

兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式证券投资  
基金  
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：兴华基金管理有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

送出日期：2024 年 3 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>6</b>
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	12
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	18
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>18</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	18
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>18</b>
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>20</b>
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	22

7.3 净资产变动表 .....	23
7.4 报表附注 .....	25
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>53</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	53
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	54
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	56
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	61
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	61
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	61
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	61
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	61
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	61
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	62
8.12 投资组合报告附注 .....	62
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>63</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	63
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	63
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	63
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	64
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>64</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b> .....	<b>65</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	65
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	65
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	65
11.4 基金投资策略的改变 .....	65
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	65
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	65
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	66
11.8 其他重大事件 .....	67
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>69</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 .....	69
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	70
<b>§ 13 备查文件目录</b> .....	<b>70</b>

13.1 备查文件目录 .....	70
13.2 存放地点 .....	70
13.3 查阅方式 .....	70

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金	
基金简称	兴华消费精选 6 个月持有混合发起	
基金主代码	014750	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 1 月 25 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	16,232,640.04 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分类基金的基金简称	兴华消费精选 6 个月持有混合发起 A	兴华消费精选 6 个月持有混合发起 C
下属分类基金的交易代码	014750	014751
报告期末下属分类基金的份额总额	14,169,028.79 份	2,063,611.25 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的前提下，把握消费主题相关的行业投资机会，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	(1) 大类资产配置策略；(2) 股票投资策略：①消费主题的界定；②行业配置策略；③个股投资策略；(3) 港股通标的股票投资策略；(4) 存托凭证投资策略；(5) 债券投资策略；(6) 金融衍生品投资策略；(7) 资产支持证券投资策略；(8) 可转换债券和可交换债券投资策略；(9) 融资业务的投资策略；(10) 证券公司短期公司债券投资策略。 今后，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。
业绩比较基准	中证消费服务领先指数收益率*60%+中证港股通大消费主题指数收益率(使用估值汇率调整)*20%+中债综合全价(总值)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。本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### 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	0755-82943666
	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	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.xinghuafund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	兴华基金管理有限公司	山东省青岛市李沧区金水路 187 号 2 号楼 8 层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年		2022 年 1 月 25 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日	
	兴华消费精选 6 个月持有混合发起 A	兴华消费精选 6 个月持有混合发起 C	兴华消费精选 6 个月持有混合发起 A	兴华消费精选 6 个月持有混合发起 C
本期已实现收益	-778,171.90	-124,160.31	-349,422.04	45,394.32
本期利润	367,125.37	-59,451.52	-1,945,344.45	-197,291.02
加权平均基金份额本期利润	0.0236	-0.0313	-0.1004	-0.0771

本期加权平均净值利润率	2.51%	-3.35%	-10.89%	-8.30%
本期基金份额净值增长率	-0.75%	-1.13%	-9.44%	-9.79%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末	
期末可供分配利润	-1,433,381.96	-223,152.82	-1,965,226.46	-155,711.05
期末可供分配基金份额利润	-0.1012	-0.1081	-0.0944	-0.0979
期末基金资产净值	12,735,646.83	1,840,458.43	18,843,532.37	1,435,450.15
期末基金份额净值	0.8988	0.8919	0.9056	0.9021
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末	
基金份额累计净值增长率	-10.12%	-10.81%	-9.44%	-9.79%

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)扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

(3) 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一个自然日，即 12 月 31 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

### 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

兴华消费精选 6 个月持有混合发起 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.02%	1.00%	-6.09%	0.78%	2.07%	0.22%
过去六个月	-1.10%	1.18%	-8.56%	0.82%	7.46%	0.36%
过去一年	-0.75%	1.06%	-13.06%	0.82%	12.31%	0.24%
自基金合同生效起至今	-10.12%	1.35%	-24.13%	1.11%	14.01%	0.24%

兴华消费精选 6 个月持有混合发起 C

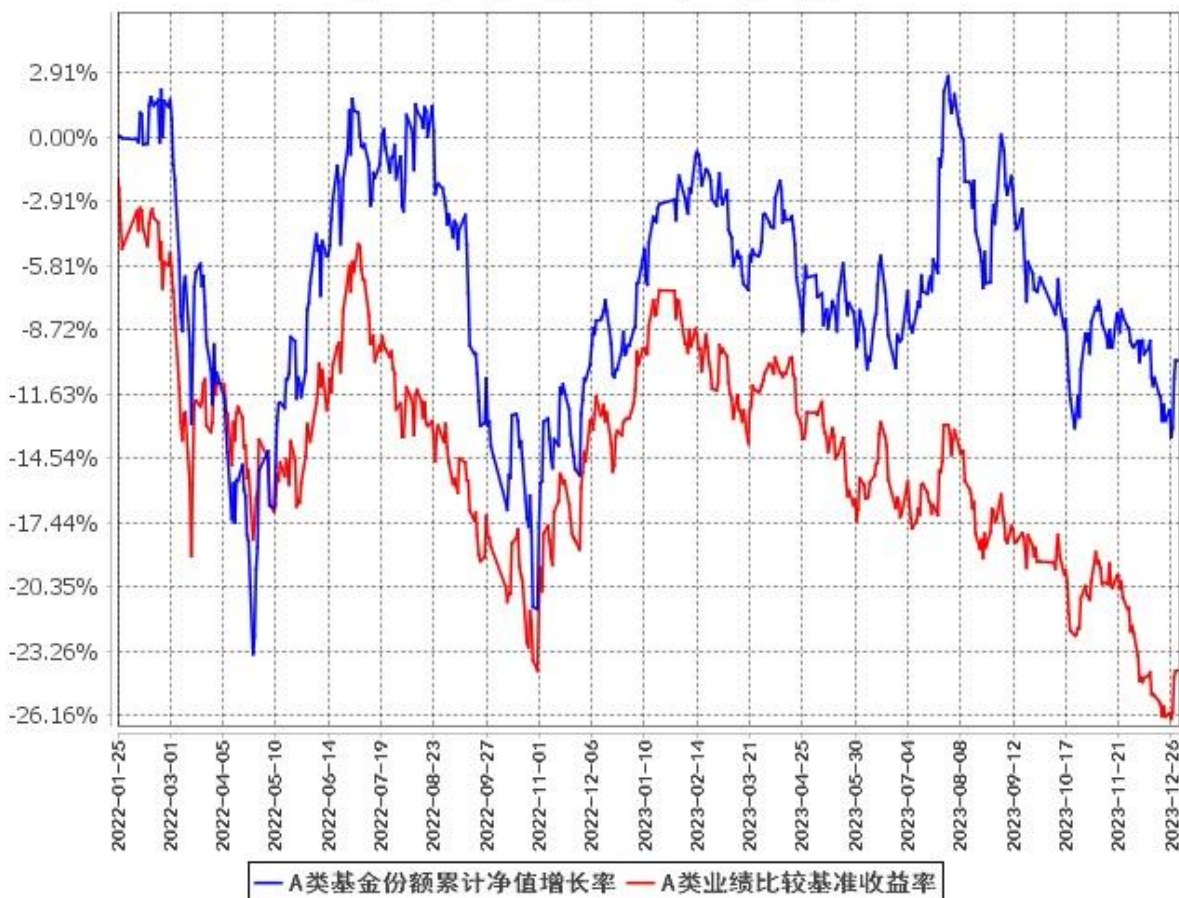
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----



