

兴银中证科创创业 50 指数型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 月 30 日

基金管理人：兴银基金管理有限责任公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 10 月 27 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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 2021 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 兴银中证科创创业 50 指数 |
| 场内简称 | - |
| 交易代码 | 012898 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2021 年 7 月 14 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 614,029,332.24 份 |
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。 |
| 投资策略 | <p>本基金采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。</p> <p>特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股票长期停牌；（4）其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。</p> <p>本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理</p> |

| | | |
|-----------------|--|------------------|
| | 措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。 | |
| 业绩比较基准 | 中证科创创业 50 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5% | |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，理论上其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数类似的风险收益特征。本基金可投资科创板和创业板股票，会面临科创板和创业板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括流动性风险、退市风险和投资集中风险等。 | |
| 基金管理人 | 兴银基金管理有限责任公司 | |
| 基金托管人 | 兴业银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 兴银中证科创创业 50 指数 A | 兴银中证科创创业 50 指数 C |
| 下属分级基金的场内简称 | - | - |
| 下属分级基金的交易代码 | 012898 | 012899 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 506,251,044.94 份 | 107,778,287.30 份 |
| 下属分级基金的风险收益特征 | 风险收益特征同上。 | 风险收益特征同上。 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2021年7月14日—2021年9月30日） | |
|-----------------|----------------------------|------------------|
| | 兴银中证科创创业 50 指数 A | 兴银中证科创创业 50 指数 C |
| 1. 本期已实现收益 | 2,654,561.07 | 529,853.00 |
| 2. 本期利润 | -40,085,472.62 | -8,345,264.92 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0776 | -0.0773 |
| 4. 期末基金资产净值 | 467,327,668.05 | 99,470,250.48 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.9231 | 0.9229 |

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、所述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。

3.2 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

兴银中证科创创业 50 指数 A

| 阶段 | 净值增长率① | 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 |
|--------------------|--------|---------------|----------------|-------------------|-------|--------|
| 自基金合 同生效起 至今 | -7.69% | 1.46% | -11.92% | 1.83% | 4.23% | -0.37% |

