	1,311,574.50	19.44
2	央行票据	-	-
3	金融债券	537,793.00	7.97
	其中：政策性金融债	537,793.00	7.97
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,849,367.50	27.41

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	010303	03 国债(3)	3,500	355,425.00	5.27
2	018008	国开 1802	3,100	316,913.00	4.70
3	019628	20 国债 02	2,800	280,028.00	4.15
4	019547	16 国债 19	2,350	235,305.50	3.49
5	019641	20 国债 11	1,800	180,450.00	2.67

### 8.7 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。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末无股指期货的持仓。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末无国债期货的持仓。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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

#### 8.12.2 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。

#### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	28,592.46
5	应收申购款	799.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,392.16

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 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情况。

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。



## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额类别	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
兴华瑞丰混合 A	111	12,751.09	0.00	0.00%	1,415,370.87	100.00%
兴华瑞丰混合 C	186	27,533.99	4,885,900.00	95.40%	235,422.66	4.60%
合计	297	22,009.07	4,885,900.00	74.75%	1,650,793.53	25.25%

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数据，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额类别	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	兴华瑞丰混合 A	4,578.79	0.3235%
	兴华瑞丰混合 C	4,653.06	0.0909%
	合计	9,231.85	0.1412%

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数据，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额类别	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 研究部门负责人持有本开放式基金	兴华瑞丰混合 A	0~10
	兴华瑞丰混合 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	兴华瑞丰混合 A	0
	兴华瑞丰混合 C	0
	合计	0

注：截至本报告期末，本基金管理人高级管理人员，基金投资和部门负责人持有本基金份额总量的数据区间为 0~10 万份；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数据区间为 0。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	兴华瑞丰混合 A	兴华瑞丰混合 C
基金合同生效日（2020 年 12 月 30 日）基金份额总额	2,522,864.35	200,693,188.98
本报告期期初基金份额总额	2,522,864.35	200,693,188.98
本报告期基金总申购份额	962,772.63	45,113,325.07
减：本报告期基金总赎回份额	2,070,266.11	240,685,191.39
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	1,415,370.87	5,121,322.66

注：总申购份额含红利再投、转换入份额等；总赎回份额含转换出份额等。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《兴华瑞丰混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议《关于兴华瑞丰混合型证券投资基金持续运作有关事项的议案》和《关于兴华瑞丰混合型证券投资基金变更投资范围有关事项的议案》。2021 年 11 月 1 日，在本基金托管人授权代表的监督下，本基金管理人对本次大会表决进行了计票，上海市通力律师事务所对计票过程进行了见证，北京市方圆公证处对计票过程及结果进行了公证。本次大会决议自表决通过之日即 2021 年 11 月 1 日起生效，自 2021 年 11 月 2 日起，变更注册后的《兴华瑞丰混合型证券投资基金基金合同》生效。具体可参见基金管理人于 2021 年 11 月 2 日发布的《兴华瑞丰混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 1. 基金管理人：

本报告期内，基金管理人不存在董事、监事、高级管理人员的变动。

#### 2. 基金托管人：

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。

### 11.3 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。

#### 11.4 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所，本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，已为本基金提供 1 年审计服务。

本报告期内实际应支付会计师事务所的审计费为 30000 元。

#### 11.5 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。

#### 11.6 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 11.6.1 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	2	34,557,326.05	100.00%	55,468.68	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。

##### 11.6.2 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	64,459,251.70	100.00%	1,038,030,000.00	100.00%	-	-

## 11.7 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	中国证监会规定媒介	2021年1月18日
2	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	中国证监会规定媒介	2021年1月19日
3	兴华瑞丰混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证监会规定媒介	2021年1月28日
4	关于提高兴华瑞丰混合型证券投资基金份额净值精度的公告	中国证监会规定媒介	2021年2月2日
5	兴华基金管理有限公司关于兴华瑞丰混合型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	中国证监会规定媒介	2021年2月9日
6	兴华基金管理有限公司关于设立北京分公司的公告	中国证监会规定媒介	2021年2月22日
7	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	中国证监会规定媒介	2021年4月8日
8	兴华瑞丰混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2021年4月16日
9	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	中国证监会规定媒介	2021年4月16日
10	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	中国证监会规定媒介	2021年4月17日
11	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	中国证监会规定媒介	2021年4月29日
12	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	中国证监会规定媒介	2021年5月26日
13	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	中国证监会规定媒介	2021年6月2日

