

兴银科技增长 1 个月滚动持有期混合型证券投资基金

2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 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:2022 年 03 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年3月28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。

本报告期自2021年1月1日起至12月31日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....	14
4.10 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.....	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§ 6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	15
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
§ 8 投资组合报告	44

8.1 期末基金资产组合情况.....	44
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	45
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.....	45
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	65
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.....	65
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.....	65
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.....	65
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.....	65
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	66
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	66
8.12 投资组合报告附注.....	66
§ 9 基金份额持有人信息.....	67
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	67
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	67
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情况.....	67
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况.....	68
§ 10 开放式基金份额变动.....	68
§ 11 重大事件揭示.....	68
11.1 基金份额持有人大会决议.....	68
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.....	68
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	69
11.4 基金投资策略的改变.....	69
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	69
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.....	69
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	69
11.8 其他重大事件.....	69
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	72
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.....	72
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	72
§ 13 备查文件目录.....	72
13.1 备查文件目录.....	72
13.2 存放地点.....	73
13.3 查阅方式.....	73

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴银科技增长1个月滚动持有期混合型证券投资基金	
基金简称	兴银科技增长1个月滚动持有混合	
基金主代码	010925	
基金运作方式	<p>契约型开放式</p> <p>1、每个运作期到期日前，基金份额持有人不能提出赎回申请。</p> <p>对于每份基金份额，第一个运作期指基金合同生效日（对认购份额而言，下同）或基金份额申购确认日（对申购份额而言，下同）起（即第一个运作起始日），至基金合同生效日或基金份额申购确认日1个月后的月度对日（即第一个运作期到期日。如该对应日为非工作日，或无对应日期，则顺延到下一工作日）止。第二个运作期指第一个运作期到期日的次一日起，至基金合同生效日或基金份额申购确认日2个月后的月度对日（如该日为非工作日，或无对应日期，则顺延至下一工作日）止。以此类推。</p> <p>2、每个运作期到期日，基金份额持有人可提出赎回申请。每个运作期到期日，基金份额持有人可提出赎回申请。如果基金份额持有人在当期运作期到期日未申请赎回，则自该运作期到期日下一日起该基金份额进入下一个运作期。</p>	
基金合同生效日	2021年02月18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	
报告期末基金份额总额	171,746,701.63份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	兴银科技增长1个月滚动持有混合A	兴银科技增长1个月滚动持有混合C
下属分级基金的交易代码	010925	010926
报告期末下属分级基金的份额总额	152,970,677.93份	18,776,023.70份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过研究挖掘科技增长主题的上市公司，把握相关领域科技发展与创新所带来的投资机会，分享其在中国经济创新驱动发展的大背景下的可持续性增长，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产超越业绩比较标准的长期稳定增值。
投资策略	本基金在资产配置上采取相对稳健的策略，采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，根据各类资产不同的预期风险收益比来确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。

业绩比较基准	中国战略新兴产业成份指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%	
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期风险与预期收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。	
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。

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		兴银基金管理有限责任公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴真子	龚小武
	联系电话	86-21-20296358	021-52629999-212056
	电子邮箱	wzz@hffunds.cn	gongxiaowu@cib.com.cn
客户服务电话		40000-96326	95561
传真		86-21-68630069	021-62159217
注册地址		平潭综合实验区金井湾商务营运中心6号楼11层03-3房	福州市湖东路154号
办公地址		中国上海市浦东新区滨江大道5129号陆家嘴滨江中心N1幢三层、五层	上海市银城路167号兴业大厦4楼
邮政编码		200120	200120
法定代表人		张贵云	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的基金管理人互联网网址	www.hffunds.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市南京西路1266号恒隆广场2期16楼
注册登记机构	兴银基金管理有限责任公司	上海市浦东新区滨江大道5129号陆家嘴滨江中心N1幢三层、五层

§ 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	2021年02月18日（基金合同生效日）-2021年12月31日
---------------	----------------------------------

	兴银科技增长1个月滚动持有混合A	兴银科技增长1个月滚动持有混合C
本期已实现收益	174,467,210.45	18,715,129.30
本期利润	176,891,621.06	21,921,850.18
加权平均基金份额本期利润	0.3837	0.3231
本期加权平均净值利润率	35.78%	30.62%
本期基金份额净值增长率	20.01%	19.48%
3.1.2 期末数据和指标	2021年末	
期末可供分配利润	30,614,270.13	3,657,016.15
期末可供分配基金份额利润	0.2001	0.1948
期末基金资产净值	183,584,948.06	22,433,039.85
期末基金份额净值	1.2001	1.1948
3.1.3 累计期末指标	2021年末	
基金份额累计净值增长率	20.01%	19.48%

