

# 兴华永兴混合型发起式证券投资基金

## 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：招商证券股份有限公司  
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法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<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 .....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	11
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 .....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	13
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 .....	13
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	14
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	14
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 .....	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表 .....	14
6.2 利润表 .....	15
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	17
6.4 报表附注 .....	19
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	40
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	41
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	45
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	45
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	45
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	45
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	45
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	46
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12	投资组合报告附注	46
<b>§ 8</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>47</b>
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
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	47
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况	48
<b>§ 9</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>48</b>
<b>§ 10</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>48</b>
10.1	基金份额持有人大会决议	48
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	48
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4	基金投资策略的改变	49
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	49
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	49
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8	其他重大事件	51
<b>§ 11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>52</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	52
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	53
<b>§ 12</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>53</b>
12.1	备查文件目录	53
12.2	存放地点	53
12.3	查阅方式	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	兴华永兴混合型发起式证券投资基金	
基金简称	兴华永兴混合发起式	
基金主代码	010756	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 12 月 16 日	
基金管理人	兴华基金管理有限公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	32,341,511.18 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分类基金的基金简称	兴华永兴混合发起式 A	兴华永兴混合发起式 C
下属分类基金的交易代码	010756	010757
报告期末下属分类基金的份额总额	31,671,007.48 份	670,503.70 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险、确保基金资产良好流动性的前提下，追求较高投资回报率，力争实现基金资产长期稳健增值。
投资策略	本基金的投资策略可分为资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、金融衍生品投资策略、资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，一般而言，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		兴华基金管理有限公司	招商证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	韩冰	韩鑫普
	联系电话	0532-80921021	0755-26951111
	电子邮箱	hanbing@xinghuafund.com.cn	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		4000678815	95565
传真		0532-80921032	0755-82960794
注册地址		山东省青岛市李沧区金水路 187 号 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 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	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.xinghuafund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	兴华基金管理有限公司	山东省青岛市李沧区金水路 187 号 2 号楼 8 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金类别	兴华永兴混合发起式 A	兴华永兴混合发起式 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期（2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日）	报告期（2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-3,127,093.02	-65,104.85
本期利润	-1,058,098.48	-25,463.75
加权平均基金份额本期利润	-0.0335	-0.0395
本期加权平均净值利润率	-4.12%	-4.91%
本期基金份额净值增长率	-4.16%	-4.35%
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	-7,905,531.86	-172,638.03
期末可供分配基金份额利润	-0.2496	-0.2575
期末基金资产净值	23,765,475.62	497,865.67
期末基金份额净值	0.7504	0.7425
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	-18.02%	-18.86%

注：(1) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

(2) 本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(3) 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分孰低数。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴华永兴混合发起式 A

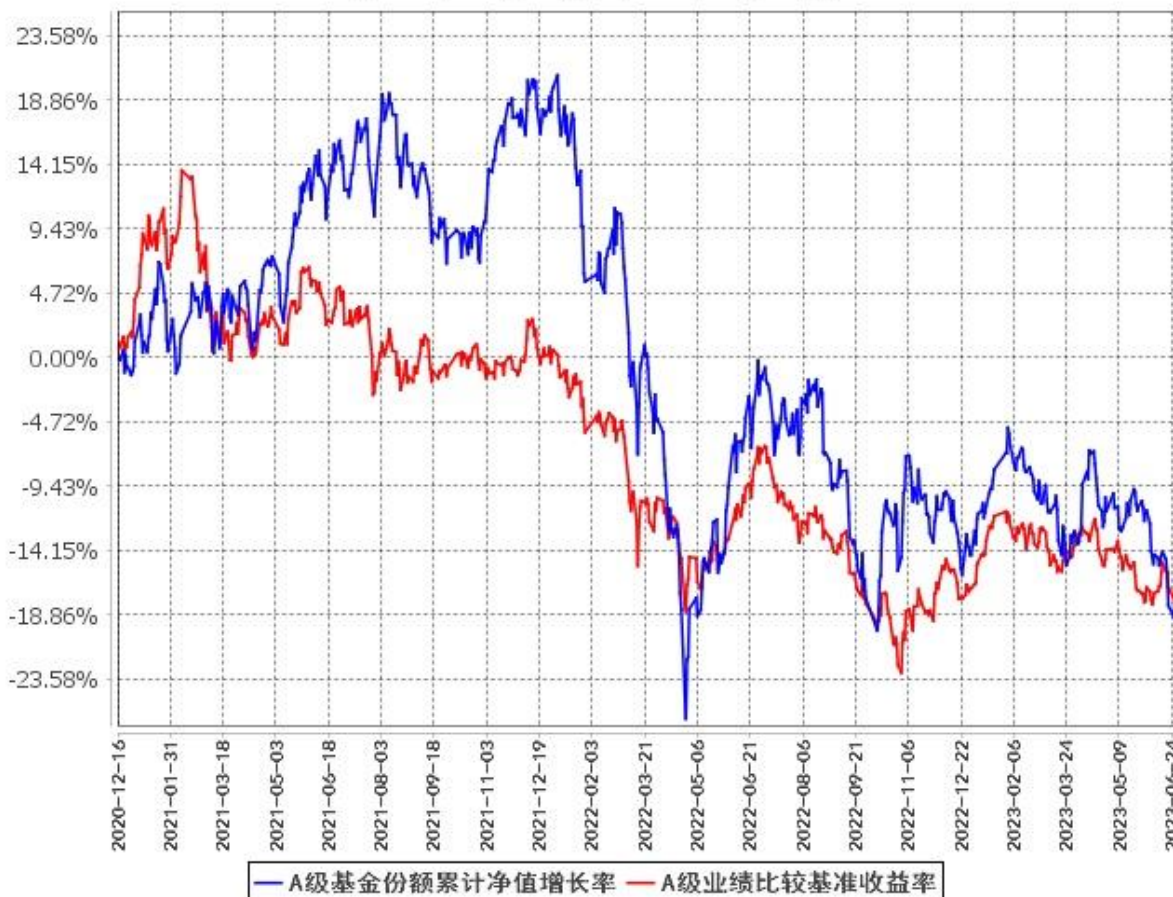
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-6.89%	1.00%	0.97%	0.70%	-7.86%	0.30%
过去三个月	-6.07%	1.09%	-3.93%	0.66%	-2.14%	0.43%
过去六个月	-4.16%	1.06%	-0.29%	0.67%	-3.87%	0.39%
过去一年	-16.87%	1.30%	-11.23%	0.79%	-5.64%	0.51%
自基金合同生效起至今	-18.02%	1.40%	-17.14%	0.93%	-0.88%	0.47%

