

兴合安迎混合型证券投资基金

2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:兴合基金管理有限公司

基金托管人:华安证券股份有限公司

送出日期:2024 年 08 月 27 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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。

基金托管人华安证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年8月16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2024年1月1日起至2024年6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
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
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
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遵规守信情况的说明	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	12
4.7 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
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50
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	50
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	50
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	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	50
§8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
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情况	52
§9 开放式基金份额变动	52
§10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
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	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4 基金投资策略的改变	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
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	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
10.8 其他重大事件	55
§11 影响投资者决策的其他重要信息	56
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	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	57
§12 备查文件目录	57
12.1 备查文件目录	57
12.2 存放地点	57
12.3 查阅方式	57

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴合安迎混合型证券投资基金	
基金简称	兴合安迎混合	
基金主代码	017813	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023年05月30日	
基金管理人	兴合基金管理有限公司	
基金托管人	华安证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	8,436,598.92份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	兴合安迎混合A	兴合安迎混合C
下属分级基金的交易代码	017813	017814
报告期末下属分级基金的份额总额	6,262,098.17份	2,174,500.75份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于安徽省上市公司及业务跟安徽省有重要关联的上市公司，在深入研究的基础上精选个股进行投资，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报
投资策略	本基金的投资策略主要有：资产配置策略；股票投资策略；债券投资策略；衍生产品投资策略及信用衍生品投资策略等。
业绩比较基准	中证安徽发展指数收益率*70%+中证港股通综合指数（CNY）收益率*10%+中债综合财富(总值)指数收益率*20%
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。本基金如果投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险

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		兴合基金管理有限公司	华安证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	徐乾山	燕宇
	联系电话	010-56970988	0551-65161986
	电子邮箱	services@xhfund.com	yanyu@hazq.com
客户服务电话		400-997-0188	95318
传真		010-56970970	-
注册地址		安徽省芜湖市弋江区中山南路717号科技产业园A3栋	安徽省合肥市滨湖新区紫云路1018号
办公地址		北京市丰台区金泽路161号院1号楼远洋锐中心9层	安徽省合肥市滨湖新区紫云路1018号
邮政编码		100073	230092
法定代表人		程丹倩	章宏韬

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.xhfund.com
基金中期报告备置地点	北京市丰台区金泽路161号院1号楼远洋锐中心9层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	兴合基金管理有限公司	安徽省芜湖市弋江区中山南路717号科技产业园A3栋

§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

3.1.1 期间数据和指标	报告期
---------------	-----

	(2024年01月01日-2024年06月30日)	
	兴合安迎混合A	兴合安迎混合C
本期已实现收益	-541,982.60	-672,008.42
本期利润	-762,378.80	-511,265.88
加权平均基金份额本期利润	-0.1195	-0.1011
本期加权平均净值利润率	-14.29%	-12.08%
本期基金份额净值增长率	-12.94%	-13.30%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)	
期末可供分配利润	-1,316,286.90	-470,813.68
期末可供分配基金份额利润	-0.2102	-0.2165
期末基金资产净值	4,945,811.27	1,703,687.07
期末基金份额净值	0.7898	0.7835
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-21.02%	-21.65%

注：1、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；

2、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；

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6月30日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

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

兴合安迎混合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
过去一个月	-3.67%	0.94%	-4.80%	0.76%	1.13%	0.18%

过去三个月	-7.46%	0.96%	-5.10%	0.87%	-2.36%	0.09%
过去六个月	-12.94%	1.17%	-3.11%	1.05%	-9.83%	0.12%
过去一年	-20.98%	0.91%	-11.64%	0.93%	-9.34%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-21.02%	0.88%	-8.54%	0.92%	-12.48%	-0.04%

兴合安迎混合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
过去一个月	-3.74%	0.95%	-4.80%	0.76%	1.06%	0.19%
过去三个月	-7.64%	0.96%	-5.10%	0.87%	-2.54%	0.09%
过去六个月	-13.30%	1.17%	-3.11%	1.05%	-10.19%	0.12%
过去一年	-21.55%	0.91%	-11.64%	0.93%	-9.91%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-21.65%	0.88%	-8.54%	0.92%	-13.11%	-0.04%

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



注：本基金建仓期为基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。



注：本基金建仓期为基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

§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

兴合基金管理有限公司（以下简称“我公司”）经中国证券监督管理委员会证监许可【2021】571号文批准，于2022年2月11日取得中国证券监督管理委员会核发的《经营证券期货业务许可证》。我公司目前股东及其出资比例为：程丹倩女士50.20%，王锋先生27.19%，高昕女士13.04%，北京金华盛开企业管理中心（有限合伙）3.48%，北京五象企业管理中心（有限合伙）3.48%，北京琼锐企业管理中心（有限合伙）2.61%。

截至本报告期末，我公司共管理4只开放式基金：兴合安平六个月持有期债券型证券投资基金、兴合安迎混合型证券投资基金、兴合锦安利率债债券型证券投资基金、兴合先进制造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）	证券从业	说明