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。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的孰低数（为期末余额），即如果期末未分配利润（报表数，下同）的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果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（已实现部分扣除未实现部分）。

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

兴银科技增长1个月滚动持有混合A净值表现

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	-6.37%	1.46%	0.31%	0.81%	-6.68%	0.65%
过去六个月	-0.22%	1.88%	-5.82%	1.10%	5.60%	0.78%
自基金合同生效起至今	20.01%	1.65%	-10.01%	1.32%	30.02%	0.33%

兴银科技增长1个月滚动持有混合C净值表现

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	-6.49%	1.46%	0.31%	0.81%	-6.80%	0.65%
过去六个月	-0.48%	1.88%	-5.82%	1.10%	5.34%	0.78%

自基金合同生效起至今	19.48%	1.65%	-10.01%	1.32%	29.49%	0.33%
------------	--------	-------	---------	-------	--------	-------

注：1、本基金成立于 2021 年 2 月 18 日；2、比较基准：中国战略新兴产业成份指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%。

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021年02月18日-2021年12月31日)



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021年02月18日-2021年12月31日)



注：1、本基金成立于 2021 年 2 月 18 日；2、比较基准：中国战略新兴产业成份指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%。

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



注：1、本基金成立于 2021 年 2 月 18 日；2、比较基准：中国战略新兴产业成份指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%。

3.3 其他指标

注：无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

§ 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

兴银基金管理有限责任公司，注册地为福建省平潭综合实验区，公司主要办公场所位于上海市浦东新区。公司经营范围包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。公司股东为华福证券有限责任公司与国脉科技股份有限公司。

本公司经证监会证监许可〔2013〕1289号文批准，于2013年10月25日成立。2016年9月23日，公司股东同比例增资，公司注册资本由10,000万元变更为14,300万元。增资后股东出资比例维持不变，华福证券有限责任公司出资比例为76%，国脉科技股份有限公司出资比例为24%。2016年10月24日，公司法定名称由“华福基金管理有限责任公司”变更为“兴银基金管理有限责任公司”。

截至报告期末，本公司管理39只开放式基金（兴银现金收益货币市场基金、兴银收益增强债券型证券投资基金、兴银现金添利货币市场基金、兴银长盈三个月定期开放债券型证券投资基金、兴银长益三个月定期开放债券型证券投资基金、兴银消费新趋势灵活配置混合型证券投资基金、兴银货币市场基金、兴银大健康灵活配置混合型证券投资基金、兴银朝阳债券型证券投资基金、兴银鼎新灵活配置混合型证券投资基金、兴银长乐半年定期开放债券型证券投资基金、兴银丰盈灵活配置混合型证券投资基金、兴银现金增利货币市场基金、兴银瑞益纯债债券型证券投资基金、兴银稳健债券型证券投资基金、兴银合盈债券型证券投资基金、兴银丰润灵活配置混合型证券投资基金、兴银中短债债券型证券投资基金、兴银汇福定期开放债券型发起式证券投资基金、兴银汇逸三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、兴银合丰政策性金融债债券型证券投资基金、兴银上海清算所3-5年中高等级优选信用债指数证券投资基金、兴银鑫日享短债债券型证券投资基金、兴银先锋成长混合型证券投资基金、兴银汇裕一年定期开放债券型发起式证券投资基金、兴银聚丰债券型证券投资基金、兴银合盛三年定期开放债券型证券投资基金、兴银汇悦一年定期开放债券型发起式证券投资基金、兴银汇智一年定期开放债券型发起式证券投资基金、兴银丰运稳益回报混合型证券投资基金、兴银研究精选股票型证券投资基金、兴银合富债券型证券投资基金、兴银景气优选混合型证券投资基金、兴银策略智选混合型证券投资基金、兴银汇泽87个月定期开放债券型证券投资基金、兴银科技增长1个月滚动持有期混合型证券投资基金、兴银中证500指数增强型证券投资基金、兴银高端制造混合型证券投资基金、兴银稳安60天滚动持有债券型发起式证券投资基金、兴银中证科创创业50指数型证券投资基金、兴银国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金、兴银兴慧一年持有期混合型证券投资基金），净值总规模超600亿元。

