

# 兴华安聚纯债债券型证券投资基金

## 2023 年中期报告

2023 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：恒丰银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 29 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。

基金托管人恒丰银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 4 月 26 日起至 2023 年 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 .....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	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 .....	12
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 .....	12
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	12
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>13</b>
6.1 资产负债表 .....	13
6.2 利润表 .....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	15
6.4 报表附注 .....	16
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	40

7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	40
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	41
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	41
7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	41
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	41
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	41
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	41
7.12	投资组合报告附注	41
<b>§ 8</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>42</b>
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	42
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	42
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	43
<b>§ 9</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>43</b>
<b>§ 10</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>43</b>
10.1	基金份额持有人大会决议	43
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	43
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	44
10.4	基金投资策略的改变	44
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	44
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	44
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	45
10.8	其他重大事件	46
<b>§ 11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>47</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	47
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>48</b>
12.1	备查文件目录	48
12.2	存放地点	48
12.3	查阅方式	48

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	兴华安聚纯债债券型证券投资基金	
基金简称	兴华安聚纯债	
基金主代码	017214	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 4 月 26 日	
基金管理人	兴华基金管理有限公司	
基金托管人	恒丰银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	301,405,616.82 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分类基金的基金简称	兴华安聚纯债 A	兴华安聚纯债 C
下属分类基金的交易代码	017214	017215
报告期末下属分类基金的份额总额	301,114,531.06 份	291,085.76 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1、资产配置策略；2、利率类品种投资策略；3、信用债投资策略（含资产支持证券）；4、证券公司短期公司债券投资策略；5、国债期货投资策略；6、杠杆投资策略。 今后，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。
业绩比较基准	中债综合全价(总值)指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期收益和风险高于货币市场基金，但低于股票型基金和混合型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		兴华基金管理有限公司	恒丰银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	韩冰	梁明
	联系电话	0532-80921021	021-63890657
	电子邮箱	hanbing@xinghuafund.com.cn	liangming@hfbank.com.cn
客户服务电话		4000678815	95395
传真		0532-80921032	021-63890708
注册地址		山东省青岛市李沧区金水路 187	济南市历下区泺源大街 8 号

	号 2 号楼 8 层	
办公地址	山东省青岛市李沧区金水路 187 号 2 号楼 8 层	上海市黄浦区开平路 88 号瀛通绿地大厦 16 楼
邮政编码	266199	200023
法定代表人	张磊	陈颖

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
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 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	兴华安聚纯债 A	兴华安聚纯债 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期（2023 年 4 月 26 日-2023 年 6 月 30 日）	报告期（2023 年 4 月 26 日-2023 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	2,202,095.63	1,889.86
本期利润	5,588,530.91	5,346.11
加权平均基金份额本期利润	0.0160	0.0175
本期加权平均净值利润率	1.58%	1.73%
本期基金份额净值增长率	1.80%	1.75%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2023 年 6 月 30 日）	
期末可供分配利润	2,022,466.06	1,826.47
期末可供分配基金份额利润	0.0067	0.0063
期末基金资产净值	306,523,432.28	296,185.26
期末基金份额净值	1.0180	1.0175
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2023 年 6 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	1.80%	1.75%