		期限		年限	
		任职日期	离任日期		
孙祺	本基金基金经理、职工监事、研究发展部总经理、投资决策委员会成员	2023-05-30	-	16	中国籍，工学硕士，具有基金从业资格。曾任天相投资顾问有限公司研究员、研究主管，华商基金管理有限公司研究员、基金经理，方正富邦基金管理有限公司研究部副总经理。

注：1、首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，非首任基金经理的“任职日期”为根据公司决定确定的聘任日期，基金经理的“离任日期”均为根据公司决定确定的解聘日期；

2、证券从业年限的计算标准及含义遵从《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。

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，本基金经理不存在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遵规守信情况的说明

本报告期内，基金管理人严格按照《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》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无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

公司实行分级授权办法，明确投资决策委员会、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，保证公司资产管理业务不同投资组合经理之间投资决策的独立性；公司建立了较完善的研究方法和投资决策流程，确保公司旗下的各投资组合享有公平的投资决策机会；公司实行集中交易制度和公平交易分配制度，并重视交易执行环节的公平交易措施；公司定期对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析；本报告期内，未出

现违反公平交易制度的情况，公司旗下各投资组合不存在因非公平交易等导致的利益输送行为，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，本基金未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发现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的5%的情况。本报告期内，未发现基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

本基金投资策略是，基于自上而下的宏观判断做配置，并兼顾安徽地域特色，选择优势行业和优质个股，结合市场环境、公司运行、估值等因素动态调整。

年初资本市场出现较大调整，三月PMI、社融等指标超出市场预期，但五六月后再次走弱，同时积极的产业政策不断推出。我们前期对经济和市场形势判断有误，相应的投资节奏出现偏差。我们的股票池中成长股较多，配置的股票估值不高，但今年市场环境仍在不断压缩成长股的估值空间，部分成长股的业绩也确实没有兑现。基于我们持续的对宏观和行业数据跟踪，和上市公司密切的交流，逐步做了修正，提升了盈利确定更高的行业和个股的比例。

尽管面临人口、地产等中长期不利因素，我们对中国经济发展的远期前景保持乐观，但同时也充分认知中国进入新发展阶段的新常态。我们认为对国内后疫情时代的经济修复进程要保持耐心，对全球地缘政治的影响也要持有长期准备。面临诸多不确定性，投资中确定性的重要性高于以往。我们淡化景气轮动的框架，而更为重视有着较好的竞争格局的行业，经过多年发展后已经证明实力的行业龙头或有长期核心竞争力的优秀企业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴合安迎混合A基金份额净值为0.7898元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-12.94%，同期业绩比较基准收益率为-3.11%；截至报告期末兴合安迎混合C基金份额净值为0.7835元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-13.30%，同期业绩比较基准收益率为-3.11%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内经济仍在新旧动能转化的筑底期，包括地产政策优化、设备更新、LPR降息等托底型经济和金融政策陆续推出，生产较强而需求较弱仍然是主要矛盾，上半年被寄予

厚望的外需随着欧美经济周期性走弱和贸易壁垒增加而受到影响。主要的机会仍然在供给格局较好且需求刚性的领域，如全球顶级供应链的核心半导体材料厂、优势自主品牌汽车的供应链企业、有深厚文化积淀的特色景区、区位供需优势明显的一体化能源企业等。

此外，关注美联储降息节奏和日本加息和维护汇率的措施，总体上宽松美元和日元对新兴经济体更为有利，等待更为有利的时机出现。

感谢投资人在复杂的市场环境下对本基金的信任，本基金运作时间已经满一年，期间经历各种宏观和市场起伏变化，我们越来越相信在正确道路上的耐心一定能够得到回报。

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。本基金管理人设有估值委员会，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。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 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，本基金存在连续60个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，本基金管理人已拟定了相应的解决方案，并将方案报告中国证监会；本基金报告期内未出现连续20个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§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，华安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遵规守信、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

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

§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：兴合安迎混合型证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	328,413.35	1,349,519.43
结算备付金		392.96	2,026,523.08
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	6,064,685.79	11,318,906.00
其中：股票投资		6,064,685.79	11,318,906.00
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	198,005.94	120,004.80
应收清算款		80,076.47	-
应收股利		5,472.00	-

应收申购款		99.85	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		6,677,146.36	14,814,953.31
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末
		2024年06月30日	2023年12月31日
负债：			
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		-	8.75
应付管理人报酬		6,923.73	15,968.29
应付托管费		1,153.97	2,661.37
应付销售服务费		1,290.64	6,501.15
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	18,279.68	150,000.00
负债合计		27,648.02	175,139.56
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	8,436,598.92	16,173,856.15
未分配利润	6.4.7.8	-1,787,100.58	-1,534,042.40
净资产合计		6,649,498.34	14,639,813.75
负债和净资产总计		6,677,146.36	14,814,953.31

注：报告截止日2024年6月30日，A类基金份额净值0.7898元，C类基金份额净值0.7835元，A类基金份额6,262,098.17份，C类基金份额2,174,500.75份，基金份额总额8,436,598.92份。