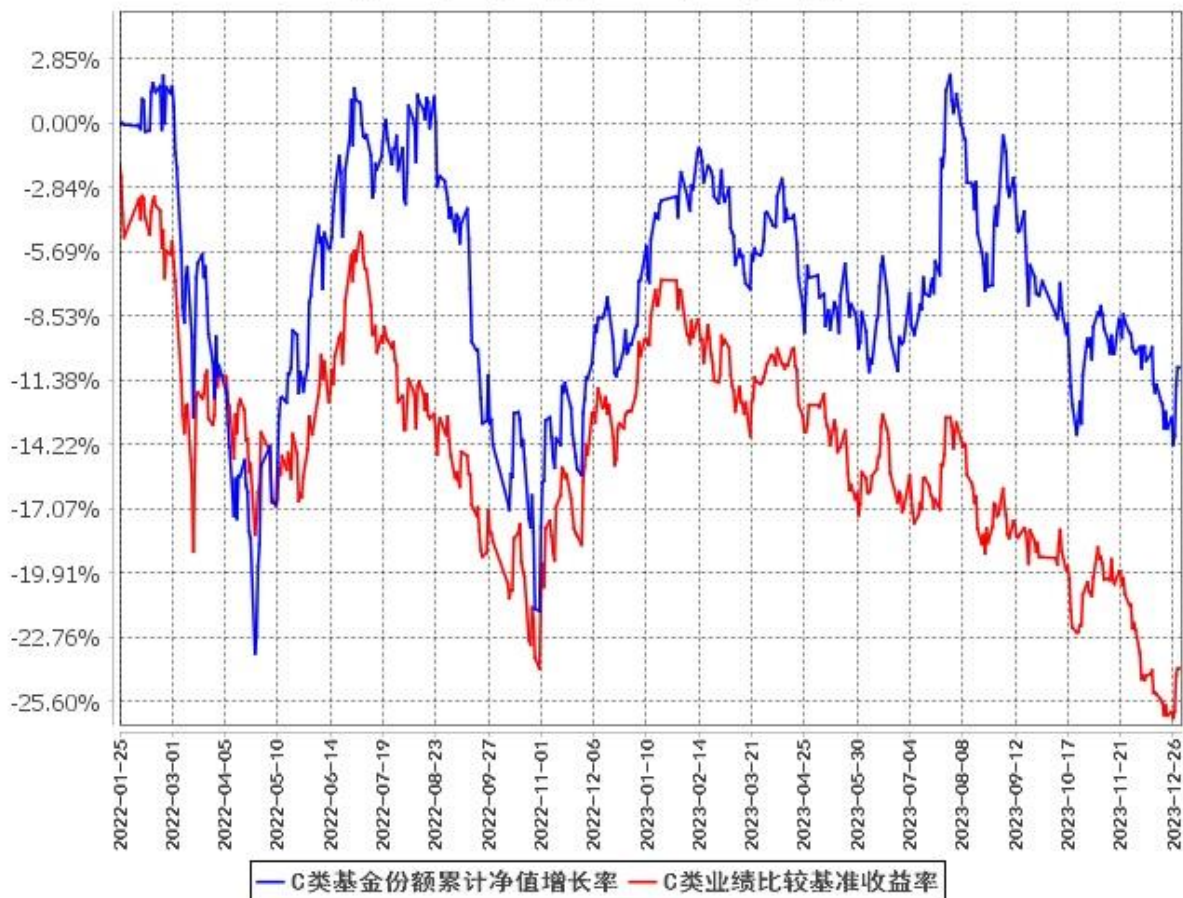
		准差②	率③	准差④		
过去三个月	-4.11%	1.00%	-6.09%	0.78%	1.98%	0.22%
过去六个月	-1.29%	1.18%	-8.56%	0.82%	7.27%	0.36%
过去一年	-1.13%	1.06%	-13.06%	0.82%	11.93%	0.24%
自基金合同生效起至今	-10.81%	1.35%	-24.13%	1.11%	13.32%	0.24%

### 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类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**  
(2022年1月25日至2023年12月31日)