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		
杨坤	本基金的基金经理、公司权益业务总监兼权益投资部总经理。	2021-02-18	-	14年	硕士研究生。历任光大保德信基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理；中欧基金管理有限公司研究部副总监、专户事业部投资经理助理；海富通基金管理有限公司投资经理；富国基金管理有限公司投资经理；财通证券资产管理有限公司基金经理。2019年1月加入兴银

					基金管理有限责任公司，现任兴银基金权益业务总监，兼任权益投资部总经理、基金经理。
张世略	本基金的基金经理	2021-02-18	-	5 年	硕士研究生。历任兴银基金管理有限责任公司行业研究员、基金经理助理。现任兴银基金权益投资部基金经理。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告载明日期。

杨坤女士和张世略先生为本基金的首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情形，无须披露该项。

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 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

本基金管理人制定了公平交易管理的制度，并根据法律法规及监管规定结合实践予以修订完善。本基金管理人主要从研究的公平、决策的公平、交易的公平、公平交易的监控评估、公平交易的报告和信息披露等方面对公平交易行为进行规范，从而达到保证本基金管理人管理的不同投资组合得到公平对待、保护投资者合法权益的目的。

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间交易价差的分析，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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金管理人制定了异常交易监控管理的制度，并根据法律法规及监管规定结合实践予以修订完善。本报告期内，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

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

2021 年，中国充分利用疫情控制的先发优势，在全球范围内经济率先复苏，上半年 GDP 维持较高增速，然后进入下半年，国内经济修复后续动能开始呈现不足之势，传统三级马车增速均有较大幅度回落，难以维持 GDP 增速。在此期间，A 股市场整体呈现震荡上行的趋势，全年来看，国内宏观经济前低后高的特点，使得国内货币政策呈现出前松后紧的特征，推动市场发生较大的风格变化，年初市场风格集中在大盘蓝筹，而下半年则呈现出科技成长风格，进入四季度后，成长风格再度出现分化，部分高景气高估值赛道率先出现调整，而传统行业悄然开始行情。纵观全年的行情，市场每一次的风格切换背后都蕴藏着投资者对于投资标的的估值、成长性、确定性的比较与选择，也映射出目前市场参与者逐渐成熟、追求合理定价和高投资性价比的特征。报告期内，产品充分把握市场机遇，保持投资策略稳定，投资风格一致，主动追求估值与成长性比价合理，具有较高投资性价比的投资机会，产品在医药、半导体、新能源、军工、TMT 等行业均有布局，通过全面的行业比较和个股分析，调整行业权重，在寻找高成长性的同时保持组合平衡性。本产品始终围绕优质行业，优质公司进行重点布局，通过对高景气行业的深度跟踪和调研分析，甄选优质个股布局，伴随企业成长。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴银科技增长 1 个月滚动持有混合 A 基金份额净值为 1.2001 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 20.01%，同期业绩比较基准收益率为-10.01%；截至报告期末兴银科技增长 1 个月滚动持有混合 C 基金份额净值为 1.1948 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 19.48%，同期业绩比较基准收益率为-10.01%。

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 2022 年，中国经济发展面对较大的挑战。社零数据自 2020 年以来一直在底部区间震荡，致使消费市场整体表现低迷；出口市场在疫情期间充分发挥国内疫情率先得以控制的先发优势后，2022 年很难维持高增速；而房地产长市场目前面临的情况更加严峻，部分房企在债务端背负较大压力，现金流紧张，导致项目停止，债务刚兑问题频发。因此上半年中国宏观经济面临较大困境，GDP 增速可能较 21 年四季度继续放缓。但是同时，这是中国经济转型进入深水区后必经的阵痛期，以新能源、高科技、高端制造为代表的先进制造业正在高速蓬勃发展，逐渐成为支撑中国经济的重要增长来源。因此，站在当下，中国经济虽然面临压力，但是中国经济更加充满生机。另一方面，随着中国资本市场制度的不断完善，资金结构中专业投资者比例不断提高，市场对于行业景气度高、成长路径明确以及具有稳定业绩的优质行业和企业认可度越来越高，这将支撑 A 股的市场未来呈现出稳定的成长趋势，成为居民资产配置的重要选择方向。

