

兴华安盈一年定期开放债券型发起  
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：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 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>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	9
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 .....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	10
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 .....	10
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
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 .....	11
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>11</b>
6.1 资产负债表 .....	11
6.2 利润表 .....	12
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	14
6.4 报表附注 .....	16
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>35</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	36

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	36
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	36
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	36
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	37
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	39
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	40
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	40
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	40
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>41</b>
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	41
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	42
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况	42
<b>§ 9</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>42</b>
<b>§ 10</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>42</b>
10.1	基金份额持有人大会决议	42
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	43
10.4	基金投资策略的改变	43
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	43
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	43
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	44
10.8	其他重大事件	45
<b>§ 11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>46</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	46
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	47
<b>§ 12</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>47</b>
12.1	备查文件目录	47
12.2	存放地点	47
12.3	查阅方式	47

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	兴华安盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金
基金简称	兴华安盈一年定开债券发起式
基金主代码	012814
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 8 月 4 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	2,110,005,851.36 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在控制信用风险、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。
投资策略	(1) 封闭期投资策略：①资产配置策略；②久期配置策略；③收益率曲线策略；④信用债投资策略；⑤资产支持证券投资策略；⑥证券公司短期公司债券投资策略；⑦可转换债券和可交换债券投资策略；⑧国债期货投资策略；⑨杠杆投资策略。 (2) 开放期投资策略：开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动。
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 号 2 号楼 8 层	济南市历下区泺源大街 8 号
办公地址		山东省青岛市李沧区金水路 187	上海市黄浦区开平路 88 号瀛通绿

	号 2 号楼 8 层	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

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）
本期已实现收益	36,310,380.90
本期利润	66,536,666.04
加权平均基金份额本期利润	0.0315
本期加权平均净值利润率	3.10%
本期基金份额净值增长率	3.15%
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	6,783,693.42
期末可供分配基金份额利润	0.0032
期末基金资产净值	2,123,653,874.66
期末基金份额净值	1.0065
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	7.66%