**C类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**  
(2022年1月25日至2023年12月31日)

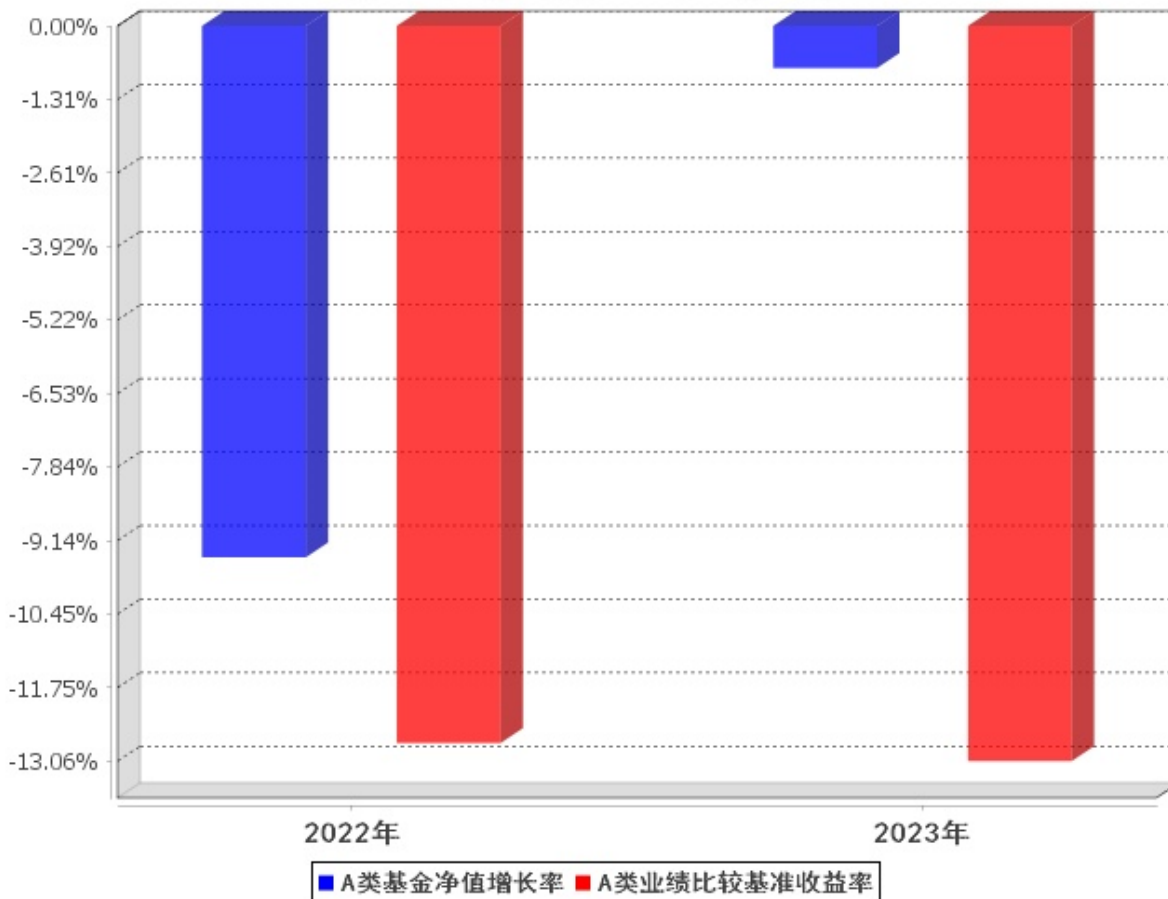


注：(1)本基金合同于2022年1月25日生效，截至本报告期末，本基金合同生效已满一年。

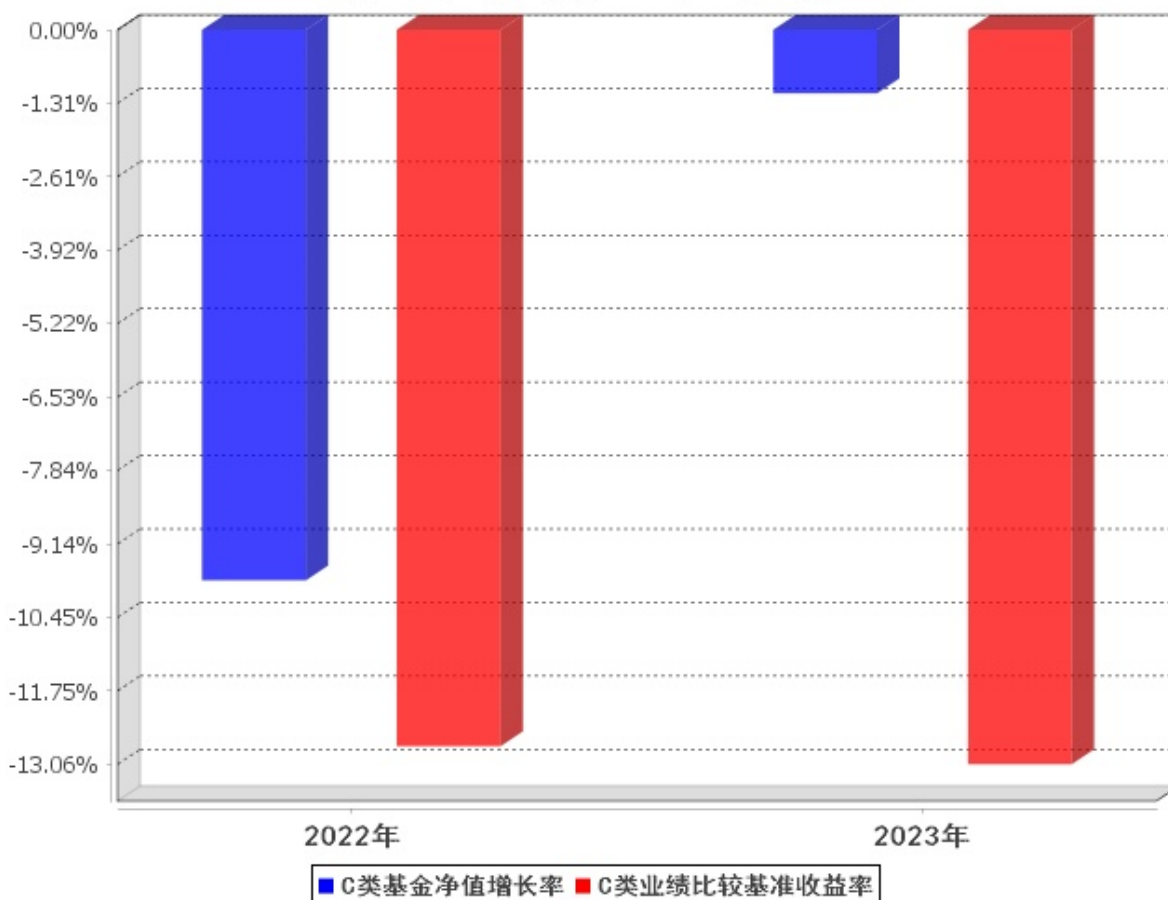
(2)按基金合同规定，本基金的建仓期为自基金合同生效之日起6个月。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合本基金合同的有关规定。

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

A类自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图  
(2022年1月25日至2023年12月31日)



**C类自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图  
(2022年1月25日至2023年12月31日)**



注：本基金合同于 2022 年 1 月 25 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

兴华基金管理有限公司（以下简称“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 12 月 31 日，兴华基金管理有限公司旗下共管理 9 只公募基金，包括兴华创新医疗 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		
冷文鹏	基金经理	2022 年 1 月 25 日	2023 年 6 月 6 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。
崔涛	本基金的基金经理	2023 年 6 月 6 日	-	6.5 年	崔涛先生，中国国籍，北京大学理学硕士，具有基金从业资格。曾任中信建投证券股份有限公司风控经理，永安财产保险股份有限公司研究员。2020 年 10 月加入兴华基金管理有限公司，历任投资研究部、权益研究部研究员，现任权益公募部基金经理。

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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人已根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，建立了科学完善的公平交易管理制度，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能发生的利益输送，确保管理的不同受托资产得到公平对待，保护投资者合法权益。研究部门建立客观的研究方案，对任何投资分析和建议均有充分的事实和数据支持，避免主观臆断，严禁利用内幕信息作为投资依据。公司建立了投资授权制度，明确投资决策委员会、投资部门负责人、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，合理确定各投资组合经理的投资权限。投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。投资部门通过规范的投资决策流程公平对待不同投资组合。交易管理部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，对于场内交易的非组合指令启用投资管理系统中的公平交易模块；对于场外交易按照时间优先价格优先的原则公平对待不同账户。监察稽核部风险管理岗对报告期内的交易进行日常监控和分析评估，同时对投资组合的交易价差在不同时间窗(如日内、3日、5日)下进行分析，综合判断各基金之间是否存在不公平交易或利益输送的可能，确保公平交易的实施。

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及《兴华基金管理有限公司公平交易管理办法》，公平对待旗下管理的所有基金及其它组合。

本基金管理人通过统计检验的方法对本公司旗下管理的所有投资组合，在本报告期内不同时间窗口下(1日内、3日内、5日内)同向交易的价差进行了专项分析。根据对样本个数、平均溢价率是否为0的T检验显著程度、平均溢价率以及溢价率分布概率、同向交易价差对投资组合的业绩影响等因素的综合分析，未发现旗下组合存在违反公平交易的情况。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日成交量的 5% 的情况，且未发现其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

## 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 年的股票市场可谓波折动荡，对投资运作构成非常大的挑战。具体指数表现方面，A 股与港股市场均录得大幅下跌，沪深 300 指数全年下跌 11.38%，消费服务指数下跌 14.61%；恒生指数下跌 13.82%，港股通大消费指数下跌 24.78%。

回顾本报告期，事后看，市场的运行主线相对清晰，可以分为三个阶段：第一个阶段是“疫后复苏”主导的阶段，行情主要发生在 1~2 月份，这个阶段经济参与主体对全年的展望普遍比较乐观，经济数据反馈积极，在这个背景下市场整体有比较好的赚钱效应；第二个阶段是“AI 大模型产业革命”主导的阶段，行情主要发生在 3~5 月份，市场参与主体以较高的热情憧憬着人工智能领域的突破性进展将如何改变人类的生产与生活方式，在这个背景下市场掀起了一波剧烈的主题式行情，其中以 TMT 板块的表现最为抢眼，由于跷跷板效应，叠加宏观经济出现环比走弱的迹象，其他板块表现较差；第三个阶段是“宏观经济基本面”主导的阶段，从 6 月份开始，一直持续到年底，能够看到，市场的下跌主要发生在这个阶段，过程中经济数据与政策不断低于市场预期，导致投资者的风险偏好不断走低，从乐观到悲观，再到接受现实，主要市场指数在年底创出新低，资金趋向追逐红利资产以应对高度不确定性的未来。

回顾本报告期内的产品运作，“兴华基金消费精选”全年收益率-0.75%，虽跑赢业绩比较基准，但经过仔细反思，投资运作仍有许多不足：第一，囿于旧式的政策分析框架，对政策定力的预估严重不足，这导致在顺周期类资产上的投资抉择犹豫不决；第二，严重低估了港股市场的参与难度，港股投资损失惨重。

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消费精选 6 个月持有混合发起 A 的基金份额净值为 0.8988 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.75%；同期业绩比较基准收益率为-13.06%。截至本报告期末兴华消费精选 6 个月持有混合发起 C 的基金份额净值为 0.8919 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.13%；



同期业绩比较基准收益率为-13.06%。

#### 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 2024 年，国内外流动性环境或将进一步宽松，市场的核心关注点或将聚焦于宏观经济基本面复苏进程以及产业科技创新。去年 12 月，中央经济工作会议以“以进促稳、先立后破”来定调 24 年的经济工作，财政政策可能会进一步发力，加码托底宏观经济，叠加经济内生修复的动能，经济基本面或将扭转回踩，趋势性走出景气底部。顺周期类的资产，由于其估值已经十分便宜，普遍处于超卖的状态，届时可能会有相应的上涨行情。成长科技方面，AI 大模型持续迭代以及应用落地激发的产业革命或有投资机会。另外，周期方向，行业普遍性亏损下，企业现金流情况可能会持续恶化，中小产能或将被被动出清，生猪与新能源板块的周期可能存在反转机会。