6.2 利润表

会计主体：兴合安迎混合型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年05月30日（基金 合同生效日）至2023年 06月30日
一、营业总收入		-1,169,047.29	253,929.08
1.利息收入		7,804.17	240,855.27
其中：存款利息收入	6.4.7.9	6,287.83	118,169.22
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		1,516.34	122,686.05
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		-1,117,502.74	8,793.81
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-1,189,925.51	-
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	8,793.81
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	72,422.77	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.17	-59,653.66	4,280.00
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	304.94	-
减：二、营业总支出		104,597.39	511,239.70
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	57,087.49	294,045.87
2.托管费	6.4.10.2.2	9,514.59	49,007.62
3.销售服务费	6.4.10.2.3	16,855.71	143,000.93
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	6.4.7.19	-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用	6.4.7.20	21,139.60	25,185.28
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,273,644.68	-257,310.62
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,273,644.68	-257,310.62
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,273,644.68	-257,310.62

6.3 净资产变动表

会计主体：兴合安迎混合型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	16,173,856.15	-1,534,042.40	14,639,813.75
二、本期期初净资产	16,173,856.15	-1,534,042.40	14,639,813.75

产			
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-7,737,257.23	-253,058.18	-7,990,315.41
（一）、综合收益总额	-	-1,273,644.68	-1,273,644.68
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-7,737,257.23	1,020,586.50	-6,716,670.73
其中：1.基金申购款	92,883.28	-13,083.23	79,800.05
2.基金赎回款	-7,830,140.51	1,033,669.73	-6,796,470.78
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	8,436,598.92	-1,787,100.58	6,649,498.34
项目	上年度可比期间		
	2023年05月30日（基金合同生效日）至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	213,929,331.46	-	213,929,331.46
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-257,310.62	-257,310.62
（一）、综合收益总额	-	-257,310.62	-257,310.62

(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
其中: 1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	213,929,331.46	-257,310.62	213,672,020.84

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:

程丹倩

蔡靖

王国栋

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

兴合安迎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[2022]3193号《关于准予兴合安迎混合型证券投资基金注册的批复》准予注册,由兴合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《兴合安迎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213,908,439.84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0301号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《兴合安迎混合型证券投资基金基金合同》于2023年5月30日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为213,929,331.46份基金份额,其中认购资金利息折合20,891.62份基金份额。本基金的基金管理人为兴合基金管理有限公司,基金托管人为华安证券股份有限公司。

根据《兴合安迎混合型证券投资基金招募说明书》，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，而不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，而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为C类基金份额。本基金A类、C类基金份额分别设置代码。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基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《兴合安迎混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括依法发行上市的股票（包括主板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证或港股通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”））、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、政府支持机构债券、可转换债券、可交换债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、股票期权、国债期货、信用衍生品及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资组合中股票资产占基金资产的比例为60%-95%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的0%-30%。其中，投资于安徽省上市公司及业务跟安徽省有重要关联的上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的80%。前述安徽省上市公司及业务跟安徽省有重要关联的上市公司，直接或间接受益于安徽省“迎客松行动”计划及后续计划，包括（1）注册地址或总部在安徽省的上市公司；（2）注册地址或总部不在安徽省，来自安徽省收入或净利润占比达到30%以上的上市公司。每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约、国债期货合约所需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许，本基金管理人在履行适当程序后，可对上述资产配置比例进行调整。本基金的业绩比较基准为：中证安徽发展指数收益率×70%+中证港股通综合指数（CNY）收益率×10%+中债综合财富(总值)指数收益率×20%。

本财务报表由本基金的基金管理人兴合基金管理有限公司于2024年8月22日批准报出。

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》、《兴合安迎混合型证券投资基金基金合同》和财务报表附注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,基金管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案,如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并在6个月内召集份额持有人大会进行表决。于2024年6月30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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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本报告期末的财务状况以及本报告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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

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[2014]81

号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》、《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通或深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末	
	2024年06月30日	
活期存款	311,147.53	
等于：本金	311,038.24	
加：应计利息	109.29	
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	17,265.82	
等于：本金	17,239.35	
加：应计利息	26.47	
减：坏账准备	-	
合计	328,413.35	

注：其他存款本报告期末余额均为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2024年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	6,043,206.00	-	6,064,685.79	21,479.79
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	6,043,206.00	-	6,064,685.79	21,479.79

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生品金融资产/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 2024年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	198,005.94	-
银行间市场	-	-
合计	198,005.94	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期内无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06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	40.08
其中：交易所市场	40.08
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	10,656.10
预提费用-账户维护费	1,483.50
其他应付	6,100.00
合计	18,279.68

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 兴合安迎混合A

金额单位：人民币元

项目 (兴合安迎混合A)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,606,460.70	6,606,460.70
本期申购	18,861.30	18,861.30
本期赎回（以“-”号填列）	-363,223.83	-363,223.83
本期末	6,262,098.17	6,262,098.17