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。

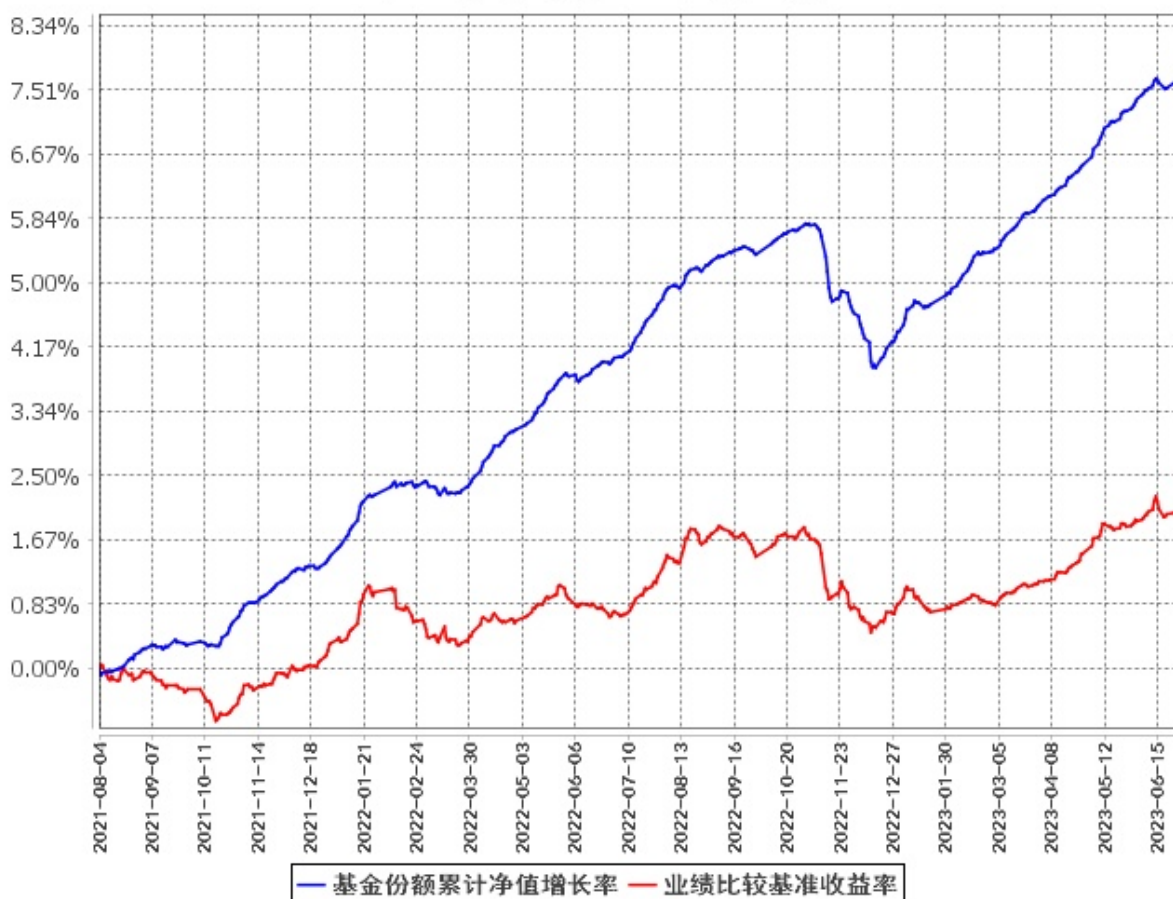
### 3.2 基金净值表现

#### 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

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	0.32%	0.03%	0.18%	0.05%	0.14%	-0.02%
过去三个月	1.55%	0.03%	0.94%	0.04%	0.61%	-0.01%
过去六个月	3.15%	0.03%	1.22%	0.04%	1.93%	-0.01%
过去一年	3.52%	0.05%	1.35%	0.05%	2.17%	0.00%
自基金合同生效起至今	7.66%	0.04%	2.07%	0.05%	5.59%	-0.01%

#### 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

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  
(2021年8月4日至2023年6月30日)



注：(1)本基金合同于2021年8月4日生效，截至报告期末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 06 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	2021 年 8 月 4 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”。

本基金今年以来以票息配置策略为主，并灵活运用杠杆拉长久期配置 7 年以上的地方政府债券，获利后及时止盈。

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

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0065 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.15%；同期业绩比较基准收益率为 1.22%。

#### 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；扩大内需或将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

本基金本报告期内每 10 份派发红利 0.2850 元，共计派发红利 60,135,166.76 元。

报告期本基金的利润分配符合法律法规的相关规定和《基金合同》的约定。

#### 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的真实、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：兴华安盈一年定期开放债券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	4,783,143.69	40,880,483.16
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	2,987,633,360.32	3,169,267,552.62
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,690,491,211.40	2,845,302,901.48
资产支持证券投资		297,142,148.92	323,964,651.14
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	35,263,310.01	127,235,229.06
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		3,027,679,814.02	3,337,383,264.84
<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		900,745,395.96	1,218,970,236.73
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		527,463.04	538,801.92
应付托管费		87,910.48	89,800.32
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		201,272.14	250,554.05
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	2,463,897.74	281,496.44
负债合计		904,025,939.36	1,220,130,889.46
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	2,110,005,851.36	2,110,005,851.36
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	13,648,023.30	7,246,524.02
净资产合计		2,123,653,874.66	2,117,252,375.38
负债和净资产总计		3,027,679,814.02	3,337,383,264.84

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0065 元，基金份额总额 2,110,005,851.36 份。

## 6.2 利润表

会计主体：兴华安盈一年定期开放债券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
一、营业总收入		86,543,080.95	68,678,122.86