2024 年开年以来，市场的表现大幅低于预期，成长类资产遭到抛售，价值类资产目前尚未看到持续性上涨的动力，只有红利资产有正收益，这表明投资者对经济前景的预期普遍表现为信心不足。尽管如此，我们对股票市场的投资机会仍然持乐观预期，经过大幅回撤之后，市场的各项指标（估值、股息率、股债收益差等）都充分表明资产价格几近见底，从当前资产估值所隐含的或停滞或衰退的未来预期看，并不完全符合我国经济当前的发展阶段以及具体行业的发展规律，叠加房地产的调整或将接近尾声，产业结构的调整也在稳步推进，地缘政治暂时未能改变中国企业的强劲出海势头，对于未来，信心较足。产品运作方面，将积极把握 2024 年 A 股，以及港股市场的上涨行情，保持高仓位水平，努力为投资者带来可观的投资回报。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

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

主要措施有：严格执行集中交易制度，各基金相互独立，交易指令由中央交易室统一执行完成；对基金投资交易系统进行事先合规性设置，并由监察稽核部风险管理岗进行实时监控，杜绝出现违规行为；严格检查基金的投资决策、研究支持、交易过程是否符合规定的程序；通过以上措施，保



证了投资运作遵循投资决策程序与业务流程，保证了基金投资组合符合相关法规及基金合同规定，确保了基金投资行为的独立、公平及合法合规。

(2) 开展定期和专项监察稽核工作，确保各项业务活动的合法合规

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

(3) 促进公司各项内部管理制度的完善

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

(4) 通过各种合规培训提高员工合规意识

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有产品估值委员会，产品估值委员会由基金估值业务分管领导、督察长、基金估值核算负责人、基金会计、监察稽核部人员及相关投研人员等组成。在特殊情况下，公司召集产品估值委员会会议，讨论和决策特殊估值事项，产品估值委员会集体决策，需到会的三分之二估值委员会成员表决通过。产品估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理、投资经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行，一切以维护基金持有人利益为准则。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中债金融估值中心有限公司及中证指数有

限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场债券品种的估值数据及交易所交易的债券品种的估值数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

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，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

### § 6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第 24669 号

#### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人

<p>审计意见</p>	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金(以下简称“兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式基金”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
<p>形成审计意见的基础</p>	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式基金的基金管理人兴华基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、</p>

	<p>故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	单峰   沈俐
会计师事务所的地址	上海市湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2024 年 3 月 25 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	2,274,223.41	1,225,933.74
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	12,464,160.35	19,233,666.86
其中：股票投资		12,464,160.35	19,233,666.86

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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		232.28	49.93
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		14,738,616.04	20,459,650.53
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		119,621.81	-
应付赎回款		1.77	9.53
应付管理人报酬		14,798.88	25,855.84
应付托管费		2,466.47	4,309.31
应付销售服务费		621.85	493.33
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	7.4.7.6	25,000.00	150,000.00
负债合计		162,510.78	180,668.01
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	16,232,640.04	22,399,920.03
未分配利润	7.4.7.8	-1,656,534.78	-2,120,937.51
净资产合计		14,576,105.26	20,278,982.52
负债和净资产总计		14,738,616.04	20,459,650.53

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 16,232,640.04 份，其中兴华消费精选 6 个月持有混合发起 A 基金份额净值 0.8988 元，基金份额总额 14,169,028.79 份；兴华消费精选 6 个月持有混合发起 C 基金份额净值 0.8919 元，基金份额总额 2,063,611.25 份。

## 7.2 利润表

会计主体：兴华消费精选 6 个月持有期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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 25 日(基金合 同生效日)至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		605,489.00	-1,653,104.69
1. 利息收入		9,182.95	27,663.54
其中：存款利息收入	7.4.7.9	9,182.95	27,647.04
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		-	16.50
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		-613,700.01	157,839.52
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-811,660.58	-46,108.53
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	-	-
资产支持证券投 资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	197,960.57	203,948.05
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益 （损失以“-”号填列）	7.4.7.16	1,210,006.06	-1,838,607.75
4. 汇兑收益（损失以 “-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以 “-”号填列）	7.4.7.17	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		297,815.15	489,530.78
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	227,730.32	282,736.50
2. 托管费	7.4.10.2.2	37,955.08	47,122.74
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	7,067.35	8,871.54
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	7.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.19	25,062.40	150,800.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		307,673.85	-2,142,635.47
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		307,673.85	-2,142,635.47
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		307,673.85	-2,142,635.47

注：本基金合同于 2022 年 1 月 25 日生效，上年度可比期间自 2022 年 1 月 25 日至 2022 年 12 月 31 日。

### 7.3 净资产变动表

会计主体：兴华消费精选 6 个月持有期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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	22,399,920.03	-	-2,120,937.51	20,278,982.52
二、本期期初净资产	22,399,920.03	-	-2,120,937.51	20,278,982.52
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-6,167,279.99	-	464,402.73	-5,702,877.26
（一）、综合收益总额	-	-	307,673.85	307,673.85
（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）	-6,167,279.99	-	156,728.88	-6,010,551.11
其中：1. 基金申购款	1,359,009.48	-	-23,565.11	1,335,444.37
2. 基金赎回款	-7,526,289.47	-	180,293.99	-7,345,995.48

（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	16,232,640.04	-	-1,656,534.78	14,576,105.26
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 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	-	-	-	-
二、本期期初净资产	21,611,690.33	-	-	21,611,690.33
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	788,229.70	-	-2,120,937.51	-1,332,707.81
（一）、综合收益总额	-	-	-2,142,635.47	-2,142,635.47
（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）	788,229.70	-	21,697.96	809,927.66
其中：1. 基金申购款	5,752,162.61	-	-152,436.23	5,599,726.38
2. 基金赎回款	-4,963,932.91	-	174,134.19	-4,789,798.72
（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	22,399,920.03	-	-2,120,937.51	20,278,982.52

注：本基金合同于 2022 年 1 月 25 日生效，上年度可比期间自 2022 年 1 月 25 日至 2022 年 12 月 31 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：



韩光华	何美劲	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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

兴华消费精选 6 个月持有期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[2021]4077 号《关于准予兴华消费精选 6 个月持有期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《兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金合同》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 21,609,316.80 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(2022)第 0100 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2022 年 1 月 25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 21,611,690.33 份基金份额,其中认购资金利息折合 2,373.53 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。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为 10,000,450.05 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《兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金基金合同》和《兴华消费精选 6 个月持有期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。

对于每笔基金份额,6 个月持有期起始日指基金合同生效日(对认购份额而言)或该基金份额申购申请确认日(对申购份额而言)。对于每笔基金份额,6 个月持有期到期日指该基金份额 6 个月持有期起始日 6 个月后的月度对应日。在基金份额的 6 个月持有期到期日前(不含当日),基金份额持有人不能对该基金份额提出赎回申请。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金招募说明书》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

发行上市的股票(包括创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、存托凭证、港股通标的股票、债券(包括国债、金融债、地方政府债券、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持债券、政府支持机构债券、次级债、证券公司短期公司债券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、金融衍生品(包括股指期货、国债期货、股票期权)以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的相关规定)。本基金可根据相关法律法规和《兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金基金合同》的约定,参与融资业务。本基金的投资组合比例为:本基金股票及存托凭证资产占基金资产的比例为 60%-95%(其中港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%);其中投资于本基金所界定的消费主题相关行业股票的比例不低于非现金基金资产的 80%。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期以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中证消费服务领先指数收益率 $\times$ 60%+中证港股通大消费主题指数收益率(使用估值汇率调整) $\times$ 20%+中债综合全价(总值)指数收益率 $\times$ 20%。