6.4.7.7.2 兴合安迎混合C

金额单位：人民币元

项目 (兴合安迎混合C)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	9,567,395.45	9,567,395.45
本期申购	74,021.98	74,021.98
本期赎回（以“-”号填列）	-7,466,916.68	-7,466,916.68
本期末	2,174,500.75	2,174,500.75

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 兴合安迎混合A

单位：人民币元

项目 (兴合安迎混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-715,643.47	102,856.72	-612,786.75
本期期初	-715,643.47	102,856.72	-612,786.75
本期利润	-541,982.60	-220,396.20	-762,378.80
本期基金份额交易产生的变动数	54,233.68	4,644.97	58,878.65
其中：基金申购款	-2,783.31	-497.94	-3,281.25
基金赎回款	57,016.99	5,142.91	62,159.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,203,392.39	-112,894.51	-1,316,286.90

6.4.7.8.2 兴合安迎混合C

单位：人民币元

项目 (兴合安迎混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,069,747.86	148,492.21	-921,255.65
本期期初	-1,069,747.86	148,492.21	-921,255.65
本期利润	-672,008.42	160,742.54	-511,265.88
本期基金份额交易产生的变动数	1,309,737.44	-348,029.59	961,707.85
其中：基金申购款	-15,061.06	5,259.08	-9,801.98
基金赎回款	1,324,798.50	-353,288.67	971,509.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-432,018.84	-38,794.84	-470,813.68

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期

	2024年01月01日至2024年06月30日
活期存款利息收入	4,691.05
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	454.71
结算备付金利息收入	1,142.07
其他	-
合计	6,287.83

注：其他存款利息收入为本报告期内存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
卖出股票成交总额	35,518,567.65
减：卖出股票成本总额	36,634,579.88
减：交易费用	73,913.28
买卖股票差价收入	-1,189,925.51

6.4.7.11 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

6.4.7.12 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	72,422.77
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	72,422.77

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	-59,653.66
——股票投资	-59,653.66
——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	-59,653.66

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日

基金赎回费收入	304.94
合计	304.94

注：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。

6.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	10,656.10
信息披露费	-
证券出借违约金	-
账户维护费_中债登	10,483.50
合计	21,139.60

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

截至财务报表报出日，本基金无须作披露的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，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
兴合基金管理有限公司(以下简称"兴合基金")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
华安证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构、证券经纪商

安徽江淮汽车集团股份有限公司	与基金托管人同一独立董事的关联方
安徽合力股份有限公司	与基金托管人同一独立董事的关联方
安徽省皖能股份有限公司	与基金托管人同一实际控制人的关联方
安徽安利材料科技股份有限公司	与基金托管人同一独立董事的关联方

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业业务款订立。

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 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年05月30日（基金合同生效日） 至2023年06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
华安证券 股份有限公司(以下 简称"华 安证券")	66,958,580.98	100.00%	-	-

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的基金交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06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
华安证券股份有限公司(以下简称"华安证券")	48,894.27	100.00%	40.08	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2023年05月30日（基金合同生效日）至2023年06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
华安证券股份有限公司(以下简称"华安证券")	20,145.46	100.00%	-	-

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日	上年度可比期间 2023年05月30日（基金合同

	至2024年06月30 日	生效日)至2023年06月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	57,087.49	294,045.87
其中：应支付销售机构的客户维护费	10,930.65	99,381.88
应支付基金管理人的净管理费	46,156.84	194,663.99

注：1. 自2023年5月30日(基金合同生效日)至2023年8月10日，支付基金管理人兴合基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

2. 根据《兴合基金管理有限公司关于调低兴合安迎混合型证券投资基金基金费率并修订基金合同的公告》，自2023年8月11日起，本基金的基金管理费由“按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提”调整为本基金的基金管理费“按前一日基金资产净值1.20%的年费率计提”。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。

3. 客户维护费是基金管理人与基金销售机构约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的费用，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 2024年01月01日 至2024年06月30 日	上年度可比期间 2023年05月30日（基金合同生 效日）至2023年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	9,514.59	49,007.62

注：1. 自2023年5月30日(基金合同生效日)至2023年8月10日，支付基金托管人华安证券的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

2. 根据《兴合基金管理有限公司关于调低兴合安迎混合型证券投资基金基金费率并修订基金合同的公告》，自2023年8月11日起，本基金的基金托管费由“按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提”调整为本基金的基金托管费“按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提”。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。
的费用，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。

6.4.10.2.3 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 2024年01月01日至2024年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴合安迎混合A	兴合安迎混合C	合计
兴合基金	0.00	8,308.55	8,308.55
华安证券	0.00	7,924.51	7,924.51
合计	0.00	16,233.06	16,233.06
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2023年05月30日（基金合同生效日）至2023年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴合安迎混合A	兴合安迎混合C	合计
兴合基金	0.00	18,601.60	18,601.60
华安证券	0.00	94,573.61	94,573.61
合计	0.00	113,175.21	113,175.21

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给兴合基金，再由兴合基金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类基金份额的基金资产净值 × 0.80% / 当年天数。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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**