1. 利息收入		2,314,104.92	3,559,400.77
其中：存款利息收入	6.4.7.9	101,431.95	54,700.58
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		2,212,672.97	3,504,700.19
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		54,002,690.89	56,928,824.97
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	46,739,190.16	50,576,194.04
资产支持证券投资	6.4.7.12	7,263,500.73	6,352,630.93
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	-	-
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）	6.4.7.16	30,226,285.14	8,189,897.12
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		20,006,414.91	15,831,465.89
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,190,384.58	3,185,026.06
2. 托管费	6.4.10.2.2	531,730.74	530,837.68
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		16,015,941.08	11,845,715.94
其中：卖出回购金融资产支出		16,015,941.08	11,845,715.94
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		145,382.32	151,884.13
8. 其他费用	6.4.7.19	122,976.19	118,002.08
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		66,536,666.04	52,846,656.97

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		66,536,666.04	52,846,656.97
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		66,536,666.04	52,846,656.97

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：兴华安盈一年定期开放债券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）	2,110,005,851.36	-	7,246,524.02	2,117,252,375.38
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）	2,110,005,851.36	-	7,246,524.02	2,117,252,375.38
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-	6,401,499.28	6,401,499.28
（一）、综合收益总额	-	-	66,536,666.04	66,536,666.04
（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）	-	-	-	-
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基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-60,135,166.76	-60,135,166.76

(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)	2,110,005,851.36	-	13,648,023.30	2,123,653,874.66
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)	2,110,005,851.36	-	30,978,008.06	2,140,983,859.42
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)	2,110,005,851.36	-	30,978,008.06	2,140,983,859.42
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	10,646,539.94	10,646,539.94
(一)、综合收益总额	-	-	52,846,656.97	52,846,656.97
(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)	-	-	-	-
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基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-42,200,117.03	-42,200,117.03
(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)	2,110,005,851.36	-	41,624,548.00	2,151,630,399.36

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

兴华安盈一年定期开放债券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[2021]2001号《关于准予兴华安盈一年定期开放债券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《兴华安盈一年定期开放债券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、定期开放式、发起式基金,以定期开放的方式运作,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 2,109,999,999.60 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(2021)第 0725 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《兴华安盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2021 年 8 月 4 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,110,005,851.36 份基金份额,其中认购资金利息折合 5,851.76 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。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为 10,006,851.36 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自基金合同生效之日起不低于 3 年。

本基金的第一个封闭期为自基金合同生效之日起(包括基金合同生效之日)至基金合同生效日所对应的一年后的年度对日的前一日(含该日)为止。首个封闭期结束之后第一个工作日起(含该日)进入首个开放期,下一个封闭期为首个开放期结束之日次日起(含该日)至该封闭期首日所对应的一年后的年度对日的前一日(含该日),以此类推。封闭期内不办理申购和赎回业务,也不上市交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《兴华安盈一年定期开放债券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、次级债、证券公司短期公司债券、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款及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。本基金不直接投资股票等资产,但可持有因可转债转股所形成的股票等。因上述原因持有的股票等资产,本基金将在其可交易之日起的 10 个交易日内卖出。本基金对债券类资产的投资比例不低于基金资产的 80%,但应开放期流动性需要,为



保护基金份额持有人利益，在每次开放期开始前一个月、开放期及开放期结束后一个月的期间内，基金投资不受上述比例限制。开放期内，本基金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%，在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制，但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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，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》、《兴华安盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 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[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	352,986.44
等于：本金	349,585.08
加：应计利息	3,401.36
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	4,430,157.25
等于：本金	4,425,328.73
加：应计利息	4,828.52
减：坏账准备	-
合计	4,783,143.69

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	2,394,329,656.96	39,875,488.77	2,440,015,888.77	5,810,743.04
	银行间市场	247,820,980.42	2,521,222.63	250,475,322.63	133,119.58
	合计	2,642,150,637.38	42,396,711.40	2,690,491,211.40	5,943,862.62
资产支持证券	294,935,032.74	1,286,648.92	297,142,148.92	920,467.26	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	2,937,085,670.12	43,683,360.32	2,987,633,360.32	6,864,329.88	