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。

(4) 本基金合同于 2023 年 4 月 26 日生效，截至报告期末基金合同生效未满一季度。

### 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

兴华安聚纯债 A

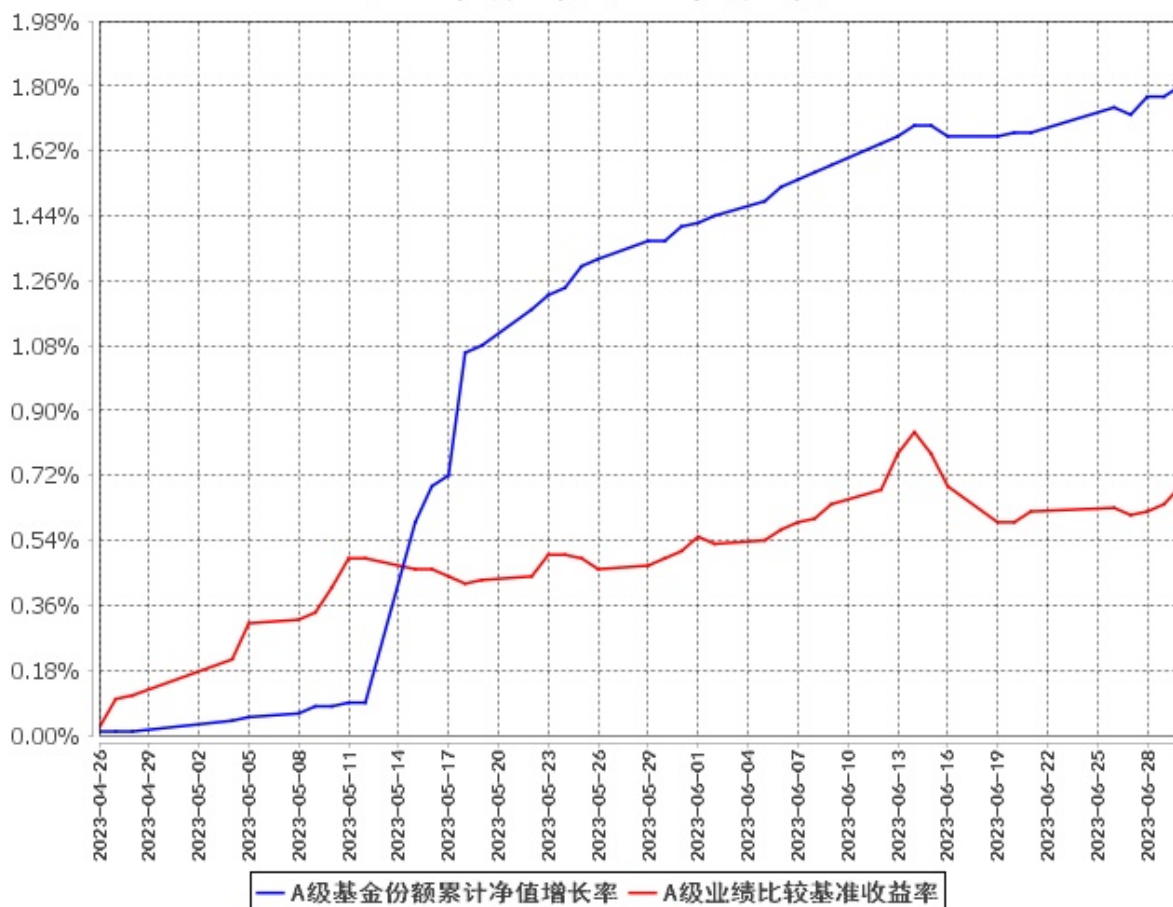
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.38%	0.02%	0.18%	0.05%	0.20%	-0.03%
自基金合同生效起至今	1.80%	0.09%	0.69%	0.04%	1.11%	0.05%

兴华安聚纯债 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.36%	0.02%	0.18%	0.05%	0.18%	-0.03%
自基金合同生效起至今	1.75%	0.09%	0.69%	0.04%	1.06%	0.05%