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

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

本报告期内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

兴合安迎混合A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年06月30日		上年度末 2023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
程丹倩	197,739.57	2.34%	197,739.57	1.22%

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 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年05月30日（基金合同生效日） 至2023年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
华安证券股份有限公司	311,147.53	4,691.05	27,640.17	22,809.74

注：1.本基金上述活期银行存款账户由基金托管人华安证券开立在交通银行股份有限公司，按银行同业利率计息。

2.本基金上述证券交易结算资金存放在本基金证券经纪商华安证券基金专用证券账户中，按协议约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无在承销期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

1、本基金本报告期，于2024年4月11日买入江淮汽车在上海证券交易所发行的股票。证券名称：江淮汽车，证券代码：600418.SH，买入单位价格：16.3224元，总计金额：163,224.00元，买入数量：10,000股。买入安徽合力在上海证券交易所发行的股票。证券名称：安徽合力，证券代码：600761.SH，买入单位价格：22.5120元，总计金额：92,299.00元，买入数量：4,100股。买入皖能电力在深圳证券交易所发行的股票。证券名称：皖能电力，证券代码：000543.SZ，买入单位价格：8.7073元，总计金额：72,271.00元，买入数量：8,300股。

上述股票发行人为本基金托管人华安证券股份有限公司的关联方。该关联交易符合本基金的投资范围和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，交易价格公允。本公司严格按照法律法规的要求和基金合同的约定，履行相关程序，不存在利益输送情况。

2、本基金本报告期，于2024年4月16日买入安利股份在深圳证券交易所发行的股票。证券名称：安利股份，证券代码：300218.SZ，买入单位价格：14.3850元，总计金额：57,540.00元，买入数量：4,000股。

上述股票发行人为本基金托管人华安证券股份有限公司的关联方。该关联交易符合本基金的投资范围和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，交易价格公允。本公司严格按照法律法规的要求和基金合同的约定，履行相关程序，不存在利益输送情况。

3、本基金本报告期，于2024年6月12日买入安徽合力在上海证券交易所发行的股票。证券名称：安徽合力，证券代码：600761.SH，买入单位价格：22.6100元，总计金额：72,352.00元，买入数量：3,200股。

上述股票发行人为本基金托管人华安证券股份有限公司的关联方。该关联交易符合本基金的投资范围和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，交易价格公允。本公司严格按照法律法规的要求和基金合同的约定，履行相关程序，不存在利益输送情况。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024年06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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末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

本基金本报告期末未持有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

本基金本报告期末未持有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

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金涉及的风险主要是信用风险、流动性风险及市场风险。基金管理人建立风险管理架构、制定了制度来识别及分析风险，并设定适当风险限额及内部控制流程，持续监控管理上述各类风险。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规以及《兴合基金管理有限公司章程》和《兴合基金管理有限公司内部控制大纲》等公司有关规章制度，制定了《兴合基金管理有限公司风险控制制度》，公司实行全面风险管理的政策，建立了以董事会下属的公司合规与风险控制委员为核心、由总经理和管理层设立的公司内部控制委员会、督察长、监察稽核部、及各个业务部门组成的风险管理架构。风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节。同时，公司都制定了系统化的风险管理流程，实现风险识别、风险评估、风险处理、风险监控和风险报告的程序化管理，并对风险管理的整个流程进行评估和改进。

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建立了内部信用评级制度体系和交易对手库，对信用主体及该主体发行的债券进行内部评级和跟踪评级调整，对交易对手实行准入、分级和集中度管控，以控制信用风险。

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

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款的风险。本基金的流动性风险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，另一方面来自于基金份额持有人要求赎回其持有的基金份额。

针对变现困难的流动性风险，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，同时本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险。本基金的基金管理人定期对基金的流动性风险进行监测、预警以及压力测试的实施和评估。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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人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。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。

截至报告期末，本基金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(净资产)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》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及《公开募集证券投资

基金侧袋机制指引(试行)》等有关法规的要求，建立健全流动性风险管理体系，通过采取审慎评估各类资产的流动性，有针对性制定流动性风险管理措施，定期进行压力测试和评估等方式，对本基金的组合资产的流动性风险进行管理。

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公司的证券不超过该证券的10%。

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%。截至报告期末，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。

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交易对手管理制度：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。

本报告期内，本基金组合资产的流动性能够与本基金申购和赎回相匹配，本基金未发生流动性风险事件。

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

利率风险是指基金的财务状况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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年0 6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	328,413.35	-	-	-	328,413.35
结算备付金	392.96	-	-	-	392.96
交易性金融资产	-	-	-	6,064,685.79	6,064,685.79
买入返售金融资产	198,005.94	-	-	-	198,005.94
应收清算款	-	-	-	80,076.47	80,076.47
应收股利	-	-	-	5,472.00	5,472.00
应收申购款	-	-	-	99.85	99.85
资产总计	526,812.25	-	-	6,150,334.11	6,677,146.36
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	6,923.73	6,923.73
应付托管费	-	-	-	1,153.97	1,153.97
应付销售服务费	-	-	-	1,290.64	1,290.64