兴华永兴混合发起式 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-6.92%	1.00%	0.97%	0.70%	-7.89%	0.30%
过去三个月	-6.17%	1.09%	-3.93%	0.66%	-2.24%	0.43%
过去六个月	-4.35%	1.06%	-0.29%	0.67%	-4.06%	0.39%
过去一年	-17.21%	1.30%	-11.23%	0.79%	-5.98%	0.51%
自基金合同生效起至今	-18.86%	1.40%	-17.14%	0.93%	-1.72%	0.47%

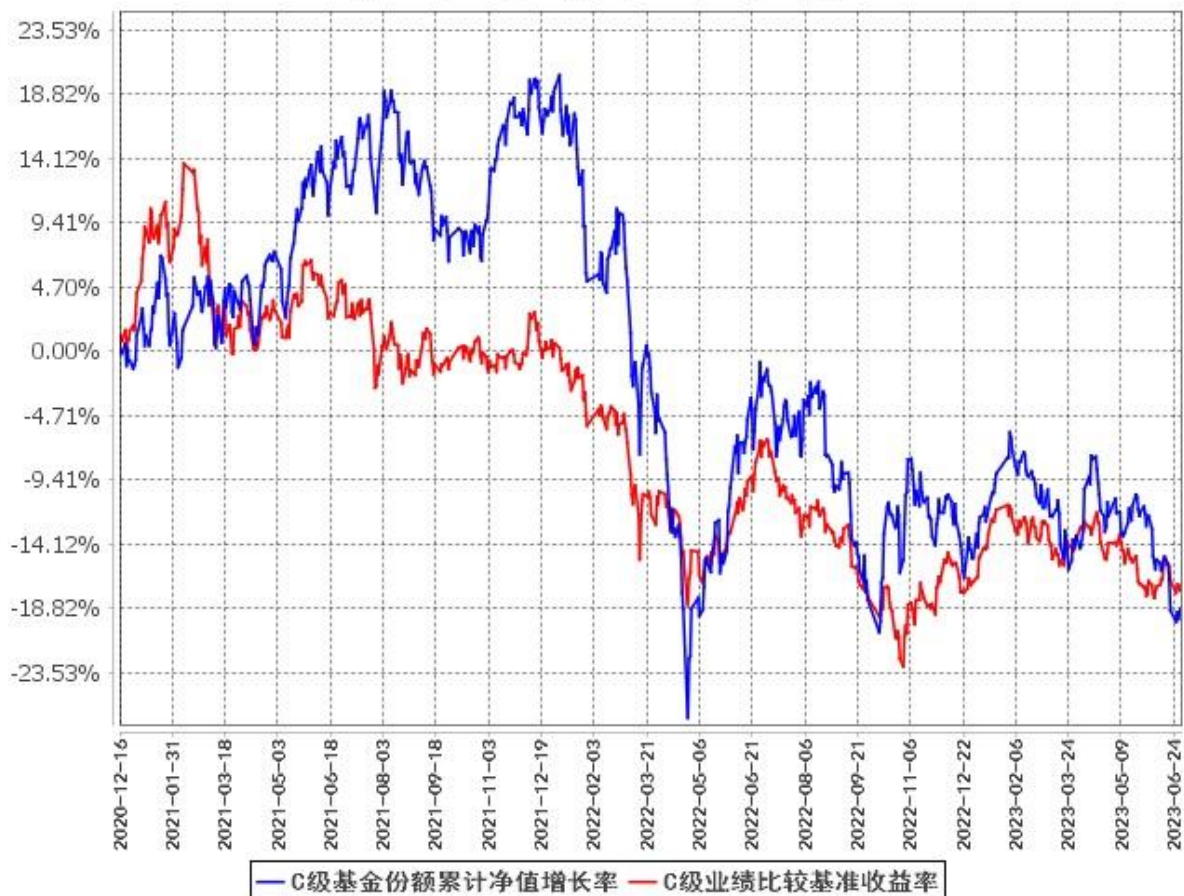
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

**A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图**  
(2020年12月16日至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**  
(2020年12月16日至2023年6月30日)