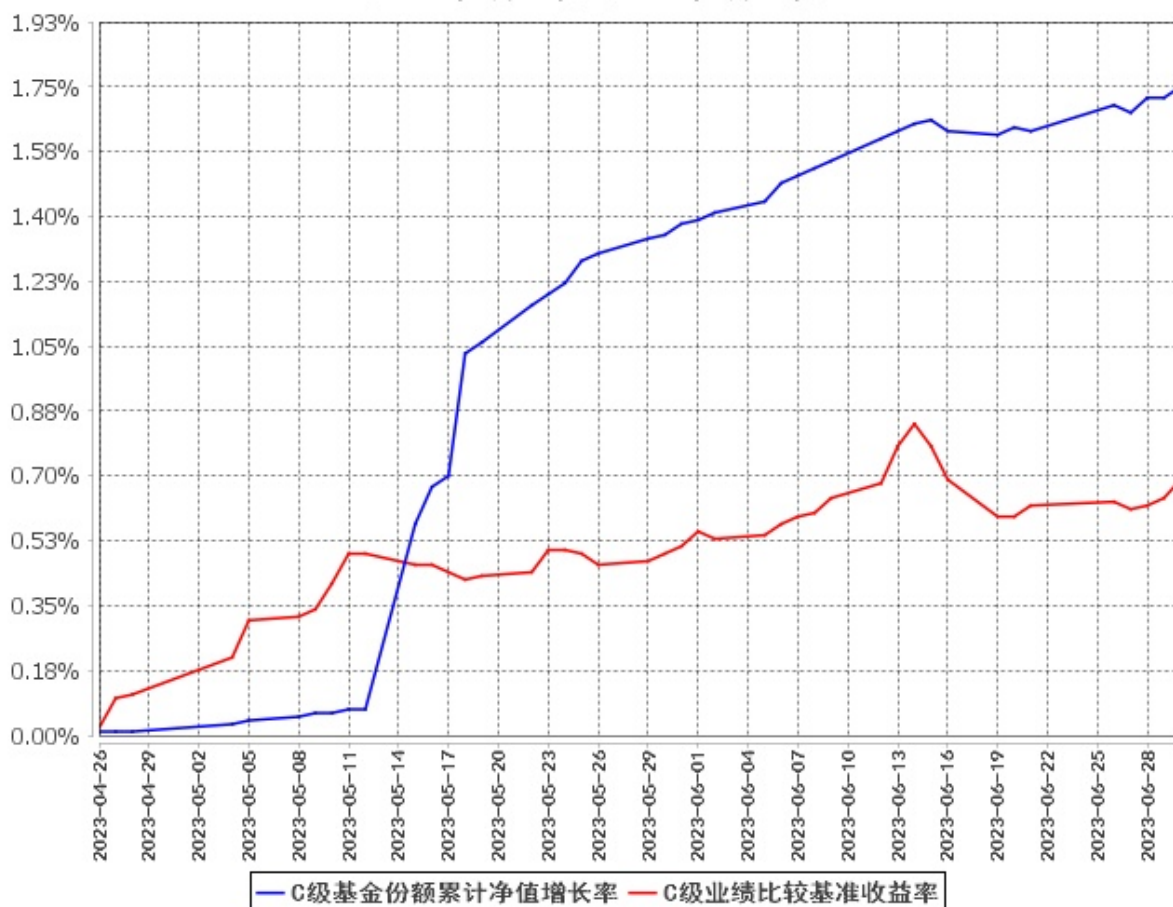
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

**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**  
(2023年4月26日至2023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**  
(2023年4月26日至2023年6月30日)



注：(1) 本基金合同于 2023 年 4 月 26 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。截至本报告期末，本基金尚处于建仓期。

## § 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“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 2023 年 6 月 30 日，兴华基金管理有限公司旗下共管理 10 只公募基金，包括兴华永兴混合型发起式证券投资基金、兴华创新医疗 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金、兴华消费精选 6

个月持有期混合型发起式证券投资基金、兴华安盈一年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、兴华安丰纯债债券型证券投资基金、兴华安悦纯债债券型证券投资基金、兴华安裕利率债债券型证券投资基金、兴华安聚纯债债券型证券投资基金、兴华安惠纯债债券型证券投资基金。

#### 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		
吕智卓	基金经 理	2023 年 4 月 26 日	-	9 年	吕智卓先生，中国国籍，澳大利亚西悉尼大学应用金融硕士，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收公募部副总经理。

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

(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《中华人民共和国证券投资基金法》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》，通过建立规范化的投资研究和决策流程等方式尽可能确保公平对待各投资组合。

本报告期内，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况，公平交易制度的整体执行情况良好。

#### 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，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

2023 年上半年债市利率先上后下，一季度在稳增长政策发力、信贷投放开门红的背景下债市小幅走弱。进入 4 月后，债市利率逐渐下行，背后的逻辑是经济环比一季度走弱，就业压力加大的背景下居民端消费疲弱、通缩凸显，PPI 同比降幅扩大，商业银行普降存款利率后市场对央行调降政策利率的预期升温。6 月 13 日降息如期而至，债市利率在经过快速下行后出现较大的调整，驱动逻辑是市场交易的重心从“宽货币”切换为“地产刺激”和“财政政策发力”。