本财务报表由本基金的基金管理人兴华基金管理有限公司于 2024 年 3 月 25 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《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》、《兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年度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 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较财务报表的实际编制期间为 2022 年

1 月 25 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日止期间。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

##### (1) 金融资产

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

##### 债务工具

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

##### 以摊余成本计量：

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

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

##### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

##### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期

损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)

该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金(1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且(2)交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例

份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息的净额确认为公允价值变动损益；于处

置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。



#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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》、财税[2016]127号《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。

对基金通过沪港通/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/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/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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	353,989.14	328,434.43
等于：本金	353,812.31	328,378.95
加：应计利息	176.83	55.48
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	1,920,234.27	897,499.31
等于：本金	1,920,036.65	897,407.59
加：应计利息	197.62	91.72
减：坏账准备	-	-
合计	2,274,223.41	1,225,933.74

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。

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	13,092,762.04	-	12,464,160.35	-628,601.69
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	13,092,762.04	-	12,464,160.35	-628,601.69
项目	上年度末			
	2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	21,072,274.61	-	19,233,666.86	-1,838,607.75
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	21,072,274.61	-	19,233,666.86	-1,838,607.75

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本报告期末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末，本基金未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 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。

#### 7.4.7.5 其他资产

本报告期末，本基金无其他资产。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
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	25,000.00	150,000.00
合计	25,000.00	150,000.00

#### 7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

兴华消费精选 6 个月持有混合发起 A		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	20,808,758.83	20,808,758.83
本期申购	480,812.90	480,812.90
本期赎回（以“-”号填列）	-7,120,542.94	-7,120,542.94
本期末	14,169,028.79	14,169,028.79

金额单位：人民币元

兴华消费精选 6 个月持有混合发起 C		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,591,161.20	1,591,161.20
本期申购	878,196.58	878,196.58
本期赎回（以“-”号填列）	-405,746.53	-405,746.53
本期末	2,063,611.25	2,063,611.25

#### 7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

兴华消费精选 6 个月持有混合发起 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-188,308.18	-1,776,918.28	-1,965,226.46
本期期初	-	-	-

本期利润	-778,171.90	1,145,297.27	367,125.37
本期基金份额交易产生的变动数	-8,909.27	173,628.40	164,719.13
其中：基金申购款	-11,396.02	6,913.69	-4,482.33
基金赎回款	2,486.75	166,714.71	169,201.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-975,389.35	-457,992.61	-1,433,381.96

单位：人民币元

兴华消费精选 6 个月持有混合发起 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-19,771.93	-135,939.12	-155,711.05
本期期初	-	-	-
本期利润	-124,160.31	64,708.79	-59,451.52
本期基金份额交易产生的变动数	-11,969.08	3,978.83	-7,990.25
其中：基金申购款	-25,976.05	6,893.27	-19,082.78
基金赎回款	14,006.97	-2,914.44	11,092.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-155,901.32	-67,251.50	-223,152.82

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	4,819.96	25,739.14
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	4,362.99	1,907.90
结算备付金利息收入	-	-
其他	-	-
合计	9,182.95	27,647.04

#### 7.4.7.10 股票投资收益

##### 7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-811,660.58	-46,108.53

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	-811,660.58	-46,108.53

#### 7.4.7.10.2 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 25 日(基金合同 生效日)至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	124,395,372.37	33,475,960.46
减：卖出股票成本总额	125,041,478.34	33,447,522.28
减：交易费用	165,554.61	74,546.71
买卖股票差价收入	-811,660.58	-46,108.53

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

本报告期，本基金无债券投资收益。

#### 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本报告期，本基金无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.13 贵金属投资收益

##### 7.4.7.13.1 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。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

##### 7.4.7.14.1 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。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年	上年度可比期间 2022 年 1 月 25 日(基金合同
----	------------------------------	---------------------------------

	12 月 31 日	生效日)至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	197,960.57	203,948.05
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	197,960.57	203,948.05

#### 7.4.7.16 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 25 日(基金合同 生效日)至 2022 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	1,210,006.06	-1,838,607.75
——股票投资	1,210,006.06	-1,838,607.75
——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	1,210,006.06	-1,838,607.75

#### 7.4.7.17 其他收入

本报告期，本基金无其他收入。

#### 7.4.7.18 信用减值损失

本报告期，本基金无信用减值损失。

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 25 日(基金合同 生效日)至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	25,000.00	30,000.00

信息披露费	-	120,000.00
证券出借违约金	-	-
其他	-	800.00
港股通证券组合费	62.40	-
合计	25,062.40	150,800.00

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无需作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的重大资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
兴华基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
招商证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
张磊	基金管理人的股东
韩光华	基金管理人的股东
宿迁信仁企业管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
宿迁信智企业管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
宿迁信忠企业管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
宿迁信礼企业管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
宿迁信勇企业管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
宿迁信良企业管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
青岛信爱投资中心（有限合伙）	基金管理人的股东

注：（1）下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

（2）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)，上述事项已于 2023 年 4 月 19 日完成工商变更登记手续。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元



关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 25 日(基金合同生效日) 至 2022 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
招商证券股份 有限公司	10,146,612.52	4.20%	74,059,026.67	84.16%

#### 7.4.10.1.2 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。

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
招商证券股份 有限公司	-	-	303,000.00	100.00%

#### 7.4.10.1.4 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。

#### 7.4.10.1.5 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 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
招商证券股份有 限公司	4,333.87	10.72%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例

招商证券股份有限公司	31,828.77	93.98%	-	-
------------	-----------	--------	---	---

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

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 25 日(基金合 同生效日)至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	227,730.32	282,736.50
其中：应支付销售机构的客户维护费	42,620.46	57,360.43
应支付基金管理人的净管理费	185,109.86	225,376.07

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 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) 自 2023 年 8 月 1 日起，本基金的管理人报酬由“按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提”调整为“按前一日基金资产净值 1.20% 的年费率计提”。

(3) 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。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 25 日(基金合 同生效日)至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	37,955.08	47,122.74

注：(1) 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。

(2) 自 2023 年 8 月 1 日起, 本基金的托管费由“按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提”调整为本基金的托管费“按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提”。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位: 人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴华消费精选 6 个月持有混合发起 A	兴华消费精选 6 个月持有混合发起 C	合计
兴华基金管理有限公司	0.00	3.65	3.65
招商证券股份有限公司	0.00	2,773.64	2,773.64
合计	0.00	2,777.29	2,777.29
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 25 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴华消费精选 6 个月持有混合发起 A	兴华消费精选 6 个月持有混合发起 C	合计
兴华基金管理有限公司	0.00	256.08	256.08
招商证券股份有限公司	0.00	5,641.68	5,641.68
合计	0.00	5,897.76	5,897.76

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。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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。

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

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

本报告期, 本基金未与关联方进行转融通证券出借业务。

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

本报告期, 本基金未与关联方进行转融通证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用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 12 月 31 日	
	兴华消费精选 6 个月持有混合 发起 A	兴华消费精选 6 个月持有混合 发起 C
基金合同生效日（2022 年 1 月 25 日）持有的基金份额	10,000,450.05	0.00
报告期初持有的基金份额	10,000,450.05	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	-	-
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	10,000,450.05	0.00
报告期末持有的基金份额占基 金总份额比例	70.58%	0.00%

项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日	
	兴华消费精选 6 个月持有混合 发起 A	兴华消费精选 6 个月持有混合 发起 C
基金合同生效日（2022 年 1 月 25 日）持有的基金份额	10,000,450.05	0.00
报告期初持有的基金份额	-	-
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	-	-
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	10,000,450.05	0.00
报告期末持有的基金份额占基 金总份额比例	48.06%	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。