其他负债	-	-	-	18,279.68	18,279.68
负债总计	-	-	-	27,648.02	27,648.02
利率敏感度缺口	526,812.25	-	-	6,122,686.09	6,649,498.34
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,349,519.43	-	-	-	1,349,519.43
结算备付金	2,026,523.08	-	-	-	2,026,523.08
交易性金融资产	-	-	-	11,318,906.00	11,318,906.00
买入返售金融资产	120,004.80	-	-	-	120,004.80
资产总计	3,496,047.31	-	-	11,318,906.00	14,814,953.31
负债					
应付赎回款	-	-	-	8.75	8.75
应付管理人报酬	-	-	-	15,968.29	15,968.29
应付托管费	-	-	-	2,661.37	2,661.37
应付销售服务费	-	-	-	6,501.15	6,501.15
其他负债	-	-	-	150,000.00	150,000.00

负债总计	-	-	-	175,139.56	175,139.56
利率敏感度缺口	3,496,047.31	-	-	11,143,766.44	14,639,813.75

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

市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

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。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	160,841.59	-	160,841.59
应收股利	-	5,472.00	-	5,472.00
资产合计	-	166,313.59	-	166,313.59
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	166,313.59	-	166,313.59
项目	上年度末 2023年12月31日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计

			币	
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	-	-	-

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除外汇外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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	人民币对一揽子货币平均升值5%	-8,315.68	-
	人民币对一揽子货币平均贬值5%	8,315.68	-

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素（单个证券发行主体自身经营情况或证券市场整体波动）发生变动时导致基金资产发生损失的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人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进行风险度量和分析，以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 2024年06月30日		上年度末 2023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	6,064,685.79	91.21	11,318,906.00	77.32

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	6,064,685.79	91.21	11,318,906.00	77.32

注：由于四舍五入的原因，公允价值占基金净资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta系数是根据组合的净值数据和基准指数数据回归得出，反映基金和基准的相关性。		
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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	业绩比较基准增加5%	261,389.90	348,372.95
	业绩比较基准减少5%	-261,389.90	-348,372.95

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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	6,064,685.79	11,318,906.00
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	6,064,685.79	11,318,906.00

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。

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

于2024年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

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	6,064,685.79	90.83
	其中：股票	6,064,685.79	90.83

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	198,005.94	2.97
	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	328,806.31	4.92
8	其他各项资产	85,648.32	1.28
9	合计	6,677,146.36	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	602,895.00	9.07
C	制造业	3,727,189.20	56.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	217,215.00	3.27
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	410,410.00	6.17
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	416,615.00	6.27
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	390,920.00	5.88

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	138,600.00	2.08
S	综合	-	-
	合计	5,903,844.20	88.79

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例 (%)
非日常生活消费品	50,699.37	0.76
工业	39,865.86	0.60
通讯业务	70,276.36	1.06
合计	160,841.59	2.42

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	000725	京东方 A	146,000	597,140.00	8.98
2	300274	阳光电源	9,440	585,563.20	8.81
3	601918	新集能源	48,100	468,975.00	7.05
4	002230	科大讯飞	9,700	416,615.00	6.27
5	002409	雅克科技	4,800	301,968.00	4.54
6	002997	瑞鹄模具	9,300	297,321.00	4.47
7	300857	协创数据	4,700	267,900.00	4.03
8	600575	淮河能源	66,000	256,740.00	3.86
9	603199	九华旅游	8,600	256,280.00	3.85
10	600761	安徽合力	10,400	225,056.00	3.38
11	000630	铜陵有色	58,000	209,380.00	3.15
12	603801	志邦家居	15,000	196,200.00	2.95

13	600418	江淮汽车	10,000	158,400.00	2.38
14	600012	皖通高速	11,000	153,670.00	2.31
15	600795	国电电力	24,000	143,760.00	2.16
16	601801	皖新传媒	20,000	138,600.00	2.08
17	600054	黄山旅游	12,000	134,640.00	2.02
18	002226	江南化工	30,000	134,400.00	2.02
19	600985	淮北矿业	8,000	133,920.00	2.01
20	688080	映翰通	4,400	133,452.00	2.01
21	688630	芯碁微装	2,000	125,140.00	1.88
22	000596	古井贡酒	500	105,535.00	1.59
23	000543	皖能电力	8,300	73,455.00	1.10
24	603589	口子窖	1,800	70,542.00	1.06
25	H00941	中国移动	1,000	70,276.36	1.06
26	002557	洽洽食品	2,300	64,837.00	0.98
27	603308	应流股份	5,000	62,100.00	0.93
28	300218	安利股份	4,000	60,320.00	0.91
29	688072	拓荆科技	500	60,055.00	0.90
30	H03690	美团-W	500	50,699.37	0.76
31	H00586	海螺创业	6,000	39,865.86	0.60
32	688551	科威尔	1,200	37,800.00	0.57
33	300452	山河药辅	3,000	34,080.00	0.51