注：(1)本基金合同于2020年12月16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。

## § 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		
冷文鹏	基金经理	2020 年 12 月 16 日	2023 年 2 月 7 日	16 年	冷文鹏先生，中国国籍，中国人民银行研究生部金融学硕士，具有基金从业资格。曾先后就职于华夏基金管理有限公司高级经理，新华基金管理有限公司研究部研究员，华泰柏瑞基金管理有限公司高级研究员，西部利得基金管理有限公司基金经理，国新投资有限公司投资部、研究部执行总经理、兴华基金管理有限公司权益公募部总经理。
徐迅	基金经理	2023 年 2 月 7 日	-	9 年	徐迅先生，中国国籍，伦敦大学国王学院金融数学硕士，具有基金从业资格。曾先后就职于天弘基金管理有限公司业务经理，天弘创新资产管理有限公司投资经理，方正证券股份有限公司投资经理。现任兴华基金管理有限公司权益公募部、权益研究部业务主管。

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。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

本基金主要围绕医药板块进行布局，投资风格方面成长与价值兼顾，在今年相对弱势的市场选择一些估值较低、盈利能力稳健、现金流良好的公司作为底仓，同时选取一些高成长性的创新药公司作为弹性仓位，以增加组合的弹性。

在第二季度我们降低了对于外部环境敏感的公司持仓，增加了国企改革类的公司持仓，以求降低极端风险下的组合回撤，并希望通过国家正在推进的国企改革来取得更好的回报。

医药板块在下半年的机会会更多一些，比如重点创新药品种数据读出、半年报中对于院内复苏的数据确认等等，从长期维度来看，医药板块作为老百姓的刚需，即便未来经济形势仍然看不清楚，医药板块整体业绩表现也会相对稳定，站在较低的估值水平上，我们对于医药板块充满信心。

第二季度有五个板块跑赢医药指数，分别为血液制品、医药流通、化学制剂、中药、医疗设备，其余板块跑输，其中 CXO、疫苗、医疗服务大幅跑输指数。

创新药：创新药第二季度呈现过山车走势，4 月份由于海外创新药学术会议数据读出出现一波上涨，随后两个月已将所有涨幅全部吐出，且上半年创新药获批进展比预期慢，CDE 对于新药临床试验数据有新的要求，加之泽布替尼海外专利受到跨国制药巨头挑战，因此表现比较疲软，在当前

较为悲观的市场环境下，创新药由于采取未来现金流折现的方式进行估值，且部分创新药企业当前处于亏损状态，因此杀估值效应明显。对于泽布替尼我们认为由于被挑战的专利为近期刚刚拿到的专利，而泽布替尼临床数据读出时间早于该专利的获取时间，因此最终付出较小成本达成庭外和解的概率较大，故对于核心创新药公司不必过于悲观。

**医疗器械：**医疗器械板块分为设备和耗材两块，设备方面受益于医院持续扩容，国产设备企业迅速扩容，投资逻辑不错；但耗材方面，由于仿制药集采接近尾声，耗材集采将逐步进入高峰，应当规避具有潜在集采风险的品种，不要试图分析集采后量能否补价。对于已经集采过的高耗品种，考虑到今年门诊需求修复的不错，可以给予一定的关注。

**中药：**中药板块表现更好的是国有企业，该板块政策环境相对温暖，而且并不太受到外部环境的影响，甚至受益于外部环境趋紧的情况，由于一些国有的中药公司盈利能力强、估值合理、现金流好，并且具备国企改革、降本增效的想象空间，这类资产在当前环境下备受青睐；

**医药流通：**医药流通板块应给与更高重视，医药流通企业更多的是国有企业，且基本不会受到国际局势的影响，是价值风格比较容易配置的板块，与国有中药企业类似，这类公司同样应当给予更多关注；

**CXO：**根据动脉网的初步统计，6月全球数据环比增长约14%，同比下降约36%，其中医药生物领域环比持平，同比下降约28%。Q2整体来看，全球数据环比增长9%，同比下降22%。创新药海外投融资环境略有改善，改善趋势仍然需要Q3及以后季度观察、确认。与此同时，我们需要警惕当下外部环境对该板块带来的逻辑变化，我们还不能观察到外围局势改善的出现，当前对于CXO应保持谨慎乐观态度。

**医院：**医疗服务一直以来是医药核心关注板块，由于其空间大、成长性好、竞争壁垒强，市场一直给予较高的估值，由于整个市场风险偏好下移，医疗服务估值杀跌较为明显，优质医疗服务公司已经进入3-5年来估值底部区域，应当给予更多关注。

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

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末兴华永兴混合发起式A的基金份额净值为0.7504元，本报告期基金份额净值增长率为-4.16%；截至本报告期末兴华永兴混合发起式C的基金份额净值为0.7425元，本报告期基金份额净值增长率为-4.35%；同期业绩比较基准收益率为-0.29%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场第二季度出现显著回落，主要原因在于疫情管控放开后 1-2 月份需求端集中释放，而 3-6 月份需求端在集中释放后迅速回落，无论是地产数据还是消费数据表现均较为疲软，居民资产负债表修复仍需时间，同时收入增长预期降低导致消费意愿被压制。

消费意愿的压制导致库存提升和价格体系的难以为继，造成通缩预期增强，通缩预期降低市场风险偏好，从而对于权益市场带来整体杀估值的结果。

医药市场二季度经历了多个事件冲击，比如中成药集采事件、CXO 头部公司下调增长预期事件、创新药头部公司核心药品被提起专利诉讼事件等等，在这些事件的冲击下，中药板块、CXO 板块、创新药板块存在较大压力，医药板块整体在第二季度承压，估值进一步被压缩。