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

份额单位：份

兴华消费精选 6 个月持有混合发起 A
---------------------

关联方名称	本期末 2023 年 12 月 31 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	110.75	0.00%	0.00	0.00%
韩光华	4,330.15	0.03%	998.85	0.00%

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商证券股份有限公司	354,264.75	5,171.62	366,709.26	27,089.14

注：基金托管人受托作为本基金的证券经纪商，上述款项包括本基金由基金托管人招商证券股份有限公司保管的银行存款以及证券交易结算资金，分别存放在具有基金托管资格的银行和基金托管人专用的证券账户，按银行同业利率或协议约定利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期，本基金没有在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

本报告期，本基金未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本报告期末，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。

##### 7.4.12.2 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。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本报告期末，本基金无银行间市场债券正回购。

#### 7.4.12.3.2 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。

### 7.4.12.4 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。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为偏股混合型基金，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。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放于具有基金托管资格的交通银行股份有限公司，其他存款存放于中信建投证券股份有限公司及招商证券股份有限公司，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 12 月 31 日，本基金未持有债券和资产支持证券投资。（上年度末：同）

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2023 年 12 月 31 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。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公

开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2023 年 12 月 31 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 12 月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏



感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为货币资金等。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	2,274,223.41	-	-	-	2,274,223.41
交易性金融资产	-	-	-	12,464,160.35	12,464,160.35
应收申购款	-	-	-	232.28	232.28
资产总计	2,274,223.41	-	-	12,464,392.63	14,738,616.04
负债					
应付清算款	-	-	-	119,621.81	119,621.81
应付赎回款	-	-	-	1.77	1.77
应付管理人报酬	-	-	-	14,798.88	14,798.88
应付托管费	-	-	-	2,466.47	2,466.47
应付销售服务费	-	-	-	621.85	621.85
其他负债	-	-	-	25,000.00	25,000.00
负债总计	-	-	-	162,510.78	162,510.78
利率敏感度缺口	2,274,223.41	-	-	12,301,881.85	14,576,105.26
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					
货币资金	1,225,933.74	-	-	-	1,225,933.74
交易性金融资产	-	-	-	19,233,666.86	19,233,666.86
应收申购款	-	-	-	49.93	49.93
资产总计	1,225,933.74	-	-	19,233,716.79	20,459,650.53
负债					
应付赎回款	-	-	-	9.53	9.53
应付管理人报酬	-	-	-	25,855.84	25,855.84
应付托管费	-	-	-	4,309.31	4,309.31
应付销售服务费	-	-	-	493.33	493.33
其他负债	-	-	-	150,000.00	150,000.00
负债总计	-	-	-	180,668.01	180,668.01
利率敏感度缺口	1,225,933.74	-	-	19,053,048.78	20,278,982.52

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 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
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	867,225.35	-	867,225.35
资产合计	-	867,225.35	-	867,225.35
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	-	867,225.35	-	867,225.35
项目	上年度末 2022 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
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	-	-	-	-

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除市场汇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 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	港币相对人民币升值 5%	43,361.27	-
	港币相对人民币贬值 5%	-43,361.27	-

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；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。本基金股票及存托凭证资产占基金资产的比例为 60%-95%（其中港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%），其中投资于本基金所界定的消费主题相关行业股票的比例不低于非现金基金资产的 80%。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，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2023 年 12 月 31 日		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	12,464,160.35	85.51	19,233,666.86	94.85
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	12,464,160.35	85.51	19,233,666.86	94.85

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准（附注 7.4.1）上升 5%	322,891.72	978,938.63
业绩比较基准（附注 7.4.1）下降 5%	-322,891.72	-978,938.63	

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	12,464,160.35	19,233,666.86

第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	12,464,160.35	19,233,666.86

#### 7.4.14.2.2 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。

#### 7.4.14.3 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。

#### 7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	12,464,160.35	84.57
	其中：股票	12,464,160.35	84.57
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	2,274,223.41	15.43

8	其他各项资产	232.28	0.00
9	合计	14,738,616.04	100.00

注：(1) 本基金报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 867,225.35 元，占期末基金资产净值的比例为 5.95%。

(2) 由于四舍五入的原因，报告期末基金资产组合各项目公允价值占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	739,470.00	5.07
B	采矿业	-	-
C	制造业	8,140,901.00	55.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	579,100.00	3.97
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,442,024.00	9.89
J	金融业	-	-
K	房地产业	290,800.00	2.00
L	租赁和商务服务业	404,640.00	2.78
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	11,596,935.00	79.56

### 8.2.2 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（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	867,225.35	5.95
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	-	-

G 工业	-	-
H 信息技术	-	-
I 电信服务	-	-
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	867,225.35	5.95

注：以上行业分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002011	盾安环境	67,000	921,250.00	6.32
2	01368	特步国际	217,000	867,225.35	5.95
3	603816	顾家家居	18,800	658,000.00	4.51
4	688331	荣昌生物	9,600	595,776.00	4.09
5	603215	比依股份	34,000	588,200.00	4.04
6	002555	三七互娱	31,000	583,110.00	4.00
7	002705	新宝股份	40,000	582,800.00	4.00
8	600975	新五丰	55,000	574,750.00	3.94
9	603444	吉比特	2,200	539,264.00	3.70
10	600809	山西汾酒	2,100	484,533.00	3.32
11	601799	星宇股份	3,600	471,996.00	3.24
12	002674	兴业科技	36,000	438,120.00	3.01
13	002810	山东赫达	20,000	423,800.00	2.91
14	002612	朗姿股份	20,000	384,600.00	2.64
15	603128	华贸物流	50,000	369,500.00	2.53
16	603112	华翔股份	30,000	364,500.00	2.50
17	603786	科博达	5,100	363,936.00	2.50
18	000568	泸州老窖	2,000	358,840.00	2.46
19	600519	贵州茅台	200	345,200.00	2.37
20	300662	科锐国际	12,000	331,440.00	2.27
21	300378	鼎捷软件	15,000	319,650.00	2.19
22	605007	五洲特纸	20,000	294,200.00	2.02
23	600779	水井坊	5,000	293,850.00	2.02
24	002244	滨江集团	40,000	290,800.00	2.00
25	600872	中炬高新	8,000	224,800.00	1.54
26	601598	中国外运	40,000	209,600.00	1.44
27	002384	东山精密	10,000	181,800.00	1.25
28	002714	牧原股份	4,000	164,720.00	1.13
29	000048	京基智农	9,000	164,700.00	1.13
30	600415	小商品城	10,000	73,200.00	0.50

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300662	科锐国际	4,283,115.60	21.12
2	603801	志邦家居	3,441,124.51	16.97
3	600975	新五丰	2,793,003.02	13.77
4	300378	鼎捷软件	2,678,561.00	13.21
5	601799	星宇股份	2,611,629.00	12.88
6	600779	水井坊	2,525,563.48	12.45
7	300687	赛意信息	2,506,700.00	12.36
8	002840	华统股份	2,392,896.00	11.80
9	002714	牧原股份	2,337,024.00	11.52
10	300498	温氏股份	2,189,949.00	10.80
11	600519	贵州茅台	2,139,059.00	10.55
12	01368	特步国际	2,105,477.78	10.38
13	000568	泸州老窖	2,101,475.00	10.36
14	002674	兴业科技	2,018,231.00	9.95
15	603215	比依股份	1,931,586.00	9.53
16	300911	亿田智能	1,882,872.00	9.28
17	603369	今世缘	1,856,550.00	9.16
18	000799	酒鬼酒	1,805,947.00	8.91
19	002705	新宝股份	1,766,812.00	8.71
20	600702	舍得酒业	1,642,825.00	8.10
21	603477	巨星农牧	1,637,910.00	8.08
22	603786	科博达	1,586,496.00	7.82
23	600872	中炬高新	1,433,216.00	7.07
24	002810	山东赫达	1,375,784.00	6.78
25	002612	朗姿股份	1,374,452.00	6.78
26	300856	科思股份	1,310,591.00	6.46
27	600887	伊利股份	1,310,326.00	6.46
28	600285	羚锐制药	1,282,850.98	6.33
29	300170	汉得信息	1,267,707.00	6.25
30	002011	盾安环境	1,227,494.59	6.05
31	600559	老白干酒	1,213,876.00	5.99
32	002508	老板电器	1,201,780.00	5.93
33	300791	仙乐健康	1,185,587.00	5.85
34	002158	汉钟精机	1,170,013.00	5.77
35	002371	北方华创	1,160,397.00	5.72
36	300363	博腾股份	1,154,546.00	5.69
37	600276	恒瑞医药	1,089,847.00	5.37