行业配置，我们对主要大类板块的看法如下：

(1) 消费医药：我们认为共同富裕的内涵是“去奢侈品化、去金融化”，回归消费和医药的本来属性，类比“房住不炒”下的地产逐步回归商品属性。消费医药板块中的优质个股行业竞争格局较为稳定，尤其在 A 股总体盈利能力回落的阶段，消费和医药等具备防御属性的资产可能并不差，尤其是相关板块由于政策等因素积累较大跌幅之后，在行业基本面逻辑没有破坏的前提下，估值已经逐步具备吸引力。

(2) 泛新能源资产仍是中长期景气度较好的领域，目前的问题在于部分产能供给扩张较快的行业未来的供需格局是否发生变化、估值和业绩增速的匹配度、以及交易层面的拥挤度等问题。今年在该板块上的标的筛选将较以往更加严苛。

(3) 科技成长板块聚焦“数字经济”范畴下具备中长期投资价值的核心标的。2021 年下半年以来关于数字经济的政策出台较为频繁,我们尤其看好产业数字化带来的制造业成本的降低,在“云化、智能化、国产化”三大周期叠加下,重点关注工业软件、能源 IT、智能驾驶、金融信创、数据安全等细分方向。

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,本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发,不断健全完善内控机制,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,推动公司的合规文化和内部风险控制机制的完善与优化。本基金管理人主要监察稽核工作如下:

(1) 加强公司和基金日常运作的合规审核。做好在新基金产品开发、新投资品种、及其他创新业务中法律、合规及风险控制方面的支持,坚持定期对投资、研究、交易、核算、销售等各项业务实施事前、事中、事后的合规性审核,确保基金运作的诚信和合法合规性符合监管要求。

(2) 深入重点专项稽核工作。本基金管理人进一步梳理业务模式、主要监管规则、潜在风险点等,全面、深入地对关键业务领域进行专项稽核,内容涵盖相关业务领域的各个重要环节的内部控制与风险防范,促进制度规章及时更新,优化操作流程,提升业务线合规管理及风控意识。

(3) 进一步规范对投资研究交易特定岗位的通讯管理。对投资研究交易特定岗位通讯工具在交易时间集中管理,并定期或不定期的对其网络即时通讯记录、电话录音等进行抽查,有效地防范了各种形式的利益输送行为。

(4) 强化法规学习,开展内控培训,促进合规文化建设。本基金管理人及时根据新颁布的法律法规开展合规宣传培训工作,通过专题培训、律师讲座、合规期刊等多种形式进一步加强内部合规培训力度,深化基金从业人员合规风险意识,提升职业道德素养,营造良好合规氛围,促进公司稳定健康地发展。

(5) 完成各种定期报告及临时公告的信息披露工作。按照法规要求,做好旗下各支基金的信息披露工作,做到信息披露的真实、完整、准确、及时。

在今后的工作中,本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念,完善内控制度,提高工作水平,努力防范和控制各种风险,保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

根据证监会的相关规定,本公司为建立健全有效的估值政策和程序,成立估值小组,明确参与估值流程各方的人员分工和职责。估值小组组长由分管基金事务部的公司领导担任,成员由基金事务部、合规与风险管理部、研究发展部、权益投资部/固定收益部(视会议议题内容选择相关投资方向部门)部门负责人组成。估值小组成员具备应有的经验、专业胜任能力和独立性,分工明确,在上市公司研究和估值、基金投资、投资品种所属行业的专业研究、估值政策、估值流程和程序、基金的风险控制与绩效评估、会计政策与基金核算以及相关事项的合法合规性审核和监督等各个方面具备专业能力。估值小组严格按照工作流程诚实守信、勤勉尽责地讨论和决策估值事项。日常估值项目由基金事务部严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定执行。当经济环境和证券市场发生重大变化时,针对特殊估值工作,按照以下工作流程进行:由公司估值小组依据行业协会提供的估值模型和行业做法选定与当时市场经济环境相适应的估值方法并征求托管行、会计师事务所的相关

意见,由基金事务部做出提示,对其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响是否在0.25%以上进行测算,并对确认产生影响的品种根据前述估值模型、估值流程计算,提供相关投资品种的公允价值以进行估值处理,待清算人员复核后,将估值结果反馈基金经理,并提交公司估值小组。其他特殊情形,可由基金经理主动做出提示,并由研究员提供研究报告,交估值小组审议,同时按流程对外公布。