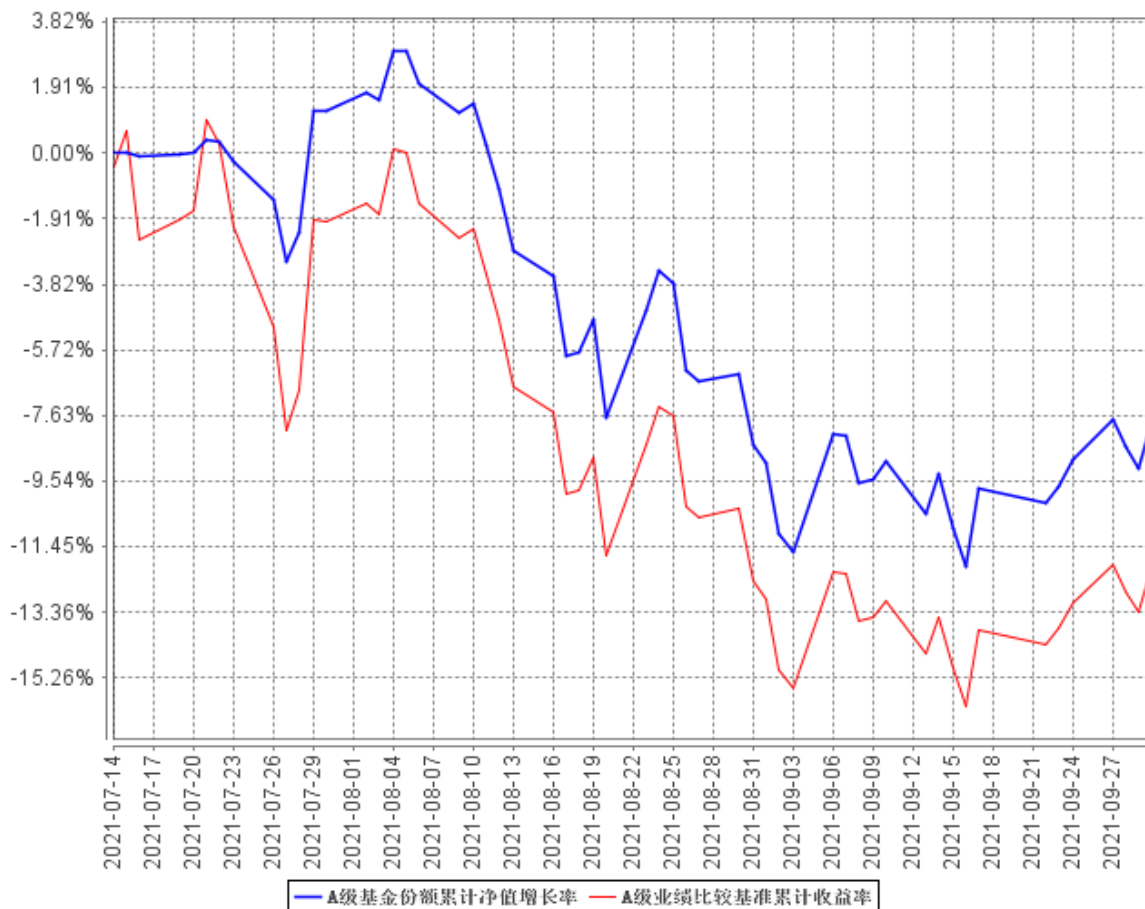
兴银中证科创创业 50 指数 C

| 阶段 | 净值增长率① | 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 |
|--------------------|--------|---------------|----------------|-------------------|-------|--------|
| 自基金合 同生效起 至今 | -7.71% | 1.46% | -11.92% | 1.83% | 4.21% | -0.37% |

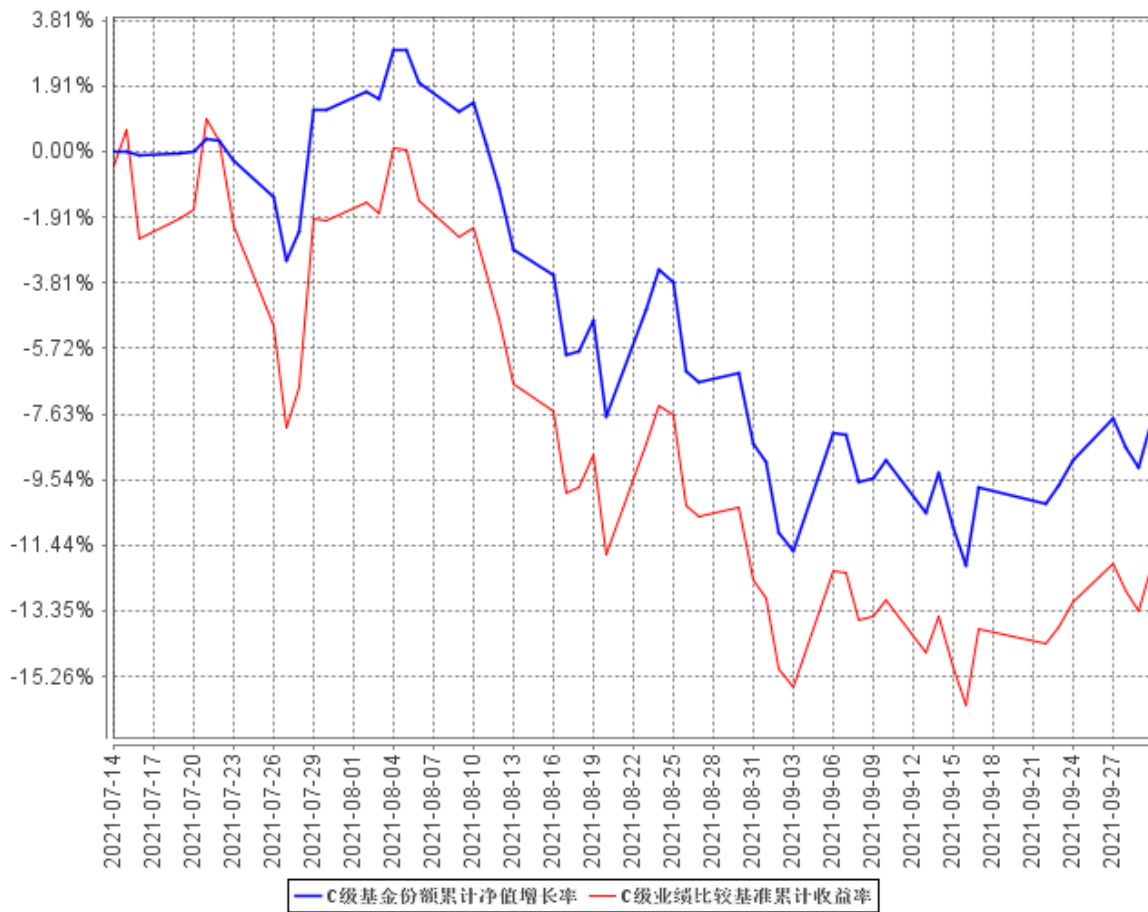
注：1、本基金成立于 2021 年 7 月 14 日；2、比较基准：中证科创创业 50 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金成立于 2021 年 7 月 14 日；2、比较基准：中证科创创业 50 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|------|-----------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 刘帆 | 基金经理 | 2021 年 7 月 14 日 | - | 5 | 硕士研究生，FRM(金融风险管理师)，5 年基金行业工作经验，曾任平安基金管理有限公司中央交易室交易员、ETF 指数投资中心研究员兼基金经理助理。2020 年 11 月加入兴银基金管理有限责任公司，现任兴银基金管理有限责任公司指数与量化投资部基金经理。2021 年 7 月起任兴银中证科创创业 50 指数型证券投资基金基金经理。2021 年 8 月起任兴银国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金基金经理。 |