本基金今年以来以短久期适度下沉信用资质的信用债票息策略为主。

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安聚纯债 A 的基金份额净值为 1.0180 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.80%；截至本报告期末兴华安聚纯债 C 的基金份额净值为 1.0175 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.75%；同期业绩比较基准收益率为 0.69%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我国出口增速有望触底反弹；扩大内需成为经济增长的主要动力，促进消费政策空间较大；基建投资依然发挥拉动经济的“头雁效应”，地产市场继续探底修复，复苏势头仍需观望。

内外需求两端承压，居民端扩张杠杆意愿较低，下半年流动性或将保持宽松，降准降息还有空间，债市依然可以保持多头思维。

### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行利润分配。

#### 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

本报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支、利润分配情况等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、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，认为其真实、准确和完整，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：兴华安聚纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	129,970.44
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	315,940,723.38
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		315,940,723.38
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	952,657.89
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		317,023,351.71
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		10,000,952.78
应付清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		75,522.71
应付托管费		25,174.23
应付销售服务费		48.60
应付投资顾问费		-
应交税费		47,733.70

应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	54,302.15
负债合计		10,203,734.17
<b>净资产：</b>		
实收基金	6.4.7.7	301,405,616.82
其他综合收益		-
未分配利润	6.4.7.8	5,414,000.72
净资产合计		306,819,617.54
负债和净资产总计		317,023,351.71

注：(1) 报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额总额 301,405,616.82 份，其中兴华安聚纯债 A 基金份额净值 1.0180 元，基金份额总额 301,114,531.06 份；兴华安聚纯债 C 基金份额净值 1.0175 元，基金份额总额 291,085.76 份。

(2) 本基金合同于 2023 年 4 月 26 日生效，本报告期自 2023 年 4 月 26 日至 2023 年 6 月 30 日，无上年度末数据。

## 6.2 利润表

会计主体：兴华安聚纯债债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 4 月 26 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2023 年 4 月 26 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		5,915,144.07
1. 利息收入		617,798.94
其中：存款利息收入	6.4.7.9	360,556.83
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		257,242.11
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,907,446.10
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	1,907,446.10
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益	6.4.7.12	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-
股利收益	6.4.7.14	-

以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 15	3, 389, 891. 53
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. 16	7. 50
<b>减：二、营业总支出</b>		321, 267. 05
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	194, 705. 35
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	64, 901. 78
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	109. 54
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		3, 201. 52
其中：卖出回购金融资产支出		3, 201. 52
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 17	-
7. 税金及附加		7, 828. 86
8. 其他费用	6. 4. 7. 18	50, 520. 00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		5, 593, 877. 02
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		5, 593, 877. 02
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-
<b>六、综合收益总额</b>		5, 593, 877. 02

注：本基金合同于 2023 年 4 月 26 日生效，本报告期自 2023 年 4 月 26 日至 2023 年 6 月 30 日，无上年度可比期间。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：兴华安聚纯债债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 4 月 26 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 4 月 26 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	600, 785, 174. 66	-	-	600, 785, 174. 66

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-299,379,557.84	-	5,414,000.72	-293,965,557.12
（一）、综合收益总额	-	-	5,593,877.02	5,593,877.02
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-299,379,557.84	-	-179,876.30	-299,559,434.14
其中：1. 基金申购款	737,042.60	-	396.08	737,438.68
2. 基金赎回款	-300,116,600.44	-	-180,272.38	-300,296,872.82
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	301,405,616.82	-	5,414,000.72	306,819,617.54

注：本基金合同于 2023 年 4 月 26 日生效，本报告期自 2023 年 4 月 26 日至 2023 年 6 月 30 日，无上年度可比期间。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

兴华安聚纯债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2022]2590号《关于准予兴华安聚纯债债券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《兴华安聚纯债债券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 600,758,173.59 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(2023)第 0258 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《兴华安聚纯债债券型证券投资基金基金合同》于 2023 年 4 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 600,785,174.66 份基金份额,其中认购资金利息折合 27,001.07 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,基金托管人为恒丰银行股份有限公司。