展望下半年，地产数据和消费数据仍为核心观察指标，二者下行趋势在短期内有望边际减缓，或有的消费刺激政策也有望在下半年落地，因此对于下半年，可以乐观一些。

#### 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

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

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《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

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

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：兴华永兴混合型发起式证券投资基金

报告截止日：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	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,448,569.48	1,433,105.90
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	22,855,782.15	23,579,602.00
其中：股票投资		22,855,782.15	23,579,602.00
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		10,343.57	592.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		24,314,695.20	25,013,300.88
<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>上年度末 2022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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		19.62	304.79
应付管理人报酬		31,102.82	32,540.78
应付托管费		5,183.80	5,423.46
应付销售服务费		171.28	167.47
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	14,876.39	80,000.00
负债合计		51,353.91	118,436.50
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	32,341,511.18	31,800,686.80
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-8,078,169.89	-6,905,822.42
净资产合计		24,263,341.29	24,894,864.38
负债和净资产总计		24,314,695.20	25,013,300.88

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额总额 32,341,511.18 份，其中兴华永兴混合发起式 A 基金份额净值 0.7504 元，基金份额总额 31,671,007.48 份；兴华永兴混合发起式 C 基金份额净值 0.7425 元，基金份额总额 670,503.70 份。

## 6.2 利润表

会计主体：兴华永兴混合型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-889,664.02	-5,893,417.59
1. 利息收入		12,833.24	11,178.09
其中：存款利息收入	6.4.7.9	6,590.36	11,173.95
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		6,242.88	4.14
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-3,012,106.63	-1,549,116.23
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-3,187,175.51	-1,681,067.60
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	11,633.12
资产支持证券投资		-	-
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	175,068.88	120,318.25
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	2,108,635.64	-4,359,089.13
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	973.73	3,609.68
<b>减：二、营业总支出</b>		193,898.21	289,133.49
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	194,749.35	212,598.47
2. 托管费	6.4.10.2.2	32,458.24	35,433.06
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,024.56	1,204.52
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-



7. 税金及附加		-	0.03
8. 其他费用	6.4.7.18	-34,333.94	39,897.41
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-1,083,562.23	-6,182,551.08
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-1,083,562.23	-6,182,551.08
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-1,083,562.23	-6,182,551.08

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：兴华永兴混合型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 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）	31,800,686.80	-	-6,905,822.42	24,894,864.38
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）	31,800,686.80	-	-6,905,822.42	24,894,864.38
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	540,824.38	-	-1,172,347.47	-631,523.09
（一）、综合收益总额	-	-	-1,083,562.23	-1,083,562.23
（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）	540,824.38	-	-88,785.24	452,039.14
其中：1. 基金申购款	1,662,057.58	-	-308,665.17	1,353,392.41
2. 基金赎回款	-1,121,233.20	-	219,879.93	-901,353.27

(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)	32,341,511.18	-	-8,078,169.89	24,263,341.29
项目	上年度可比期间			
	2022年1月1日至2022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)	31,678,520.31	-	3,050,180.17	34,728,700.48
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)	31,678,520.31	-	3,050,180.17	34,728,700.48
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	75,181.81	-	-6,142,836.52	-6,067,654.71
(一)、综合收益总额	-	-	-6,182,551.08	-6,182,551.08
(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)	75,181.81	-	39,714.56	114,896.37
其中: 1. 基金申购款	1,270,179.67	-	-89,966.46	1,180,213.21
2. 基金赎回款	-1,194,997.86	-	129,681.02	-1,065,316.84
(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）	31,753,702.12	-	-3,092,656.35	28,661,045.77
-----------------	---------------	---	---------------	---------------

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

兴华永兴混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]3016号《关于准予兴华永兴混合型发起式证券投资基金注册的批复》准予注册,由兴华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《兴华永兴混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式发起式基金,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12,264,303.66元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第1090号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《兴华永兴混合型发起式证券投资基金基金合同》于2020年12月16日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为12,266,436.69份基金份额,其中认购资金利息折合2,133.03份基金份额。本基金的基金管理人为兴华基金管理有限公司,基金托管人为招商证券股份有限公司(以下简称“招商证券”)。

根据《兴华永兴混合型发起式证券投资基金基金合同》和《兴华永兴混合型发起式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、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同类别:在投资者认购/申购基金时收取认购/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为A类基金份额;在投资者认购/申购基金时不收取认购/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、C类两种收费模式并存,由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额分别计算基金份额净值。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《兴华永兴混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证

监会核准或注册上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、二级资本债、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、金融衍生品(包括股指期货、国债期货、股票期权)以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为 60%-95%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,保持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、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《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》、《兴华永兴混合型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定,发起式基金的基金合同生效三年后,若基金资产净值低于人民币两亿元的,基金合同自动终止。于 2023 年 06 月 30 日,本基金的基金资产净值为 24,263,341.29 元,且本基金的基金合同将于未来 12 个月内生效满三年,本基金的管理人预计基金资产净值届时将高于人民币两亿元,故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 1 月 1 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 1 月 1 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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

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

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 差错更正的说明

本基金本报告期间无需说明的会计差错更正。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

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

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

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

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

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

比例计算缴纳。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	899,067.09
等于：本金	898,732.14
加：应计利息	334.95
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	549,502.39
等于：本金	549,475.68
加：应计利息	26.71
减：坏账准备	-
合计	1,448,569.48

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。

#### 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	25,662,429.83	-	22,855,782.15	-2,806,647.68
贵金属投资-金交所黄金 合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	25,662,429.83	-	22,855,782.15	-2,806,647.68