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理参与对估值问题的讨论,对估值结果提出反馈意见,但不介入基金日常估值业务。

3、本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

4、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金合同》,基金收益分配原则为:1、本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红。2、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。3、A类基金份额和C类基金份额之间由于收取费用的不同,将导致在可供分配利润上有所不同;同一类别每一基金份额享有同等分配权;4、法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 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

本基金本报告期内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 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

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

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;基金管理人在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、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 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	毕马威华振审字第2200212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	兴银科技增长1个月滚动持有期混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的兴银科技增长1个月滚动持有期混合型证券投资基金(以下简称“兴银科技增长1个月滚动持有混合基金”)财务报表,包括2021年12月31日的资产负债表、自2021年2月18日(基金合同生效日)至2021年12月31日止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注7.4.2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”)和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制,公允反映了兴银科技增长1个月滚动持有混合基金2021年12月31日的财务状况以及自2021年2月18日(基金合同生效日)至2021年12月31日止期间的经营成果及基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则(以下简称“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。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于兴银科技增长1个月滚动持有混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。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。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	兴银科技增长1个月滚动持有混合基金管理人兴银基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括兴银科技增长1个月滚动持有混合基金2021年年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报

	告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，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。在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估兴银科技增长 1 个月滚动持有混合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，除非兴银科技增长 1 个月滚动持有混合基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督兴银科技增长 1 个月滚动持有混合基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	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。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：(1)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、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。(2)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。(3)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。(4)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，就可能对兴银科技增长 1 个月滚动持有混合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银科技增长 1 个月滚动持有混合基金不能持续经营。(5)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。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。	
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	黄小熠	欧梦澈
会计师事务所的地址	上海市南京西路 1266 号恒隆广场 2 期 16 楼	
审计报告日期	2022-03-30	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：兴银科技增长1个月滚动持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	2,037,676.09
结算备付金		9,763,203.98
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	194,578,987.62
其中：股票投资		194,578,987.62
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	1,621.55
应收股利		-
应收申购款		197,342.55
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		206,578,831.79
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日
负债：		
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		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		48,379.18
应付管理人报酬		274,929.49
应付托管费		36,657.27
应付销售服务费		9,817.18
应付交易费用	7.4.7.7	-

应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	191,060.76
负债合计		560,843.88
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	171,746,701.63
未分配利润	7.4.7.10	34,271,286.28
所有者权益合计		206,017,987.91
负债和所有者权益总计		206,578,831.79

注：报告截止日2021年12月31日，兴银科技增长1个月滚动持有混合A基金份额净值1.2001元，基金份额总额152,970,677.93份；兴银科技增长1个月滚动持有混合C基金份额净值1.1948元，基金份额总额18,776,023.70份。兴银科技增长1个月滚动持有混合份额总额合计为171,746,701.63份。

7.2 利润表

会计主体：兴银科技增长1个月滚动持有期混合型证券投资基金

本报告期：2021年02月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2021年02月18日 (基金合同生效日)至 2021年12月31日
一、收入		219,828,352.28
1. 利息收入		906,695.51
其中：存款利息收入	7.4.7.11	373,000.19
债券利息收入		232.82
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		533,462.50
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		211,239,866.94
其中：股票投资收益	7.4.7.12	207,441,935.89
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	268,211.43
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	3,529,719.62
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	5,631,131.49
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. 18	2, 050, 658. 34
减：二、费用		21, 014, 881. 04
1. 管理人报酬	7. 4. 10. 2. 1	7, 323, 535. 28
2. 托管费	7. 4. 10. 2. 2	976, 471. 38
3. 销售服务费	7. 4. 10. 2. 3	308, 530. 55
4. 交易费用	7. 4. 7. 19	12, 214, 843. 70
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		0. 13
7. 其他费用	7. 4. 7. 20	191, 500. 00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		198, 813, 471. 24
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		198, 813, 471. 24

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴银科技增长1个月滚动持有期混合型证券投资基金

本报告期：2021年02月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2021 年 02 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	955, 953, 284. 26	-	955, 953, 284. 26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	198, 813, 471. 24	198, 813, 471. 24
三、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）	-784, 206, 582. 63	-164, 542, 184. 96	-948, 748, 767. 59
其中：1. 基金申购款	36, 929, 197. 57	9, 922, 955. 07	46, 852, 152. 64
2. 基金赎回款	-821, 135, 780. 20	-174, 465, 140. 03	-995, 600, 920. 23
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	171, 746, 701. 63	34, 271, 286. 28	206, 017, 987. 91