根据《兴华安聚纯债债券型证券投资基金基金合同》和《兴华安聚纯债债券型证券投资基金招募说明书》的规定,本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,并从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置基金代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算并公告基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《兴华安聚纯债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的债券(包括国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券、次级债、证券公司短期公司债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款以及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。本基金不投资于股票,也不投资于可转换债券、可交换债券。基金的投资组合比例为:本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%;每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,持有现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 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:中债综合全价(总值)指数收益率。

#### 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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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》、《兴华安聚纯债债券型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 2023 年 4 月 26 日(基金合同生效日)至 2023 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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 4 月 26 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 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 2023 年 4 月 26 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具,是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时,确认相关的金融资产或金融负债。

##### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为:以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具,分别采用以下两种方式进行计量:

##### 以摊余成本计量:

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标,且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致,即在特定日期产生的现金流量,仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益:

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具,以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投

资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

## (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的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在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，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，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。

#### 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和资产支持证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。

#### 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净资产比例计算的金额。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净资产比例计算的金额。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

债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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投资收益。

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扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息的净额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扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，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。

以摊余成本计量的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净资产转出。

#### 6.4.4.12 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。

#### 6.4.4.13 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：

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》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于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。

#### 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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

##### 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[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，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(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。

(4) 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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	129,795.94
等于：本金	129,240.27
加：应计利息	555.67
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	174.50
等于：本金	174.43

加：应计利息	0.07
减：坏账准备	-
合计	129,970.44

注：其他存款为本基金存放在开立于证券公司的证券账户内的存款。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金 合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	20,010,742.47	48,657.53	20,174,657.53	115,257.53
	银行间市场	288,033,286.00	4,458,145.85	295,766,065.85	3,274,634.00
	合计	308,044,028.47	4,506,803.38	315,940,723.38	3,389,891.53
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	308,044,028.47	4,506,803.38	315,940,723.38	3,389,891.53	

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	952,657.89	-
银行间市场	-	-
合计	952,657.89	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末持有买断式逆回购交易中取得的债券。



#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 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	-
应付交易费用	3,782.15
其中：交易所市场	-
银行间市场	3,782.15
应付利息	-
预提费用	50,520.00
合计	54,302.15

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

兴华安聚纯债 A		
项目	本期 2023 年 4 月 26 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	600,496,932.13	600,496,932.13
本期申购	629,608.22	629,608.22
本期赎回(以“-”号填列)	-300,012,009.29	-300,012,009.29
本期末	301,114,531.06	301,114,531.06

金额单位：人民币元

兴华安聚纯债 C		
项目	本期 2023 年 4 月 26 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	288,242.53	288,242.53
本期申购	107,434.38	107,434.38
本期赎回(以“-”号填列)	-104,591.15	-104,591.15
本期末	291,085.76	291,085.76

注：(1)总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

(2)本基金合同于 2023 年 4 月 26 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 600,785,174.66 份基

金份额，其中有效认购资金折合 600,758,173.59 份基金份额，认购资金利息折合 27,001.07 份基金份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

兴华安聚纯债 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	2,202,095.63	3,386,435.28	5,588,530.91
本期基金份额交易产生的变动数	-179,629.57	-0.12	-179,629.69
其中：基金申购款	377.78	-	377.78
基金赎回款	-180,007.35	-0.12	-180,007.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,022,466.06	3,386,435.16	5,408,901.22

单位：人民币元

兴华安聚纯债 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	1,889.86	3,456.25	5,346.11
本期基金份额交易产生的变动数	-63.39	-183.22	-246.61
其中：基金申购款	18.30	-	18.30
基金赎回款	-81.69	-183.22	-264.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,826.47	3,273.03	5,099.50

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 4 月 26 日(基金合同生效日) 至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	247,008.64
定期存款利息收入	111,469.45
其他存款利息收入	2,078.74
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	360,556.83

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

本报告期，本基金无股票投资收益。

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年4月26日(基金合同生效日) 至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,814,578.01
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入	92,868.09
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	1,907,446.10