#### 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

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	35,263,310.01	-
银行间市场	-	-
合计	35,263,310.01	-

#### 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	25,759.39
其中：交易所市场	-
银行间市场	25,759.39
应付利息	-
其他应付款_其他	2,325,000.00
预提费用	113,138.35
合计	2,463,897.74

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,110,005,851.36	2,110,005,851.36
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,110,005,851.36	2,110,005,851.36

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	30,608,479.28	-23,361,955.26	7,246,524.02
本期利润	36,310,380.90	30,226,285.14	66,536,666.04
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-

基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-60,135,166.76	-	-60,135,166.76
本期末	6,783,693.42	6,864,329.88	13,648,023.30

#### 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	82,980.09
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	18,451.86
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	101,431.95

#### 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1月1日 至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	51,262,919.98
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入	-4,523,729.82
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	46,739,190.16

##### 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 1 月 1 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	2,106,743,954.99
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,076,007,824.01
减：应计利息总额	35,215,897.94
减：交易费用	43,962.86
买卖债券差价收入	-4,523,729.82

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日 至 2023 年 6 月 30 日
资产支持证券投资收益——利息收入	7,197,931.16
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	65,569.57
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	7,263,500.73

##### 6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日 至 2023 年 6 月 30 日
卖出资产支持证券成交总额	178,694,452.19
减：卖出资产支持证券成本总额	170,321,409.84
减：应计利息总额	8,306,852.19
减：交易费用	620.59
资产支持证券投资收益	65,569.57

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

##### 6.4.7.13.1 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。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

##### 6.4.7.14.1 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。

#### 6.4.7.15 股利收益

本报告期, 本基金无股利收益。

#### 6.4.7.16 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	30,226,285.14
——股票投资	-
——债券投资	26,605,717.88
——资产支持证券投资	3,620,567.26
——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	30,226,285.14

#### 6.4.7.17 其他收入

本报告期, 本基金无其他收入。

#### 6.4.7.18 信用减值损失

本报告期, 本基金无信用减值损失。

#### 6.4.7.19 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	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-

账户维护费	18,000.00
服务费	600.00
交易费用_回购	237.84
合计	122,976.19

#### 6.4.7.20 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，本基金并无须作说明的或有事项。

##### 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	管理人、销售机构、注册登记机构
恒丰银行股份有限公司	托管人、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

##### 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的佣金。

##### 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	3,190,384.58	3,185,026.06
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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，本基金本报告期内未发生客户维护费。

#### 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	531,730.74	530,837.68

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 0.05% 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 × 0.05% / 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
----	---

基金合同生效日（2021 年 8 月 4 日）持有的基金份额	10,006,851.36
报告期初持有的基金份额	10,006,851.36
报告期内申购/买入总份额	0.00
报告期内因拆分变动份额	0.00
减：报告期内赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	10,006,851.36
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.47%

项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日 至 2022 年 6 月 30 日	
	基金合同生效日（2021 年 8 月 4 日）持有的基金份额	10,006,851.36
报告期初持有的基金份额	10,006,851.36	
报告期内申购/买入总份额	0.00	
报告期内因拆分变动份额	0.00	
减：报告期内赎回/卖出总份额	0.00	
报告期末持有的基金份额	10,006,851.36	
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.47%	

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

本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 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
恒丰银行股份有限公司	352,986.44	82,980.09	-	-

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

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2023年6月9日	-	2023年6月9日	0.2850	60,135,166.76	-	-	-
合计	-	-	-	0.2850	60,135,166.76	-	-	-

注：基金分红对象为权益登记日在兴华基金管理有限公司登记在册的本基金全体份额持有人。

#### 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 9,803,787.49 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
2126006	21 南洋银行 01	2023 年 7 月 3 日	102.79	100,000	10,279,079.45
合计				100,000	10,279,079.45