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：

张贵云

刘钊

崔可

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

兴银科技增长1个月滚动持有期混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监许可（2020）1846号注册募集。《兴银科技增长1个月滚动持有期混合型证券投资基金基金合同》于2021年2月18日生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集规模为955,953,284.26份基金份额。本基金的基金管理人为兴银基金管理有限责任公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《兴银科技增长1个月滚动持有期混合型证券投资基金基金合同》和《兴银科技增长1个月滚动持有期混合型证券投资基金招募说明书(更新)》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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（包括国债、金融债、公司债、企业债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货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相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金对股票的投资比例占基金资产的60%-95%其中投资于科技增长主题上市公司发行的证券占非现金资产的比例不低于80%每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中国战略新兴产业成份指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注7.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金2021年12月31日的财务状况、自2021年2月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为自2021年2月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：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、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现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。

本基金持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

-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以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

-应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

-除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

-收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

-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；

-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。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

-所转移金融资产的账面价值；

-因转移而收到的对价；

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据《企业会计准则》的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允

价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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。采用估值技术确定公允价值时，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。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，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

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

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。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额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。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实

际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费、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逐日确认。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如无需在受益期内预提或分摊，则于发生时直接计入基金损益；如需采用预提或待摊的方法，预提或待摊时计入基金损益。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。A类基金份额和C类基金份额之间由于收取费用的不同，将导致在可供分配利润上有所不同；同一类别每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，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《中国证券监督管理委员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。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、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，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限票，根据中基协发[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》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》(以下简称“估值处理标准”)，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

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

本基金本报告期内无需说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

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[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《财政部、国家税务总局、证监会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》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》(财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号)、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局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号文《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号文《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》及其他相关税务法规和实务操作,本基金适用的主要税项列示如下:

(a)对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,暂不征收企业所得税。

(b)自2016年5月1日起,在全国范围内全面推开营业税改征增值税(以下称营改增)试点,建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人,纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018年1月1日(含)以后,资管产品管理人(以下称管理人)运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,以管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日以前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税;对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税;同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价,暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d)对基金从上市公司取得的股息、红利所得,由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起,对所取得的股息红利收入根据持股期限

差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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%计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴20%的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，其股息红利所得暂减按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。

(e) 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。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在2018年1月1日(含)以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	2,037,676.09
定期存款	-
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	-
合计	2,037,676.09

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	188,947,856.13	194,578,987.62	5,631,131.49
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	188,947,856.13	194,578,987.62	5,631,131.49

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末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**

注：本基金本报告期末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

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	261.01
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,360.54
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	1,621.55

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

注：本基金本报告期末无应付交易费用。

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	60.76
应付证券出借违约金	-
预提费用-审计费	41,000.00
预提费用-信息披露费	150,000.00
合计	191,060.76

7.4.7.9 实收基金

兴银科技增长1个月滚动持有混合A

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 02 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	816,687,900.16	816,687,900.16
本期申购	27,956,249.61	27,956,249.61
本期赎回（以“-”号填列）	-691,673,471.84	-691,673,471.84
本期末	152,970,677.93	152,970,677.93

兴银科技增长1个月滚动持有混合C

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 02 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	139,265,384.10	139,265,384.10
本期申购	8,972,947.96	8,972,947.96
本期赎回（以“-”号填列）	-129,462,308.36	-129,462,308.36
本期末	18,776,023.70	18,776,023.70

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

兴银科技增长1个月滚动持有混合A

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	174,467,210.45	2,424,410.61	176,891,621.06
本期基金份额交易产生的变动数	-76,842,514.06	-69,434,836.87	-146,277,350.93
其中：基金申购款	10,001,872.90	-2,889,745.73	7,112,127.17
基金赎回款	-86,844,386.96	-66,545,091.14	-153,389,478.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	97,624,696.39	-67,010,426.26	30,614,270.13

兴银科技增长1个月滚动持有混合C

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	18,715,129.30	3,206,720.88	21,921,850.18
本期基金份额交易产生的变动数	-6,856,037.02	-11,408,797.01	-18,264,834.03
其中：基金申购款	4,161,979.79	-1,351,151.89	2,810,827.90
基金赎回款	-11,018,016.81	-10,057,645.12	-21,075,661.93