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年4月26日(基金合同生效日) 至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	10,184,134.37
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	9,970,214.75
减：应计利息总额	117,923.50
减：交易费用	3,128.03
买卖债券差价收入	92,868.09

#### 6.4.7.12 贵金属投资收益

##### 6.4.7.12.1 贵金属投资收益项目构成

本报告期，本基金无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.13 衍生工具收益

##### 6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本报告期，本基金无衍生工具收益。

#### 6.4.7.14 股利收益

本报告期, 本基金无股利收益。

#### 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期 2023 年 4 月 26 日(基金合同生效日) 至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	3,389,891.53
——股票投资	-
——债券投资	3,389,891.53
——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	3,389,891.53

#### 6.4.7.16 其他收入

单位: 人民币元

项目	本期 2023 年 4 月 26 日(基金合同生效日) 至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	7.50
合计	7.50

#### 6.4.7.17 信用减值损失

本报告期, 本基金无信用减值损失。

#### 6.4.7.18 其他费用

单位: 人民币元

项目	本期 2023 年 4 月 26 日(基金合同生效日) 至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	15,840.00
信息披露费	31,680.00

证券出借违约金	-
账户维护费	3,000.00
合计	50,520.00

#### 6.4.7.19 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发生变化。经本基金管理人股东会审议通过，股东唐俊先生将其持有 5%股权中的 4.95%转让给青岛信爱投资中心(有限合伙)、0.05%转让给宿迁信勇企业管理合伙企业(有限合伙)。

转让前本基金管理人股东为：张磊、唐俊、韩光华、宿迁信仁企业管理合伙企业(有限合伙)、宿迁信礼企业管理合伙企业(有限合伙)、宿迁信智企业管理合伙企业(有限合伙)、宿迁信忠企业管理合伙企业(有限合伙)、宿迁信良企业管理合伙企业(有限合伙)、宿迁信勇企业管理合伙企业(有限合伙)。

转让后本基金管理人股东为：张磊、韩光华、宿迁信仁企业管理合伙企业(有限合伙)、宿迁信礼企业管理合伙企业(有限合伙)、宿迁信智企业管理合伙企业(有限合伙)、宿迁信忠企业管理合伙企业(有限合伙)、宿迁信良企业管理合伙企业(有限合伙)、宿迁信勇企业管理合伙企业(有限合伙)、青岛信爱投资中心(有限合伙)。

##### 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
恒丰银行股份有限公司	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

宿迁信仁企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
宿迁信礼企业管理合伙企业(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
宿迁信良企业管理合伙企业(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
青岛信爱投资中心(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。

#### 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 2023 年 4 月 26 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

本报告期，本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

本报告期，本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本报告期，本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

本报告期，本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期，本基金无应支付关联方佣金。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 4 月 26 日(基金合同生效日) 至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	194,705.35
其中：支付销售机构的客户维护费	345.99

注：(1) 支付基金管理人兴华基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.30% 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 × 0.30% /

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 2023 年 4 月 26 日(基金合同生效日) 至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	64,901.78

注：支付基金托管人恒丰银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.10%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×0.10%/当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

本报告期，本基金关联方未发生销售服务费。

#### 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

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

本报告期，本基金未与关联方进行转融通证券出借业务。

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

本报告期，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

本报告期，本基金基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

份额单位：份

兴华安聚纯债 A		
关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日	
	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	999.45	0.00%

份额单位：份

兴华安聚纯债 C		
关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
张磊	100.01	0.03%

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2023 年 4 月 26 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
恒丰银行股份有限公司	129,795.94	247,008.64

注：本基金的活期银行存款由基金托管人恒丰银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期，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，本基金未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023 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

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 10,000,952.78 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
220005	22 付息国债 05	2023 年 7 月 7 日	100.89	106,000	10,694,735.15
合计				106,000	10,694,735.15

#### 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

本基金为债券型基金，其风险收益预期高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。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在控制信用风险、谨慎投资的前提下，力争在获取持有期收益的同时，实现基金资产的长期稳定增值。