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	000725	京东方A	1,273,180.00	8.70
2	600585	海螺水泥	1,108,605.00	7.57
3	000630	铜陵有色	1,016,140.00	6.94

4	002541	鸿路钢构	901,521.00	6.16
5	601918	新集能源	901,416.00	6.16
6	603596	伯特利	795,984.00	5.44
7	300857	协创数据	776,439.00	5.30
8	688551	科威尔	737,359.86	5.04
9	600985	淮北矿业	729,848.00	4.99
10	002997	瑞鹄模具	709,034.18	4.84
11	600256	广汇能源	575,539.00	3.93
12	002557	洽洽食品	575,000.00	3.93
13	603199	九华旅游	571,509.00	3.90
14	H00914	海螺水泥	567,479.21	3.88
15	300274	阳光电源	539,759.00	3.69
16	600054	黄山旅游	534,297.50	3.65
17	000596	古井贡酒	501,822.00	3.43
18	002230	科大讯飞	500,874.00	3.42
19	688486	龙迅股份	493,689.00	3.37
20	688630	芯碁微装	466,353.18	3.19
21	002983	芯瑞达	444,563.00	3.04
22	603801	志邦家居	441,140.67	3.01
23	600520	文一科技	437,741.00	2.99
24	600012	皖通高速	433,307.00	2.96
25	002019	亿帆医药	432,641.00	2.96
26	601801	皖新传媒	429,942.00	2.94
27	603589	口子窖	417,123.00	2.85
28	002597	金禾实业	410,002.00	2.80
29	688027	国盾量子	405,578.00	2.77
30	002555	三七互娱	395,858.00	2.70
31	600577	精达股份	363,778.00	2.48
32	603197	保隆科技	361,592.00	2.47
33	002226	江南化工	356,330.00	2.43
34	601865	福莱特	355,175.00	2.43

35	600502	安徽建工	345,580.00	2.36
36	603979	金诚信	342,894.00	2.34
37	300573	兴齐眼药	338,929.00	2.32
38	300049	福瑞股份	316,063.00	2.16
39	002409	雅克科技	297,556.00	2.03
40	688082	盛美上海	296,645.32	2.03

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	000630	铜陵有色	1,139,850.00	7.79
2	600585	海螺水泥	1,103,576.00	7.54
3	002557	洽洽食品	1,042,537.00	7.12
4	002541	鸿路钢构	932,030.00	6.37
5	300274	阳光电源	926,410.00	6.33
6	002230	科大讯飞	906,177.00	6.19
7	603596	伯特利	902,806.00	6.17
8	000596	古井贡酒	892,499.00	6.10
9	600985	淮北矿业	833,738.00	5.70
10	002997	瑞鹄模具	794,443.00	5.43
11	603308	应流股份	727,350.00	4.97
12	002983	芯瑞达	726,161.00	4.96
13	601918	新集能源	721,578.00	4.93
14	000725	京东方 A	700,980.00	4.79
15	600577	精达股份	670,853.00	4.58
16	688551	科威尔	661,380.52	4.52
17	003020	立方制药	608,285.00	4.16
18	600256	广汇能源	572,767.00	3.91
19	H00914	海螺水泥	549,758.72	3.76

20	688486	龙迅股份	533,447.39	3.64
21	688630	芯碁微装	529,044.52	3.61
22	603198	迎驾贡酒	491,162.00	3.35
23	300857	协创数据	483,535.00	3.30
24	600971	恒源煤电	482,483.00	3.30
25	600012	皖通高速	482,092.00	3.29
26	600502	安徽建工	467,050.00	3.19
27	601865	福莱特	465,654.00	3.18
28	605108	同庆楼	452,898.00	3.09
29	300049	福瑞股份	450,802.00	3.08
30	600520	文一科技	439,738.00	3.00
31	002019	亿帆医药	430,712.00	2.94
32	002597	金禾实业	424,592.00	2.90
33	600054	黄山旅游	395,434.00	2.70
34	002555	三七互娱	389,213.00	2.66
35	688027	国盾量子	379,135.29	2.59
36	601801	皖新传媒	378,201.00	2.58
37	603979	金诚信	369,658.00	2.53
38	002817	黄山胶囊	368,952.00	2.52
39	600237	铜峰电子	345,015.00	2.36
40	688639	华恒生物	344,870.00	2.36
41	603197	保隆科技	344,260.00	2.35
42	603589	口子窖	340,495.00	2.33
43	300573	兴齐眼药	329,002.00	2.25
44	603890	春秋电子	328,911.00	2.25
45	300122	智飞生物	315,811.00	2.16

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	31,440,013.33
卖出股票收入（成交）总额	35,518,567.65

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

本报告期内，基金投资的前十名证券的发行主体未发现被监管部门立案调查，未发现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金本报告期投资的前十名股票未超过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	80,076.47
3	应收股利	5,472.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	99.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	85,648.32

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，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§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 级别	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
兴合	86	72,815.10	2,121,913.84	33.8	4,140,184.33	66.11%