38	600976	健民集团	1,087,689.00	5.36
39	002027	分众传媒	1,085,543.62	5.35
40	600419	天润乳业	917,614.00	4.52
41	688111	金山办公	863,598.53	4.26
42	02331	李宁	829,553.56	4.09
43	600048	保利发展	828,322.00	4.08
44	300896	爱美客	789,703.00	3.89
45	603112	华翔股份	774,533.00	3.82
46	000999	华润三九	769,742.00	3.80
47	688677	海泰新光	761,525.00	3.76
48	603596	伯特利	759,487.00	3.75
49	603517	绝味食品	754,367.00	3.72
50	000915	华特达因	742,028.00	3.66
51	300223	北京君正	734,658.00	3.62
52	002594	比亚迪	726,676.00	3.58
53	000739	普洛药业	725,643.00	3.58
54	605080	浙江自然	719,508.00	3.55
55	603816	顾家家居	704,257.00	3.47
56	688766	普冉股份	703,286.70	3.47
57	600415	小商品城	701,200.00	3.46
58	300347	泰格医药	682,917.00	3.37
59	300630	普利制药	673,316.00	3.32
60	002003	伟星股份	672,597.00	3.32
61	02313	申洲国际	671,432.54	3.31
62	002368	太极股份	665,748.00	3.28
63	600060	海信视像	663,071.00	3.27
64	300759	康龙化成	659,547.00	3.25
65	605300	佳禾食品	657,415.00	3.24
66	002920	德赛西威	656,297.00	3.24
67	01999	敏华控股	650,322.39	3.21
68	600845	宝信软件	638,937.00	3.15
69	02020	安踏体育	634,708.17	3.13
70	002557	洽洽食品	628,055.00	3.10
71	300146	汤臣倍健	625,192.00	3.08
72	688777	中控技术	623,962.96	3.08
73	603833	欧派家居	622,076.00	3.07
74	688331	荣昌生物	619,935.88	3.06
75	603187	海容冷链	610,971.80	3.01
76	002891	中宠股份	609,910.00	3.01
77	001322	箭牌家居	607,976.76	3.00
78	603755	日辰股份	606,881.00	2.99
79	002475	立讯精密	604,640.00	2.98
80	603313	梦百合	599,393.00	2.96

81	601689	拓普集团	593,782.00	2.93
82	002384	东山精密	593,090.00	2.92
83	600600	青岛啤酒	592,362.00	2.92
84	001323	慕思股份	591,137.00	2.92
85	603889	新澳股份	590,550.40	2.91
86	000596	古井贡酒	590,026.00	2.91
87	605007	五洲特纸	584,721.00	2.88
88	000423	东阿阿胶	583,514.00	2.88
89	002244	滨江集团	581,744.00	2.87
90	603032	德新科技	578,114.00	2.85
91	603198	迎驾贡酒	577,751.00	2.85
92	301061	匠心家居	574,776.00	2.83
93	00291	华润啤酒	571,734.06	2.82
94	000860	顺鑫农业	553,000.00	2.73
95	002555	三七互娱	552,342.89	2.72
96	001215	千味央厨	543,358.74	2.68
97	603444	吉比特	531,620.00	2.62
98	605338	巴比食品	528,492.00	2.61
99	300952	恒辉安防	515,200.00	2.54
100	002409	雅克科技	498,277.00	2.46
101	600809	山西汾酒	474,320.00	2.34
102	603128	华贸物流	466,451.00	2.30
103	000048	京基智农	438,583.00	2.16
104	603885	吉祥航空	431,500.00	2.13
105	300014	亿纬锂能	425,469.00	2.10

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300662	科锐国际	3,952,562.00	19.49
2	603801	志邦家居	3,729,919.00	18.39
3	002714	牧原股份	3,157,148.00	15.57
4	600519	贵州茅台	3,092,718.00	15.25
5	002840	华统股份	2,688,980.00	13.26
6	000568	泸州老窖	2,668,930.44	13.16
7	300687	赛意信息	2,626,048.00	12.95
8	300378	鼎捷软件	2,478,451.00	12.22
9	600975	新五丰	2,430,821.00	11.99
10	601799	星宇股份	2,319,228.00	11.44
11	300498	温氏股份	2,293,815.40	11.31
12	600976	健民集团	2,259,197.62	11.14

13	600779	水井坊	2,252,249.00	11.11
14	300856	科思股份	2,137,640.44	10.54
15	000999	华润三九	1,972,623.00	9.73
16	603369	今世缘	1,935,301.00	9.54
17	300911	亿田智能	1,877,442.00	9.26
18	603477	巨星农牧	1,701,374.00	8.39
19	000799	酒鬼酒	1,662,238.00	8.20
20	002674	兴业科技	1,570,048.00	7.74
21	300244	迪安诊断	1,479,407.00	7.30
22	600702	舍得酒业	1,404,060.00	6.92
23	603215	比依股份	1,325,543.00	6.54
24	600887	伊利股份	1,309,300.00	6.46
25	600285	羚锐制药	1,288,205.00	6.35
26	002508	老板电器	1,240,641.00	6.12
27	300014	亿纬锂能	1,211,705.00	5.98
28	300170	汉得信息	1,194,400.00	5.89
29	600559	老白干酒	1,184,141.00	5.84
30	603786	科博达	1,182,814.00	5.83
31	600872	中炬高新	1,168,617.00	5.76
32	002027	分众传媒	1,167,430.00	5.76
33	002371	北方华创	1,164,157.00	5.74
34	002158	汉钟精机	1,122,570.00	5.54
35	002555	三七互娱	1,112,894.00	5.49
36	300791	仙乐健康	1,085,247.00	5.35
37	002705	新宝股份	1,057,304.00	5.21
38	603885	吉祥航空	1,039,153.00	5.12
39	300363	博腾股份	1,014,235.00	5.00
40	688016	心脉医疗	1,007,074.52	4.97
41	002810	山东赫达	989,026.00	4.88
42	605338	巴比食品	979,121.00	4.83
43	600276	恒瑞医药	959,446.00	4.73
44	601816	京沪高铁	940,300.00	4.64
45	600419	天润乳业	886,431.00	4.37
46	688089	嘉必优	874,122.88	4.31
47	603987	康德莱	866,224.00	4.27
48	002304	洋河股份	864,964.00	4.27
49	600460	士兰微	853,140.00	4.21
50	002612	朗姿股份	836,857.00	4.13
51	688111	金山办公	809,390.00	3.99
52	600048	保利发展	807,114.00	3.98
53	603596	伯特利	806,489.00	3.98
54	300896	爱美客	782,097.00	3.86
55	601238	广汽集团	779,524.00	3.84