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。本基金的银行存款主要存放于具有基金托管资格的恒丰银行股份有限公司，其他银行存款均存放于信用良好的银行，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。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日
A-1	28,845,526.56
A-1 以下	-
未评级	30,268,118.36

合计	59,113,644.92
----	---------------

注：(1) 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

(2) 未评级债券为国债。

(3) 本基金合同于 2023 年 4 月 26 日生效，本报告期自 2023 年 4 月 26 日至 2023 年 6 月 30 日，无上年度末数据。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日
AAA	144,821,446.88
AAA 以下	44,891,044.00
未评级	67,114,587.58
合计	256,827,078.46

注：(1) 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

(2) 未评级债券为公司债、中期票据。

(3) 本基金合同于 2023 年 4 月 26 日生效，本报告期自 2023 年 4 月 26 日至 2023 年 6 月 30 日，无上年度末数据。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单。

#### 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 2023 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 10,000,952.78 元将在 7 日以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他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(净资产)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。

#### 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发行的证券不得超过该证券的 10%（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 2023 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 2023 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。本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023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	129,970.44	-	-	-	129,970.44
交易性金融资产	87,970,821.31	199,208,011.36	28,761,890.71	-	315,940,723.38
买入返售金融资产	952,657.89	-	-	-	952,657.89
资产总计	89,053,449.64	199,208,011.36	28,761,890.71	-	317,023,351.71
负债					
卖出回购金融资产款	10,000,952.78	-	-	-	10,000,952.78
应付管理人报酬	-	-	-	75,522.71	75,522.71
应付托管费	-	-	-	25,174.23	25,174.23
应付销售服务费	-	-	-	48.60	48.60
应交税费	-	-	-	47,733.70	47,733.70
其他负债	-	-	-	54,302.15	54,302.15
负债总计	10,000,952.78	-	-	202,781.39	10,203,734.17
利率敏感度缺口	79,052,496.86	199,208,011.36	28,761,890.71	-202,781.39	306,819,617.54

注：(1)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。

(2)本基金合同于2023年4月26日生效，本报告期自2023年4月26日至2023年6月30日，无上年度末数据。

#### 6.4.13.4.1.2 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（2023 年 6 月 30 日）
	市场利率上升 25 个基点	-1,112,948.11
市场利率下降 25 个基点	1,121,567.45	

注：本基金合同于 2023 年 4 月 26 日生效，本报告期自 2023 年 4 月 26 日至 2023 年 6 月 30 日，无上年度末数据。

#### 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固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险的敏感性分析

本基金主要投资于固定收益类品种，因此除市场利率以外的市场价格因素的变动对本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末
---------------	-----

	2023 年 6 月 30 日
第一层次	-
第二层次	315,940,723.38
第三层次	-
合计	315,940,723.38

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金本期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。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融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。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	315,940,723.38	99.66
	其中：债券	315,940,723.38	99.66
	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	952,657.89	0.30
	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	129,970.44	0.04
8	其他各项资产	-	-

9	合计	317,023,351.71	100.00
---	----	----------------	--------

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### 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

本基金本报告期末未持有股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

本基金本报告期无股票交易。

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

本基金本报告期无股票交易。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期无股票交易。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	30,268,118.36	9.87
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	107,457,074.47	35.02
5	企业短期融资券	28,845,526.56	9.40
6	中期票据	149,370,003.99	48.68
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	315,940,723.38	102.97



## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	220005	22 付息国债 05	300,000	30,268,118.36	9.87
2	1780298	17 武隆专项债 01	700,000	29,573,001.64	9.64
3	102300312	23 合川投资 MTN001	280,000	29,054,960.44	9.47
4	1880056	18 沪工投债	700,000	28,947,524.59	9.43
5	101900628	19 大足永晟 MTN001	280,000	28,857,176.39	9.41

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期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

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未参与国债期货投资。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期末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

本基金本报告期内未持有股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

### 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
兴华安聚纯债 A	22	13,687,024.14	300,012,500.00	99.63%	1,102,031.06	0.37%
兴华安聚纯债 C	442	658.57	0.00	0.00%	291,085.76	100.00%
合计	461	653,808.28	300,012,500.00	99.54%	1,393,116.82	0.46%