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末，本基金未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 其他资产

本报告期末，本基金无其他资产。

### 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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	14,876.39
合计	14,876.39

### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

兴华永兴混合发起式 A		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	31,176,870.26	31,176,870.26
本期申购	1,224,963.70	1,224,963.70
本期赎回（以“-”号填列）	-730,826.48	-730,826.48
本期末	31,671,007.48	31,671,007.48

金额单位：人民币元

兴华永兴混合发起式 C		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	623,816.54	623,816.54
本期申购	437,093.88	437,093.88
本期赎回(以“-”号填列)	-390,406.72	-390,406.72
本期末	670,503.70	670,503.70

注：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。

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

兴华永兴混合发起式 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-1,201,122.61	-5,565,133.00	-6,766,255.61
本期利润	-3,127,093.02	2,068,994.54	-1,058,098.48
本期基金份额交易产生的变动数	-72,092.80	-9,084.97	-81,177.77
其中：基金申购款	-153,006.37	-71,819.72	-224,826.09
基金赎回款	80,913.57	62,734.75	143,648.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,400,308.43	-3,505,223.43	-7,905,531.86

单位：人民币元

兴华永兴混合发起式 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-28,506.23	-111,060.58	-139,566.81
本期利润	-65,104.85	39,641.10	-25,463.75
本期基金份额交易产生的变动数	-4,780.74	-2,826.73	-7,607.47
其中：基金申购款	-53,490.85	-30,348.23	-83,839.08
基金赎回款	48,710.11	27,521.50	76,231.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-98,391.82	-74,246.21	-172,638.03

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日 至 2023 年 6 月 30 日	
	活期存款利息收入	5,545.73



定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,044.63
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	6,590.36

#### 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

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日 至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-3,187,175.51
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	-3,187,175.51

##### 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日 至2023年6月30日
卖出股票成交总额	103,710,522.10
减：卖出股票成本总额	106,689,467.19
减：交易费用	208,230.42
买卖股票差价收入	-3,187,175.51

#### 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

本报告期，本基金无债券投资收益。

#### 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

单位: 人民币元

项目	本期 2023年1月1日 至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	175,068.88
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	175,068.88

### 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1月1日 至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	2,108,635.64
——股票投资	2,108,635.64
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减: 应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	2,108,635.64

### 6.4.7.16 其他收入

单位: 人民币元

项目	本期 2023年1月1日 至2023年6月30日
基金赎回费收入	973.73
合计	973.73

#### 6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日 至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	14,876.39
信息披露费	-50,000.00
证券出借违约金	-
银行费用	389.67
其他	400.00
合计	-34,333.94

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

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日 至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日 至2022年6月30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
招商证券股份有限公司	205,191,547.80	98.86%	25,423,648.85	100.00%

##### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日 至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日 至2022年6月30日
-------	--------------------------------	-------------------------------------

	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
-	-	-	71,404.86	100.00%

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日 至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日 至2022年6月30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
招商证券股份有限公司	67,500,000.00	95.40%	77,000.00	100.00%

### 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至 2023年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券股份有限公司	87,985.19	99.36%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至 2022年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券股份有限公司	11,018.63	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，已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。

### 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 1 月 1 日 至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日 至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	194,749.35	212,598.47
其中：支付销售机构的客户维护费	10,121.91	9,263.65

注：(1)自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 7 月 31 日，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 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：  
日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

为更好地满足广大投资者的投资理财需求，降低投资者的理财成本，经与本基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，本基金管理人决定自 2023 年 8 月 1 日起，调低本基金的管理费率。自 2023 年 8 月 1 日起，支付基金管理人兴华基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20%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：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.20%/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 1 月 1 日 至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日 至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	32,458.24	35,433.06

注：自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 7 月 31 日，支付基金托管人招商证券股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

为更好地满足广大投资者的投资理财需求，降低投资者的理财成本，经与本基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，本基金管理人决定自 2023 年 8 月 1 日起，调低本基金的托管费率。自 2023 年 8 月 1 日起，支付基金托管人招商证券股份有限公司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。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费 的各关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴华永兴混合发起式 A	兴华永兴混合发起式 C	合计
兴华基金管理有 限公司	0.00	282.88	282.88
招商证券股份有 限公司	0.00	10.91	10.91
合计	0.00	293.79	293.79
获得销售服务费 的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴华永兴混合发起式 A	兴华永兴混合发起式 C	合计
兴华基金管理有 限公司	0.00	650.01	650.01
招商证券股份有 限公司	0.00	61.53	61.53
合计	0.00	711.54	711.54

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

(2)本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本报告期，本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

##### 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

本报告期内，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

本报告期内，本基金未与关联方进行转融通证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日 至 2023 年 6 月 30 日

	兴华永兴混合发起式 A	兴华永兴混合发起式 C
基金合同生效日（2020 年 12 月 16 日）持有的基金份额	10,001,800.18	0.00
报告期初持有的基金份额	28,405,289.52	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	28,405,289.52	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	89.69%	0.00%

项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日 至 2022 年 6 月 30 日	
	兴华永兴混合发起式 A	兴华永兴混合发起式 C
基金合同生效日（2020 年 12 月 16 日）持有的基金份额	10,001,800.18	0.00
报告期初持有的基金份额	28,405,289.52	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	28,405,289.52	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	91.02%	0.00%

注：基金管理人兴华基金管理有限公司投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

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

份额单位：份

兴华永兴混合发起式 A				
关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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
张磊	2,067.97	0.01%	2,067.97	0.01%
韩光华	10,992.67	0.03%	10,992.67	0.04%