56	000887	中鼎股份	757,467.52	3.74
57	000625	长安汽车	727,000.00	3.58
58	01368	特步国际	717,657.49	3.54
59	002594	比亚迪	713,880.00	3.52
60	02313	申洲国际	712,109.86	3.51
61	600703	三安光电	699,750.00	3.45
62	603889	新澳股份	692,947.00	3.42
63	600009	上海机场	692,326.00	3.41
64	001322	箭牌家居	690,050.00	3.40
65	603198	迎驾贡酒	689,397.00	3.40
66	002003	伟星股份	686,420.00	3.38
67	002368	太极股份	674,969.00	3.33
68	02020	安踏体育	674,161.68	3.32
69	000915	华特达因	670,160.00	3.30
70	300347	泰格医药	669,300.00	3.30
71	688677	海泰新光	664,481.89	3.28
72	600060	海信视像	655,512.00	3.23
73	300146	汤臣倍健	653,320.00	3.22
74	301061	匠心家居	652,919.00	3.22
75	603833	欧派家居	652,128.00	3.22
76	603313	梦百合	651,650.00	3.21
77	002920	德赛西威	649,658.00	3.20
78	605080	浙江自然	645,507.00	3.18
79	605300	佳禾食品	643,524.00	3.17
80	300759	康龙化成	637,998.00	3.15
81	002557	洽洽食品	635,268.00	3.13
82	300223	北京君正	624,935.00	3.08
83	603558	健盛集团	620,406.00	3.06
84	01999	敏华控股	618,609.69	3.05
85	603187	海容冷链	615,302.80	3.03
86	02331	李宁	613,563.97	3.03
87	603755	日辰股份	613,465.00	3.03
88	688766	普冉股份	611,473.00	3.02
89	002891	中宠股份	609,839.00	3.01
90	000739	普洛药业	605,940.00	2.99
91	002475	立讯精密	604,300.00	2.98
92	600600	青岛啤酒	602,095.00	2.97
93	600845	宝信软件	598,537.00	2.95
94	000596	古井贡酒	590,641.00	2.91
95	601689	拓普集团	588,745.00	2.90
96	001215	千味央厨	583,456.00	2.88
97	000423	东阿阿胶	581,864.00	2.87
98	001323	慕思股份	577,361.00	2.85

99	603517	绝味食品	573,078.00	2.83
100	600415	小商品城	569,580.00	2.81
101	600745	闻泰科技	569,090.00	2.81
102	000860	顺鑫农业	562,750.00	2.78
103	00291	华润啤酒	552,974.05	2.73
104	300413	芒果超媒	549,348.00	2.71
105	002409	雅克科技	544,349.00	2.68
106	603032	德新科技	538,080.00	2.65
107	688777	中控技术	536,138.81	2.64
108	300630	普利制药	507,572.00	2.50
109	300952	恒辉安防	497,720.00	2.45
110	002011	盾安环境	466,722.35	2.30
111	603112	华翔股份	422,290.18	2.08

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	117,061,965.37
卖出股票收入（成交）总额	124,395,372.37

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

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未参与国债期货投资。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未参与国债期货投资。

## 8.12 投资组合报告附注

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

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

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

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	232.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	232.28

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额类别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
兴华消费精选 6 个月持有混合发起 A	265	53,468.03	10,000,450.05	70.58%	4,168,578.74	29.42%
兴华消费精选 6 个月持有混合发起 C	173	11,928.39	0.00	0.00%	2,063,611.25	100.00%
合计	426	38,104.79	10,000,450.05	61.61%	6,232,189.99	38.39%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额类别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	兴华消费精选 6 个月持有混合发起 A	150,322.63	1.0609%
	兴华消费精选 6 个月持有混合发起 C	23,761.15	1.1514%
	合计	174,083.78	1.0724%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额类别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	兴华消费精选 6 个月持有混合发起 A	0~10
	兴华消费精选 6 个月持有混	0

	合发起 C	
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	兴华消费精选 6 个月持有混合发起 A	0
	兴华消费精选 6 个月持有混合发起 C	0
	合计	0

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

#### 9.4 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	10,000,450.05	61.61%	10,000,450.05	61.61%	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	10,000,450.05	61.61%	10,000,450.05	61.61%	三年

### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	兴华消费精选 6 个月持有混合发起 A	兴华消费精选 6 个月持有混合发起 C
基金合同生效日（2022 年 1 月 25 日）基金份额总额	18,578,225.77	3,033,464.56
本报告期期初基金份额总额	20,808,758.83	1,591,161.20
本报告期基金总申购份额	480,812.90	878,196.58
减：本报告期基金总赎回份额	7,120,542.94	405,746.53
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	14,169,028.79	2,063,611.25

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。



## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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；2023 年 7 月 23 日，本基金托管人招商证券股份有限公司免去赵斗斗担任的托管部副总经理职务，另有任用。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、公募基金托管业务的诉讼。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务，无改聘情况。

本报告期内实际应支付会计师事务所的审计费为 25,000 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 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	-

### 11.6.2 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，本基金托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	
中信建投证券股份有限公司	2	231,310,725.22	95.80%	36,097.26	89.28%	-
招商证券股份有限公司	2	10,146,612.52	4.20%	4,333.87	10.72%	-

注：（1）报告期内未新增或退租证券公司交易单元。

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

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

(3) 基金交易单元的选择程序如下:

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

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金未使用所租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

### 11.8 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	兴华消费精选 6 个月持有期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	兴华消费精选 6 个月持有期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
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	兴华消费精选 6 个月持有期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
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	关于兴华消费精选 6 个月持有期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 6 月 7 日
9	兴华兴华消费精选 6 个月持有期混合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 8 日
10	兴华消费精选 6 个月持有期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 6 月更新)	中国证监会规定媒介	2023 年 6 月 8 日
11	兴华消费精选 6 个月持有期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 6 月更新)	中国证监会规定媒介	2023 年 6 月 8 日
12	兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金招募说明书及基金	中国证监会规定媒介	2023 年 6 月 8 日

	产品资料概要更新提示性公告		
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
15	兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	中国证监会规定媒介	2023 年 7 月 20 日
16	兴华基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 7 月 29 日
17	兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金基金合同更新	中国证监会规定媒介	2023 年 7 月 29 日
18	兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金托管协议更新	中国证监会规定媒介	2023 年 7 月 29 日
19	兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金招募说明书（2023 年 7 月更新）	中国证监会规定媒介	2023 年 7 月 29 日
20	兴华消费精选 6 个月持有期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 7 月更新）	中国证监会规定媒介	2023 年 7 月 29 日
21	兴华消费精选 6 个月持有期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 7 月更新）	中国证监会规定媒介	2023 年 7 月 29 日
22	关于不法分子假冒兴华基金管理有限公司名义从事诈骗活动的风险提示	中国证监会规定媒介	2023 年 8 月 14 日
23	兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金 2023 年中期报告	中国证监会规定媒介	2023 年 8 月 29 日
24	兴华基金管理有限公司关于青岛分公司办公地址变更的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 8 月 30 日
25	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 10 月 17 日
26	兴华基金关于招商证券代销基金参与定投费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 10 月 19 日
27	兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	中国证监会规定媒介	2023 年 10 月 25 日
28	兴华基金管理有限公司关于青岛分公司负责人变更的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 11 月 17 日
29	兴华基金管理有限公司关于旗下部分	中国证监会规定媒介	2023 年 11 月 30 日

	基金新增珠海盈米基金销售有限公司为销售机构的公告		
30	兴华基金管理有限公司关于设立上海分公司的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 12 月 29 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20230101 - 20231231	10,000,450.05	0.00	0.00	10,000,450.05	61.61%
	2	20230101 - 20230301	5,107,274.21	0.00	5,107,274.21	0.00	0.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

(1) 本基金对每份基金份额设置 6 个月持有期。在基金份额的 6 个月持有期到期日前（不含当日），投资者将面临因不能赎回基金份额而出现的流动性约束。

(2) 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。

#### (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。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、关于准予兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金注册的批复
- 2、《兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《兴华消费精选 6 个月持有期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

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

### 13.3 查阅方式

投资者可以在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

兴华基金管理有限公司

2024 年 3 月 29 日