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购

证券款余额 890,941,608.47 元,于 2023 年 7 月 3 日、2023 年 7 月 4 日、2023 年 7 月 5 日、2023 年 7 月 6 日、2023 年 7 月 7 日、2023 年 7 月 12 日、2023 年 7 月 13 日(先后)到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

#### 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汇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	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	101,829,564.17	-
合计	101,829,564.17	-

注：(1) 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

(2) 未评级债券为地方政府债、短期融资券。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	7,567,174.87
未评级	-	-
合计	-	7,567,174.87

注：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	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	2,213,942,146.88	1,710,660,525.36
AAA 以下	263,398,139.24	721,157,260.30
未评级	111,321,361.11	413,485,115.82
合计	2,588,661,647.23	2,845,302,901.48

注：(1) 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

(2) 未评级部分为中期票据、公司债。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	297,142,148.92	283,129,162.29
AAA 以下	-	-
未评级	-	33,268,313.98
合计	297,142,148.92	316,397,476.27

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

#### 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于约定开放日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于开放期内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 900,745,395.96 元将在 14 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》且于基金开放期内按照《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。

于开放期内，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	4,783,143.69	-	-	-	4,783,143.69
交易性金融资产	890,781,093.48	1,420,835,722.45	676,016,544.39	-	2,987,633,360.32
买入返售金融资产	35,263,310.01	-	-	-	35,263,310.01
资产总计	930,827,547.18	1,420,835,722.45	676,016,544.39	-	3,027,679,814.02
负债					
卖出回购金融资产款	900,745,395.96	-	-	-	900,745,395.96
应付管理人报酬	-	-	-	527,463.04	527,463.04
应付托管费	-	-	-	87,910.48	87,910.48
应交税费	-	-	-	201,272.14	201,272.14
其他负债	-	-	-	2,463,897.74	2,463,897.74
负债总计	900,745,395.96	-	-	3,280,543.40	904,025,939.36
利率敏感度缺口	30,082,151.22	1,420,835,722.45	676,016,544.39	-3,280,543.40	2,123,653,874.66
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	40,880,483.16	-	-	-	40,880,483.16
交易性金融资产	867,853,523.72	1,721,593,371.50	579,820,657.40	-	3,169,267,552.62
买入返售金融资产	127,235,229.06	-	-	-	127,235,229.06
资产总计	1,035,969,235.94	1,721,593,371.50	579,820,657.40	-	3,337,383,264.84
负债					
卖出回购金融资产款	1,218,970,236.73	-	-	-	1,218,970,236.73
应付管理人报酬	-	-	-	538,801.92	538,801.92
应付托管费	-	-	-	89,800.32	89,800.32
应交税费	-	-	-	250,554.05	250,554.05

其他负债	-	-	-	281,496.44	281,496.44
负债总计	1,218,970,236.73	-	-	1,160,652.73	1,220,130,889.46
利率敏感度缺口	-183,001,000.79	1,721,593,371.50	579,820,657.40	-1,160,652.73	2,117,252,375.38

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

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）	上年度末（2022年12月31日）
	市场利率上升 25 个基点	-16,189,855.54	-27,436,847.11
市场利率下降 25 个基点	16,709,474.99	27,934,534.32	

#### 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	上年度末 2022年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	2,987,633,360.32	3,169,267,552.62
第三层次	-	-
合计	2,987,633,360.32	3,169,267,552.62

### 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。

本基金本期及上年度可比期间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	2,987,633,360.32	98.68
	其中：债券	2,690,491,211.40	88.86
	资产支持证券	297,142,148.92	9.81
4	贵金属投资	-	-

5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	35,263,310.01	1.16
	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	4,783,143.69	0.16
8	其他各项资产	-	-
9	合计	3,027,679,814.02	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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内无股票交易。