#### 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 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商证券股份有限公司	899,067.09	5,545.73	866,985.76	10,835.40

注：本基金的活期银行存款由基金托管人招商证券股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期，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

本报告期末，本基金无银行间市场债券正回购。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末，本基金无交易所市场债券正回购。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本报告期末，本基金无转融通证券出借业务余额。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为偏股混合型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、

货币市场基金。本基金投资的金融工具主要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招商证券股份有限公司开立于招商银行股份有限公司的托管账户，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。

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有债券和资产支持证券投资。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

于 2023 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短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%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通

暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 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等。

##### 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	1,448,569.48	-	-	-	1,448,569.48
交易性金融资产	-	-	-	22,855,782.15	22,855,782.15
应收申购款	-	-	-	10,343.57	10,343.57
资产总计	1,448,569.48	-	-	22,866,125.72	24,314,695.20
负债					
应付赎回款	-	-	-	19.62	19.62
应付管理人报酬	-	-	-	31,102.82	31,102.82
应付托管费	-	-	-	5,183.80	5,183.80
应付销售服务费	-	-	-	171.28	171.28
其他负债	-	-	-	14,876.39	14,876.39
负债总计	-	-	-	51,353.91	51,353.91
利率敏感度缺口	1,448,569.48	-	-	22,814,771.81	24,263,341.29
上年度末 2022 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	1,433,105.90	-	-	-	1,433,105.90
交易性金融资产	-	-	-	23,579,602.00	23,579,602.00
应收申购款	-	-	-	592.98	592.98
资产总计	1,433,105.90	-	-	23,580,194.98	25,013,300.88
负债					
应付赎回款	-	-	-	304.79	304.79
应付管理人报酬	-	-	-	32,540.78	32,540.78
应付托管费	-	-	-	5,423.46	5,423.46
应付销售服务费	-	-	-	167.47	167.47
其他负债	-	-	-	80,000.00	80,000.00
负债总计	-	-	-	118,436.50	118,436.50
利率敏感度缺口	1,433,105.90	-	-	23,461,758.48	24,894,864.38

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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外

的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；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。本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的 60-95%，本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	22,855,782.15	94.20	23,579,602.00	94.72
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	22,855,782.15	94.20	23,579,602.00	94.72

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末(2023 年 6 月 30 日)	上年度末(2022 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准上升 5%	593,268.60	1,404,926.78

业绩比较基准下 降 5%	-593,268.60	-1,404,926.78
-----------------	-------------	---------------

#### 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	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	22,855,782.15	22,673,842.00
第二层次	-	905,760.00
第三层次	-	-
合计	22,855,782.15	23,579,602.00

###### 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。

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的公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### 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

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。

### § 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	22,855,782.15	94.00
	其中：股票	22,855,782.15	94.00
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,448,569.48	5.96
8	其他各项资产	10,343.57	0.04
9	合计	24,314,695.20	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

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	13,525,375.00	55.74
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	3,233,590.00	13.33
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,860,048.00	7.67
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-



0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,236,769.15	17.46
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	22,855,782.15	94.20

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通标的股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600085	同仁堂	26,700	1,536,852.00	6.33
2	600329	达仁堂	33,700	1,512,793.00	6.23
3	688235	百济神州	13,500	1,472,985.00	6.07
4	002821	凯莱英	12,400	1,461,464.00	6.02
5	002422	科伦药业	41,000	1,216,880.00	5.02
6	000568	泸州老窖	5,800	1,215,506.00	5.01
7	603368	柳药集团	47,000	1,161,370.00	4.79
8	600511	国药股份	28,400	1,103,340.00	4.55
9	600422	昆药集团	52,000	1,077,440.00	4.44
10	300015	爱尔眼科	52,262	969,460.10	4.00
11	301267	华夏眼科	15,899	969,044.05	3.99
12	002727	一心堂	36,700	968,880.00	3.99
13	301239	普瑞眼科	9,800	961,184.00	3.96
14	000516	国际医学	114,100	959,581.00	3.95
15	688192	迪哲医药	27,300	947,310.00	3.90
16	300759	康龙化成	24,500	937,860.00	3.87
17	603259	药明康德	14,800	922,188.00	3.80
18	600062	华润双鹤	50,000	871,000.00	3.59
19	000999	华润三九	9,800	594,468.00	2.45
20	600129	太极集团	7,500	446,175.00	1.84
21	688212	澳华内镜	6,000	407,400.00	1.68
22	603882	金域医学	5,000	377,500.00	1.56
23	600519	贵州茅台	200	338,200.00	1.39
24	000858	五粮液	1,400	228,998.00	0.94
25	000596	古井贡酒	800	197,904.00	0.82