4.1.1 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

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规的规定，基金合同、招募说明书等基金法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人按照法律法规关于公平交易的相关规定，严格执行公司公平交易

管理制度，加强了对所管理的不同投资组合向交易价差的分析，确保公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年三季度，全球经济出现了较明显的从复苏走向“类滞涨”的格局。全球经济增长动能边际弱化，中国经济景气度开始下滑，美欧经济亦完成筑顶有所回落。全球通胀水平迭创新高，国内 PPI 同比处于历史高位。与此同时，发达经济体收紧货币的操作仍未进行，部分新兴经济体已计划提前加息以应对美联储的流动性转向。在此背景下，三季度权益资产表现不尽人意，尤其是相对高估值的科创板、创业板。

指数层面，代表中小盘、周期含量相对较高的国证 2000、中证 1000 以及中证 500 涨幅靠前，代表大市值的科创创业 50、上证 50、沪深 300 跌幅靠前。高成长高估值的科创 50、科创创业 50 领跌主流指数。

报告期内，我们严格按照基金合同的规定，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化的投资策略进行被动投资。本基金自 8 月 20 日开放申赎以来，日均绝对跟踪偏离度 0.11%，年化跟踪误差 2.49%。同时本基金通过合理把控建仓节奏、积极参与打新等为投资者谋取一些确定性较强的超额收益，报告期内本基金 A 类相对业绩比较基准实现超额收益 4.23%。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末兴银中证科创创业 50 指数 A 基金份额净值为 0.9231 元，本报告期基金份额净值增长率为-7.69%；截至本报告期末兴银中证科创创业 50 指数 C 基金份额净值为 0.9229 元，本报告期基金份额净值增长率为-7.71%；同期业绩比较基准收益率为-11.92%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 529,577,853.94 | 93.17 |
| | 其中：股票 | 529,577,853.94 | 93.17 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 20,153,564.40 | 3.55 |
| | 其中：债券 | 20,153,564.40 | 3.55 |
| | 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 | 16,289,812.45 | 2.87 |
| 8 | 其他资产 | 2,381,436.89 | 0.42 |
| 9 | 合计 | 568,402,667.68 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 409,443,027.21 | 72.24 |
| 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 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 43,324,140.20 | 7.64 |
| J | 金融业 | 5,347,094.00 | 0.94 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |

| | | | |
|---|---------------|----------------|-------|
| M | 科学研究和技术服务业 | 34,450,906.00 | 6.08 |
| 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 | 29,908,378.80 | 5.28 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 6,756,450.00 | 1.19 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 529,229,996.21 | 93.37 |