### 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

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,279,079.45	0.48
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	1,732,345,939.63	81.57
5	企业短期融资券	19,997,081.97	0.94

6	中期票据	142,979,721.32	6.73
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	784,889,389.03	36.96
10	其他	-	-
11	合计	2,690,491,211.40	126.69

## 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	160227	20 河北 01	2,000,000	209,974,958.90	9.89
2	127975	22 铁道 16	2,000,000	203,670,104.10	9.59
3	152075	G19 广铁 1	1,100,000	112,389,049.31	5.29
4	175060	20 鲁商 01	1,000,000	104,060,410.96	4.90
5	147720	18 辽宁 10	1,000,000	103,654,301.37	4.88

注：(1) 证券代码 152956； 证券名称 21 亦庄 02； 数量(张)1,000,000.00； 公允价值(元)

103,365,863.01； 占基金资产净值比例(%) 4.87%

(2) 证券代码 188577； 证券名称 GC 融和 01； 数量(张)1,000,000.00； 公允价值(元)

102,932,246.58； 占基金资产净值比例(%) 4.85%

(3) 证券代码 198197； 证券名称 22 甘肃 29； 数量(张)1,000,000.00； 公允价值(元)

102,767,561.64； 占基金资产净值比例(%) 4.84%

(4) 证券代码 188357； 证券名称 21 光明 01； 数量(张)990,000.00； 公允价值(元)

102,248,827.40； 占基金资产净值比例(%) 4.81%

(5) 证券代码 185067； 证券名称 21 华租 03； 数量(张)1,000,000.00； 公允价值(元)

101,974,153.42； 占基金资产净值比例(%) 4.80%

(6) 证券代码 185288； 证券名称 22 招金 01； 数量(张)1,000,000.00； 公允价值(元)

101,409,293.15； 占基金资产净值比例(%) 4.78%

(7) 证券代码 198196； 证券名称 22 甘肃 28； 数量(张)900,000.00； 公允价值(元)

91,943,358.90； 占基金资产净值比例(%) 4.33%

(8) 证券代码 101900037； 证券名称 19 南电 MTN002； 数量(张)800,000.00； 公允价值(元)

81,979,603.29； 占基金资产净值比例(%) 3.86%

(9) 证券代码 184546； 证券名称 22 东城投； 数量(张)800,000.00； 公允价值(元)

81,429,435.62; 占基金资产净值比例(%) 3.83%

(10) 证券代码 157559; 证券名称 19 天津 09; 数量(张)700,000.00; 公允价值(元)  
71,595,443.84; 占基金资产净值比例(%) 3.37%

(11) 证券代码 157573; 证券名称 19 贵州 01; 数量(张)700,000.00; 公允价值(元)  
71,568,038.35; 占基金资产净值比例(%) 3.37%

(12) 证券代码 185213; 证券名称 GC 融和 04; 数量(张)700,000.00; 公允价值(元)  
71,030,292.61; 占基金资产净值比例(%) 3.34%

(13) 证券代码 2280095; 证券名称 22 新沂交投债 ; 数量(张)590,000.00; 公允价值(元)  
60,639,677.70; 占基金资产净值比例(%) 2.86%

(14) 证券代码 152935; 证券名称 21 寿城 01; 数量(张)500,000.00; 公允价值(元)  
52,850,000.00; 占基金资产净值比例(%) 2.49%

(15) 证券代码 137578; 证券名称 22 狮桥 02; 数量(张)500,000.00; 公允价值(元)  
51,552,876.71; 占基金资产净值比例(%) 2.43%

(16) 证券代码 188274; 证券名称 21 常城 07; 数量(张)500,000.00; 公允价值(元)  
51,433,413.70; 占基金资产净值比例(%) 2.42%

(17) 证券代码 149384; 证券名称 21 深铁 G1; 数量(张)500,000.00; 公允价值(元)  
50,809,109.59; 占基金资产净值比例(%) 2.39%