14	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	中国证监会规定媒介	2021年7月1日
15	兴华瑞丰混合型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告	中国证监会规定媒介	2021年7月20日
16	兴华基金管理有限公司旗下部分基金 2021 年第 2 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2021年7月20日
17	兴华瑞丰混合型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告的更正公告	中国证监会规定媒介	2021年7月21日
18	兴华瑞丰混合型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告(更正)	中国证监会规定媒介	2021年7月21日
19	兴华瑞丰混合型证券投资基金 2021 年中期报告	中国证监会规定媒介	2021年8月30日
20	兴华基金管理有限公司旗下部分基金 2021 年中期报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2021年8月30日
21	兴华基金管理有限公司关于以通讯方式召开兴华瑞丰混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证监会规定媒介	2021年9月24日
22	兴华基金管理有限公司关于以通讯方式召开兴华瑞丰混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告第一次提示性公告	中国证监会规定媒介	2021年9月27日
23	兴华基金管理有限公司关于以通讯方式召开兴华瑞丰混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告第二次提示性公告	中国证监会规定媒介	2021年9月28日
24	兴华基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证监会规定媒介	2021年10月8日
25	兴华瑞丰混合型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告	中国证监会规定媒介	2021年10月25日
26	兴华基金管理有限公司旗下部分基金 2021 年第 3 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2021年10月25日
27	兴华瑞丰混合型证券投资基金合同更新	中国证监会规定媒介	2021年11月2日
28	兴华瑞丰混合型证券投资基金托管协议更新	中国证监会规定媒介	2021年11月2日
29	兴华瑞丰混合型证券投资基金招募说明书更新	中国证监会规定媒介	2021年11月2日
30	兴华瑞丰混合型证券投资基金(A 份额)基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2021年11月2日
31	兴华瑞丰混合型证券投资基金(C 份额)基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2021年11月2日

32	兴华瑞丰混合型证券投资基金持有人大会表决结果暨决议生效的公告	中国证监会规定媒介	2021 年 11 月 2 日
33	兴华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东方财富证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2021 年 12 月 10 日

注：中国证监会规定媒介指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及规定的互联网网站等媒介。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2021 年 9 月 2 日-2021 年 12 月 31 日	20,000,900.00	-	15,115,000.00	4,885,900.00	74.75%
机构	2	2021 年 7 月 30 日-2021 年 9 月 1 日	-	19,892,580.07	19,892,580.07	-	-
机构	3	2021 年 8 月 2 日-2021 年 9 月 1 日	-	24,868,198.55	24,868,198.55	-	-
个人	1	2021 年 2 月 3 日-2021 年 2 月 3 日	10,000,900.00	-	10,000,900.00	-	-

#### 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。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期，依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《兴华瑞丰混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议《关于兴华瑞丰混合型证券投资基金持续运作有关事项的议案》和《关于兴华瑞丰混合型证券投资基金变更投资范围有关事项的议案》。2021 年 11 月 1 日，在本基金托管人授权代表的监督下，本基金管理人对本次大会表决进行了计票，上海市通力律师事务所对计票过程进行了见证，北京市方圆公证处对计票过程及结果进行了公证。本次大会决议自表决通过之日即 2021 年 11 月 1 日起生效，自 2021 年 11 月 2 日起，变更注册后的《兴华瑞丰混合型证券投资基金基金合同》生效。具体可参见基金管理人于 2021 年 11 月 2 日发布的《兴华瑞丰混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、关于准予兴华瑞丰混合型证券投资基金注册的批复
- 2、《兴华瑞丰混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《兴华瑞丰混合型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

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

### 13.3 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

2022 年 3 月 31 日