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 284,082.06 | 0.05 |
| 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 | 51,276.58 | 0.01 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | 3,345.12 | 0.00 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 9,153.97 | 0.00 |
| 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 | 347,857.73 | 0.06 |

5.2.3 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沪港通投资股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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 | 300750 | 宁德时代 | 102,500 | 53,887,325.00 | 9.51 |
| 2 | 300760 | 迈瑞医疗 | 126,000 | 48,562,920.00 | 8.57 |
| 3 | 300274 | 阳光电源 | 211,300 | 31,352,694.00 | 5.53 |
| 4 | 300015 | 爱尔眼科 | 560,082 | 29,908,378.80 | 5.28 |
| 5 | 300122 | 智飞生物 | 165,800 | 26,360,542.00 | 4.65 |
| 6 | 300014 | 亿纬锂能 | 234,800 | 23,252,244.00 | 4.10 |
| 7 | 300142 | 沃森生物 | 324,600 | 20,508,228.00 | 3.62 |
| 8 | 300124 | 汇川技术 | 320,750 | 20,207,250.00 | 3.57 |
| 9 | 688981 | 中芯国际 | 350,427 | 19,343,570.40 | 3.41 |
| 10 | 300347 | 泰格医药 | 108,700 | 18,913,800.00 | 3.34 |

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

| 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 | 688776 | 国光电气 | 1,447 | 183,334.90 | 0.03 |
| 2 | 301078 | 孩子王 | 7,551 | 43,569.27 | 0.01 |
| 3 | 001217 | 华尔泰 | 1,239 | 20,530.23 | 0.00 |
| 4 | 001218 | 丽臣实业 | 350 | 15,928.50 | 0.00 |
| 5 | 301069 | 凯盛新材 | 539 | 12,413.17 | 0.00 |

5.3.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 20,153,564.40 | 3.56 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 20,153,564.40 | 3.56 |

5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 019658 | 21 国债 10 | 201,980 | 20,153,564.40 | 3.56 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

报告期内未进行股指期货投资

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

报告期内未进行国债期货投资

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

报告期内未进行国债期货投资

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

5.11.2 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

本基金不存在前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情形。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 183,768.08 |
| 2 | 应收证券清算款 | 41,156.13 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 82,068.02 |
| 5 | 应收申购款 | 2,074,444.66 |

| | | |
|---|-------|--------------|
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 2,381,436.89 |

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资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。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1 | 688776 | 国光电气 | 183,334.90 | 0.03 | 流通受限 |
| 2 | 301078 | 孩子王 | 43,569.27 | 0.01 | 新股锁定 |
| 3 | 001218 | 丽臣实业 | 15,928.50 | 0.00 | 新股锁定 |
| 4 | 301069 | 凯盛新材 | 12,413.17 | 0.00 | 流通受限 |

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 兴银中证科创创业 50 指数 A | 兴银中证科创创业 50 指数 C |
|------------------------------------|------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2021 年 7 月 14 日） | 522,249,944.18 | 108,660,078.38 |
| 基金份额总额 | | |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 28,309,387.68 | 14,435,927.85 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 44,308,286.92 | 15,317,718.93 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 506,251,044.94 | 107,778,287.30 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

本基金本报告期内单一投资者持有基金份额比例未出现超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予兴银中证科创创业 50 指数型证券投资基金募集注册的文件
2. 《兴银中证科创创业 50 指数型证券投资基金基金合同》
3. 《兴银中证科创创业 50 指数型证券投资基金招募说明书》
4. 《兴银中证科创创业 50 指数型证券投资基金托管协议》
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照
6. 报告期内在指定信息披露媒体上公开披露的各项公告

9.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处。

9.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。投资者对本报告书如有疑问，可拨打客服电话（40000-96326）咨询本基金管理人。

兴银基金管理有限责任公司

2021 年 10 月 27 日