(18) 证券代码 137979; 证券名称 22 海租 04; 数量(张)500,000.00; 公允价值(元)  
50,663,698.63; 占基金资产净值比例(%) 2.39%

(19) 证券代码 137845; 证券名称 22 海租 03; 数量(张)500,000.00; 公允价值(元)  
50,637,465.76; 占基金资产净值比例(%) 2.38%

(20) 证券代码 149817; 证券名称 22 风电 G1; 数量(张)500,000.00; 公允价值(元)  
50,590,013.70; 占基金资产净值比例(%) 2.38%

(21) 证券代码 185753; 证券名称 22 恒信 K1; 数量(张)500,000.00; 公允价值(元)  
50,548,002.74; 占基金资产净值比例(%) 2.38%

(22) 证券代码 185598; 证券名称 22 鄂投 01; 数量(张)500,000.00; 公允价值(元)  
50,532,287.67; 占基金资产净值比例(%) 2.38%

(23) 证券代码 188304; 证券名称 21 中保 01; 数量(张)500,000.00; 公允价值(元)  
50,461,849.32; 占基金资产净值比例(%) 2.38%

(24) 证券代码 115187; 证券名称 23 狮桥 01; 数量(张)500,000.00; 公允价值(元)

50,455,712.33; 占基金资产净值比例(%) 2.38%

(25) 证券代码 105148; 证券名称 河南 1902; 数量(张)400,000.00; 公允价值(元)  
40,920,241.10; 占基金资产净值比例(%) 1.93%

(26) 证券代码 105150; 证券名称 河南 1904; 数量(张)400,000.00; 公允价值(元)  
40,912,241.10; 占基金资产净值比例(%) 1.93%

(27) 证券代码 102100513; 证券名称 21 青岛军民 MTN001; 数量(张)400,000.00; 公允价值(元)  
40,749,377.05; 占基金资产净值比例(%) 1.92%

(28) 证券代码 105056; 证券名称 吉林 1810; 数量(张)200,000.00; 公允价值(元)  
20,643,736.99; 占基金资产净值比例(%) 0.97%

(29) 证券代码 012382305; 证券名称 23 易鑫租赁 SCP002; 数量(张) 200,000.00; 公允价值(元)  
19,997,081.97; 占基金资产净值比例(%) 0.94%

(30) 证券代码 2080068; 证券名称 20 龙口停车场债; 数量(张)200,000.00; 公允价值(元)  
16,579,762.19; 占基金资产净值比例(%) 0.78%

(31) 证券代码 198149; 证券名称 22 安徽 69; 数量(张)100,000.00; 公允价值(元)  
10,335,767.12; 占基金资产净值比例(%) 0.49%

(32) 证券代码 198201; 证券名称 22 甘肃 33; 数量(张)100,000.00; 公允价值(元)  
10,333,863.01; 占基金资产净值比例(%) 0.49%

(33) 证券代码 2126006; 证券名称 21 南洋银行 01; 数量(张)100,000.00; 公允价值(元)  
10,279,079.45; 占基金资产净值比例(%) 0.48%

(34) 证券代码 198163; 证券名称 22 山东 66; 数量(张)100,000.00; 公允价值(元)  
10,239,876.71; 占基金资产净值比例(%) 0.48%

(35) 证券代码 102100440; 证券名称 21 江苏银宝 MTN001; 数量(张)100,000.00; 公允价值(元)  
10,230,544.26; 占基金资产净值比例(%) 0.48%

(36) 证券代码 185366; 证券名称 22 远东三; 数量(张)100,000.00; 公允价值(元)  
10,082,393.43; 占基金资产净值比例(%) 0.47%

(37) 证券代码 102381535; 证券名称 23 山东土地 MTN001; 数量(张)100,000.00; 公允价值(元)  
10,020,196.72; 占基金资产净值比例(%) 0.47%