安迎混合A				9%		
兴合安迎混合C	240	9,060.42	0.00	0.00%	2,174,500.75	100.00%
合计	316	26,698.10	2,121,913.84	25.15%	6,314,685.08	74.85%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	兴合安迎混合A	1,275,991.94	20.38%
	兴合安迎混合C	159,593.72	7.34%
	合计	1,435,585.66	17.02%

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情况

项目	份额级别	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	兴合安迎混合A	>100
	兴合安迎混合C	10~50
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基 金	兴合安迎混合A	50~100
	兴合安迎混合C	0
	合计	50~100

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	兴合安迎混合A	兴合安迎混合C
基金合同生效日(2023年05月30日)基金份额总额	20,311,274.66	193,618,056.80

本报告期期初基金份额总额	6,606,460.70	9,567,395.45
本报告期基金总申购份额	18,861.30	74,021.98
减：本报告期基金总赎回份额	363,223.83	7,466,916.68
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	6,262,098.17	2,174,500.75

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金于2024年5月28日经基金份额持有人大会表决通过了《关于兴合安迎混合型证券投资基金持续运作的议案》，本次大会决议自该日起生效。具体可参阅本基金管理人2024年4月18日、2024年4月19日、2024年4月20日以及2024年5月29日在中国证监会电子披露网站、《中国证券报》及公司网站上披露的相关公告。

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

基金管理人、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，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内为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），未有改聘。

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

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未受稽查或处罚等情况。

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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
华安证券	2	66,958,580.98	100.00%	48,894.27	100.00%	-

注：(1)本基金使用证券公司交易结算模式，可免于执行《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》关于交易佣金分仓的规定。

(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)经证监会等监管部门批准，具有交易单元出租资格；
- 2)经营业务比较全面，能够覆盖证券经纪、证券研究、投资银行、股指期货和融资融券等领域；
- 3)拥有独立的研究部门和50人以上的研究团队，研究覆盖宏观经济、金融市场和相关行业，建立完善的研究报告质量保障机制；
- 4)投资银行实力较强，能够提供优质服务；
- 5)建立相关业务利益冲突防范机制，完善隔离墙制度，确保研究、投行服务客观公正；
- 6)承诺如实提供公司所需证券交易的各种资料；
- 7)财务状况良好，上年末净资本不少于10亿元人民币；
- 8)经营行为规范，最近三年未因发生重大违规行为而受到有关管理机关的处罚；
- 9)具备规范、严格、健全的内部控制制度和风险管理制度，能满足公司资金运作高度保密的要求；
- 10)通讯设施高效、安全，交易设施满足公司进行证券交易的需要，能为公司提供全面的信息服务；
- 11)在登记公司设有自营结算备付金账户，客户交易费用在相同资质券商中具有竞争力。

(3) 基金交易单元的选择程序如下：

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，并上报分管领导、公司总经理审批。经批准后，办理交易单元租用手续。

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
华安证券	-	-	19,120,000.00	100.00%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	兴合安迎混合型证券投资基金2023年第4季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024-01-19
2	兴合基金管理有限公司关于增加深圳众禄基金销售股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-03-27
3	兴合安迎混合型证券投资基金2023年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024-03-30
4	兴合基金管理有限公司关于兴合安迎混合型证券投资基金关联交易的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-04-13
5	兴合基金管理有限公司关于兴合安迎混合型证券投资基金关联交易的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-04-18
6	兴合基金管理有限公司关于以通讯方式召开兴合安迎混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-04-18
7	兴合基金管理有限公司关于以通讯方式召开兴合安迎混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-04-19
8	兴合基金管理有限公司关于	中国证监会规定报刊及网站	2024-04-20

	以通讯方式召开兴合安迎混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告		
9	兴合安迎混合型证券投资基金2024年第1季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024-04-20
10	关于兴合安迎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	中国证监会规定报刊及网站	2024-05-29
11	兴合基金管理有限公司关于兴合安迎混合型证券投资基金关联交易的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-06-14
12	兴合安迎混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2024-06-28
13	兴合基金管理有限公司关于兴合安迎混合型证券投资基金关联交易的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-06-29

§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	20240101-20240321	5,174,376.49	0.00	5,174,376.49	0.00	0.00%
	2	20240322-20240630	2,121,812.04	0.00	0.00	2,121,812.04	25.15%
产品特有风险							
<p>本报告期内，本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过20%的情况，当该基金份额持有人选择大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时，存在一定的流动性风险；为应对巨额赎回而进行投资标的变现时，可能存在仓位调整困难，甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金出现巨额赎回并被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险，未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。</p> <p>本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过20%的情况，根据基金合同相关约定，该份额持有人可以独立向基金管理人申请召开基金份额持有人大会，并有权自行召集基金份额持有人大会。</p>							

此外，基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%，或者变相规避50%集中度的情形时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会注册兴合安迎混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《兴合安迎混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《兴合安迎混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《兴合安迎混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人按照相关法律法规规定将信息置备于公司住所。

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间查询，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复印件或复印件。

兴合基金管理有限公司
二〇二四年八月二十七日