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	688235	百济神州	3,612,102.03	14.51
2	600519	贵州茅台	3,371,608.00	13.54
3	002727	一心堂	3,351,154.00	13.46
4	000999	华润三九	3,341,605.80	13.42
5	600557	康缘药业	3,098,911.00	12.45
6	600329	达仁堂	3,055,975.00	12.28
7	300396	迪瑞医疗	2,793,678.00	11.22
8	002821	凯莱英	2,726,538.00	10.95
9	300759	康龙化成	2,696,769.00	10.83
10	300347	泰格医药	2,649,686.00	10.64
11	000568	泸州老窖	2,397,101.00	9.63
12	300633	开立医疗	2,352,180.68	9.45
13	688120	华海清科	2,342,062.65	9.41
14	600976	健民集团	2,319,207.53	9.32
15	000739	普洛药业	2,145,477.00	8.62
16	600085	同仁堂	2,034,130.00	8.17
17	300003	乐普医疗	2,008,101.00	8.07
18	688192	迪哲医药	1,923,248.45	7.73
19	300015	爱尔眼科	1,890,601.00	7.59
20	300760	迈瑞医疗	1,807,942.00	7.26
21	603658	安图生物	1,756,433.00	7.06
22	603259	药明康德	1,716,572.00	6.90
23	603368	柳药集团	1,678,597.00	6.74
24	600422	昆药集团	1,671,138.00	6.71
25	300832	新产业	1,608,459.00	6.46
26	600129	太极集团	1,550,132.00	6.23
27	002737	葵花药业	1,543,207.82	6.20
28	301239	普瑞眼科	1,520,833.00	6.11
29	600750	江中药业	1,461,096.00	5.87
30	603896	寿仙谷	1,453,829.00	5.84
31	000963	华东医药	1,446,927.00	5.81
32	688428	诺诚健华	1,431,887.07	5.75
33	000516	国际医学	1,423,017.00	5.72
34	600062	华润双鹤	1,355,790.00	5.45
35	301267	华夏眼科	1,339,466.08	5.38
36	002422	科伦药业	1,325,368.00	5.32

37	688105	诺唯赞	1,311,703.46	5.27
38	605266	健之佳	1,305,396.00	5.24
39	000915	华特达因	1,251,991.00	5.03
40	603309	维力医疗	1,223,438.00	4.91
41	603517	绝味食品	1,171,641.00	4.71
42	000596	古井贡酒	1,163,294.00	4.67
43	688677	海泰新光	1,151,280.04	4.62
44	688617	惠泰医疗	1,148,775.10	4.61
45	688133	泰坦科技	1,141,701.38	4.59
46	688690	纳微科技	1,111,135.41	4.46
47	000423	东阿阿胶	1,096,810.00	4.41
48	600809	山西汾酒	1,095,234.00	4.40
49	600521	华海药业	1,088,210.00	4.37
50	688390	固德威	1,065,707.85	4.28
51	600511	国药股份	1,009,602.00	4.06
52	300896	爱美客	960,469.00	3.86
53	603883	老百姓	923,690.00	3.71
54	688016	心脉医疗	779,041.00	3.13
55	603127	昭衍新药	730,816.00	2.94
56	688658	悦康药业	564,814.54	2.27
57	600702	舍得酒业	510,531.00	2.05

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600557	康缘药业	3,386,929.00	13.60
2	000999	华润三九	3,344,978.00	13.44
3	600519	贵州茅台	3,127,805.00	12.56
4	300396	迪瑞医疗	2,958,378.96	11.88
5	300633	开立医疗	2,475,964.58	9.95
6	688120	华海清科	2,468,199.54	9.91
7	600976	健民集团	2,338,756.00	9.39
8	002727	一心堂	2,283,522.00	9.17
9	300003	乐普医疗	1,923,255.00	7.73
10	688235	百济神州	1,912,172.15	7.68
11	688016	心脉医疗	1,906,767.77	7.66
12	300347	泰格医药	1,756,005.00	7.05
13	300760	迈瑞医疗	1,755,839.00	7.05
14	000739	普洛药业	1,750,740.00	7.03
15	600329	达仁堂	1,720,951.00	6.91

16	688428	诺诚健华	1,615,598.94	6.49
17	603658	安图生物	1,573,414.00	6.32
18	002737	葵花药业	1,539,285.00	6.18
19	300014	亿纬锂能	1,525,027.00	6.13
20	300832	新产业	1,523,739.00	6.12
21	600750	江中药业	1,474,733.00	5.92
22	300244	迪安诊断	1,450,216.00	5.83
23	603896	寿仙谷	1,387,243.00	5.57
24	605266	健之佳	1,306,449.00	5.25
25	000963	华东医药	1,299,843.00	5.22
26	300759	康龙化成	1,287,648.89	5.17
27	002027	分众传媒	1,282,000.00	5.15
28	603309	维力医疗	1,265,214.00	5.08
29	000568	泸州老窖	1,219,091.00	4.90
30	600129	太极集团	1,212,564.00	4.87
31	600483	福能股份	1,209,505.00	4.86
32	600366	宁波韵升	1,199,436.00	4.82
33	688617	惠泰医疗	1,194,831.93	4.80
34	688105	诺唯赞	1,190,806.00	4.78
35	000423	东阿阿胶	1,160,836.00	4.66
36	600549	厦门钨业	1,136,360.00	4.56
37	688133	泰坦科技	1,129,980.00	4.54
38	603678	火炬电子	1,128,292.00	4.53
39	603517	绝味食品	1,120,987.00	4.50
40	688677	海泰新光	1,112,070.60	4.47
41	000887	中鼎股份	1,100,490.00	4.42
42	300850	新强联	1,084,959.00	4.36
43	600809	山西汾酒	1,083,706.00	4.35
44	002074	国轩高科	1,074,528.00	4.32
45	600905	三峡能源	1,071,600.00	4.30
46	688690	纳微科技	1,069,731.60	4.30
47	000915	华特达因	1,058,549.00	4.25
48	603032	德新科技	1,054,719.00	4.24
49	600521	华海药业	1,040,805.00	4.18
50	601238	广汽集团	999,320.00	4.01
51	601615	明阳智能	970,800.00	3.90
52	603883	老百姓	964,061.00	3.87
53	688778	厦钨新能	954,476.64	3.83
54	688390	固德威	951,824.50	3.82
55	002594	比亚迪	941,649.00	3.78
56	300896	爱美客	940,662.00	3.78
57	000596	古井贡酒	925,010.00	3.72
58	002821	凯莱英	895,276.00	3.60