## 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	135897	启悦 1A	390,000	39,579,928.93	1.86
2	112001	工投 1A2	260,000	26,053,310.69	1.23
3	135063	招资 1 优	600,000	25,853,291.18	1.22
4	180930	金晟 3A	380,000	24,191,649.76	1.14
5	180723	金晟 2A	380,000	23,830,517.29	1.12
6	99DCM1	启悦 2A	200,000	20,070,136.99	0.95
7	260013	启泓 2A	200,000	20,020,646.58	0.94
8	135667	启微 2A	200,000	18,609,512.28	0.88
9	189680	21 尚颀优	290,000	15,204,735.21	0.72
10	180148	22 鑫荣 1A	360,000	15,013,039.96	0.71

注：(1) 证券代码 135283； 证券名称 狮桥 39A1； 数量(张) 300,000.00； 公允价值(元)

14,210,855.48； 占基金资产净值比例(%) 0.67%

(2) 证券代码 183578； 证券名称 21YX4A； 数量(张) 600,000.00； 公允价值(元)

13,991,554.58； 占基金资产净值比例(%) 0.66%

(3) 证券代码 180703； 证券名称 22 鑫荣 2A； 数量(张) 300,000.00； 公允价值(元)

11,829,386.70； 占基金资产净值比例(%) 0.56%

(4) 证券代码 135122； 证券名称 狮桥 37A1； 数量(张) 300,000.00； 公允价值(元)

10,307,329.43； 占基金资产净值比例(%) 0.49%

(5) 证券代码 135498； 证券名称 狮桥 42A1； 数量(张) 150,000.00； 公允价值(元)

9,525,649.43； 占基金资产净值比例(%) 0.45%

(6) 证券代码 136898； 证券名称 狮桥 36A1； 数量(张) 350,000.00； 公允价值(元)

5,769,316.93； 占基金资产净值比例(%) 0.27%

(7) 证券代码 112000； 证券名称 工投 1A1； 数量(张) 160,000.00； 公允价值(元)

3,081,287.50； 占基金资产净值比例(%) 0.15%

## 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

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
2	1,055,002,925.68	2,110,005,851.36	100.00%	0.00	0.00%

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

截至本报告期末，本基金管理人的从业人员未持有本开放式基金。

## 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

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；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数据区间为 0。

## 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,006,851.36	0.47%	10,006,851.36	0.47%	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	10,006,851.36	0.47%	10,006,851.36	0.47%	三年

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021年8月4日）基金份额总额	2,110,005,851.36
本报告期期初基金份额总额	2,110,005,851.36
本报告期基金总申购份额	0.00
减：本报告期基金总赎回份额	0.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	2,110,005,851.36

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、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	-	-	1,592,221.20	100.00%	
兴业证券股份有限公司	2	-	-	-	-	

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
中信证 券(山 东)有 限责任 公司	1,247,875,974.27	100.00 %	41,954,610,000.00	100.00%	-	-	-	-
兴业证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-	-	-

## 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	兴华安盈一年定期开放债券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	兴华安盈一年定期开放债券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
4	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
5	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
6	兴华安盈一年定期开放债券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
7	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
8	兴华安盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金分红公告	中国证监会规定媒介	2023年6月9日
9	兴华安盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新(2023年6月更新)	中国证监会规定媒介	2023年6月20日
10	兴华安盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书(2023年6月更新)	中国证监会规定媒介	2023年6月20日
11	兴华安盈一年定期开放债券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6月20日

12	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	2,099,999,000.00	0.00	0.00	2,099,999,000.00	99.53%
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) 本基金以定期开放方式运作，即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。投资人需在开放期提出申购、赎回申请，在非开放期间将无法进行申购和赎回。基金份额持有人面临封闭期内无法赎回的风险。

#### (3) 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。

#### (4) 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。

#### (5) 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、关于准予兴华安盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复
- 2、《兴华安盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《兴华安盈一年定期开放债券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