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，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额类别	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	兴华安聚纯债 A	13,014.41	0.0043%
	兴华安聚纯债 C	6,530.55	2.2435%
	合计	19,544.96	0.0065%

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，比例的分母采用下属分级基金

份额的合计数。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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	兴华安聚纯债 A	0~10
	兴华安聚纯债 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	兴华安聚纯债 A	0
	兴华安聚纯债 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，基金投资和研究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。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	兴华安聚纯债 A	兴华安聚纯债 C
基金合同生效日（2023 年 4 月 26 日）基金份额总额	600,496,932.13	288,242.53
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	629,608.22	107,434.38
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	300,012,009.29	104,591.15
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	301,114,531.06	291,085.76

注：(1) 总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

(2) 本基金合同于 2023 年 4 月 26 日生效。

## § 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

2023 年 4 月 28 日，原督察长王海滨先生任期届满离任，韩冰女士新任本基金管理人督察长。基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，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)，该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	20230301
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会青岛监管局
受到的具体措施类型	警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	违反《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》(证监会令第 151 号)
管理人采取整改措施的情况	-
其他	-
措施 2	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	高级管理人员
受到稽查或处罚等措施的时间	20230301
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会青岛监管局
受到的具体措施类型	警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	违反《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》(证监会令第 151 号)
管理人采取整改措施的情况	-
其他	-

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的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	
中信证券(山东)有限责任公司	2	-	-	1,758.13	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、个股分析的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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例

中信证 券(山 东)有 限责任 公司	20,010,742. 47	100.00 %	1,291,741,0 00.00	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设立青岛分公司的公告	中国证监会规定媒介	2023年1月5日
2	兴华安聚纯债债券型证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2023年4月17日
3	兴华安聚纯债债券型证券投资基金托管协议	中国证监会规定媒介	2023年4月17日
4	兴华安聚纯债债券型证券投资基金招募说明书	中国证监会规定媒介	2023年4月17日
5	兴华安聚纯债债券型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	中国证监会规定媒介	2023年4月17日
6	兴华安聚纯债债券型证券投资基金风险揭示书	中国证监会规定媒介	2023年4月17日
7	兴华安聚纯债债券型证券投资基金基金份额发售公告	中国证监会规定媒介	2023年4月17日
8	兴华安聚纯债债券型证券投资基金(A份额)基金产品资料概要	中国证监会规定媒介	2023年4月17日
9	兴华安聚纯债债券型证券投资基金(C份额)基金产品资料概要	中国证监会规定媒介	2023年4月17日
10	兴华基金管理有限公司关于公司股东变更的公告	中国证监会规定媒介	2023年4月20日
11	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	2023年4月20日
12	关于兴华安聚纯债债券型证券投资基金募集期提前结束的公告	中国证监会规定媒介	2023年4月25日
13	兴华安聚纯债债券型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定媒介	2023年4月27日
14	兴华安聚纯债债券型证券投资基金开放日常申购和赎回业务的公告	中国证监会规定媒介	2023年4月27日
15	兴华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2023年4月29日
16	兴华安聚纯债债券型证券投资基金暂停个人投资者申购业务的公告	中国证监会规定媒介	2023年5月9日
17	兴华基金管理有限公司关于谨防虚假	中国证监会规定媒介	2023年6月30日

	APP、网站、二维码、公众号诈骗的风险提示		
--	-----------------------	--	--

## § 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	20230426 -20230508	180,007,100.00	0.00	180,007,100.00	0.00	0.00%
	2	20230426 -20230630	300,012,500.00	0.00	0.00	300,012,500.00	99.54%
个人	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

(1) 本基金为债券型基金，除应开放期流动性需要而另有约定外，对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，债券受宏观经济周期及通胀率等影响较大，因而本基金受商业周期景气循环风险较大。

#### (2) 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。

#### (3) 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。

#### (4) 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、关于准予兴华安聚纯债债券型证券投资基金注册的批复
- 2、《兴华安聚纯债债券型证券投资基金基金合同》
- 3、《兴华安聚纯债债券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

### 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

2023 年 8 月 29 日