59	600703	三安光电	858,700.00	3.45
60	688192	迪哲医药	822,147.60	3.30
61	600745	闻泰科技	814,280.00	3.27
62	301155	海力风电	807,671.00	3.24
63	300015	爱尔眼科	790,050.00	3.17
64	600884	杉杉股份	761,892.00	3.06
65	600460	士兰微	751,800.00	3.02
66	603127	昭衍新药	710,190.00	2.85
67	600392	盛和资源	703,095.00	2.82
68	002475	立讯精密	692,690.00	2.78
69	688658	悦康药业	605,810.00	2.43
70	603368	柳药集团	594,956.00	2.39
71	600422	昆药集团	589,019.00	2.37
72	300379	东方通	573,210.00	2.30
73	600702	舍得酒业	509,717.00	2.05

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	103,857,011.70
卖出股票收入（成交）总额	103,710,522.10

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。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，本基金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

本报告期内，本基金未参与国债期货投资。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金未参与国债期货投资。

## 7.12 投资组合报告附注

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

报告期内本基金投资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。

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

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10,343.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,343.57

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额类别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
兴华永兴混合发起式 A	441	71,816.34	28,405,289.52	89.69%	3,265,717.96	10.31%
兴华永兴混合发起式 C	371	1,807.29	0.00	0.00%	670,503.70	100.00%
合计	774	41,784.90	28,405,289.52	87.83%	3,936,221.66	12.17%

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	兴华永兴混合发起式 A	1,452,832.24	4.5873%
	兴华永兴混合发起式 C	8,791.68	1.3112%
	合计	1,461,623.92	4.5193%

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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	兴华永兴混合发起式 A	0~10
	兴华永兴混合发起式 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	兴华永兴混合发起式 A	10~50
	兴华永兴混合发起式 C	0
	合计	10~50

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 10-50 万份。

#### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,800.18	30.93%	10,001,800.18	30.93%	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,800.18	30.93%	10,001,800.18	30.93%	三年

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	兴华永兴混合发起式 A	兴华永兴混合发起式 C
基金合同生效日（2020 年 12 月 16 日）基金份额总额	12,030,502.49	235,934.20
本报告期期初基金份额总额	31,176,870.26	623,816.54
本报告期基金总申购份额	1,224,963.70	437,093.88
减：本报告期基金总赎回份额	730,826.48	390,406.72
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	31,671,007.48	670,503.70

注：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。

### § 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、公募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，基金托管人及其托管业务高级管理人员未受稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券股份有限公司	2	205,191,547.80	98.86%	87,985.19	99.36%	
中信证券(山东)有限责任公司	2	2,375,986.00	1.14%	566.83	0.64%	

注：(1)报告期内未新增或退租证券公司交易单元。

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

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

(3)基金交易单元的选择程序如下：

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

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名	债券交易	债券回购交易	权证交易	基金交易
-----	------	--------	------	------

称	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
招商证 券股份 有限公 司			67,500,000.00	95.40%				
中信证 券(山 东)有 限责任 公司			3,255,000.00	4.60%				

## 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	兴华永兴混合型发起式证券投资基金2022年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2023年1月20日
3	关于兴华永兴混合型发起式证券投资基金基金经理变更的公告	中国证监会规定媒介	2023年2月7日
4	兴华永兴混合型发起式证券投资基金招募说明书及基金产品资料概要更新提示性公告	中国证监会规定媒介	2023年2月9日
5	兴华永兴混合型发起式证券投资基金招募说明书(2023年2月更新)	中国证监会规定媒介	2023年2月9日
6	兴华永兴混合型发起式证券投资基金(A份额)基金产品资料概要更新(2023年2月更新)	中国证监会规定媒介	2023年2月9日
7	兴华永兴混合型发起式证券投资基金(C份额)基金产品资料概要更新(2023年2月更新)	中国证监会规定媒介	2023年2月9日
8	兴华永兴混合型发起式证券投资基金2022年年度报告	中国证监会规定媒介	2023年3月30日
9	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
10	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
11	兴华永兴混合型发起式证券投资基金2023年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2023年4月21日

12	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
13	兴华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增光大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	2023 年 6 月 16 日
14	兴华基金管理有限公司关于谨防虚假 APP、网站、二维码、公众号诈骗的风险提示	中国证监会规定媒介	2023 年 6 月 30 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20230101-20230630	28,405,289.52	0.00	0.00	28,405,289.52	87.83%
个人	-	-	-	-	-	-	-

**产品特有风险**

(1) 本基金为发起式基金,《基金合同》生效满 3 年之日(指自然日),若基金资产净值低于 2 亿元,无需召开基金持有人大会审议,基金合同应当终止,且不得通过召开基金持有人大会的方式延续。若届时法律法规或中国证监会规定发生变化,上述终止规定被取消、更改或补充,则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。投资者将面临基金合同可能终止的不确定性风险。

(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，基金合同生效满 3 年后继续存续的，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案。机构投资者在开放日大额赎回后，可能出现本基金的基金资产净值连续 60 个工作日低于 5,000 万元情形。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

### 12.3 查阅方式

投资者可以在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

兴华基金管理有限公司

2023 年 8 月 29 日