本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,859,092.28	-8,202,076.13	3,657,016.15

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 02 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	23,842.90
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	349,157.29
其他	-
合计	373,000.19

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 02 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	4,664,030,402.93
减：卖出股票成本总额	4,456,588,467.04
买卖股票差价收入	207,441,935.89

7.4.7.12.2 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期无证券出借差价收入。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 02 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	268,211.43
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	268,211.43

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 02 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
----	--

卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,967,245.44
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,698,800.00
减：应收利息总额	234.01
买卖债券差价收入	268,211.43

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 02 月 18 日（基金合同生效日） 至 2021 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	3,529,719.62
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	3,529,719.62

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 02 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	5,631,131.49
——股票投资	5,631,131.49
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——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	5,631,131.49

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 02 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	2,050,658.34
合计	2,050,658.34

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 02 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	12,214,843.70
银行间市场交易费用	-
合计	12,214,843.70

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 02 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
审计费用	41,000.00
信息披露费	150,000.00
证券出借违约金	-
账户开户费	400.00
银行汇划费	100.00

合计	191,500.00
----	------------

7.4.7.21 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

7.4.9.1 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

本报告期末不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。

7.4.9.2 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
国脉科技股份有限公司	基金管理人的股东
华福证券有限责任公司(以下简称“华福证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
上海兴瀚资产管理有限公司(以下简称“上海兴瀚”)	基金管理人的全资子公司
兴银基金管理有限责任公司(以下简称“兴银基金”)	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司(以下简称“兴业银行”)	基金托管人、基金销售机构

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金合同生效日为 2021 年 2 月 18 日，以下仅为本基金本报告期数据，无上年度可比期间数据。

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 2021 年 02 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华福证券	9,301,780,107.16	100.00%

7.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 02 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
华福证券	1,967,245.44	100.00%

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 02 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
华福证券	9,711,600,000.00	100.00%

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 2021 年 02 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 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
华福证券	7,540,273.68	100.00%	0.00	0.00%

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 2021 年 02 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	7,323,535.28
其中：支付销售机构的客户维护费	3,676,088.13

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 02 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	976,471.38

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

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 2021 年 02 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴银科技增长 1 个月滚动持有混合 A	兴银科技增长 1 个月滚动持有混合 C	合计
兴业银行	-	109,183.44	109,183.44
兴银直销	-	241.33	241.33
华福证券	-	192,795.94	192,795.94
合计	-	302,220.71	302,220.71

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.5%，销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

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

注：本基金本报告期内与关联方未进行银行间同业市场债券（含回购）的交易。

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

注：本基金在本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

注：本基金在本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

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

注：报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

注：报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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 2021 年 02 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	2,037,676.09	23,842.90

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无其他需要说明的关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2021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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001234	泰慕士	2021年12月31日	2022年01月11日	新股流通受限	16.53	16.53	333.00	5,504.49	5,504.49	-
300774	倍杰特	2021年07月26日	2022年02月07日	创业板新股锁定	4.57	21.08	444.00	2,029.08	9,359.52	-
300814	中富电路	2021年08月04日	2022年02月14日	创业板新股锁定	8.40	23.88	328.00	2,755.20	7,832.64	-
300854	中兰环保	2021年09月08日	2022年03月16日	创业板新股锁定	9.96	27.29	203.00	2,021.88	5,539.87	-
301017	漱玉平民	2021年06月23日	2022年01月05日	创业板新股锁定	8.86	23.80	555.00	4,917.30	13,209.00	-

301020	密封科技	2021年06月28日	2022年01月06日	创业板新股锁定	10.64	30.44	421.00	4,479.44	12,815.24	-
301021	英诺激光	2021年06月28日	2022年01月06日	创业板新股锁定	9.46	41.43	290.00	2,743.40	12,014.70	-
301025	读客文化	2021年07月06日	2022年01月19日	创业板新股锁定	1.55	20.88	403.00	624.65	8,414.64	-
301026	浩通科技	2021年07月08日	2022年01月17日	创业板新股锁定	18.03	62.73	203.00	3,660.09	12,734.19	-
301027	华蓝集团	2021年07月08日	2022年01月17日	创业板新股锁定	11.45	16.65	286.00	3,274.70	4,761.90	-
301028	东亚机械	2021年07月12日	2022年01月20日	创业板新股锁定	5.31	13.50	733.00	3,892.23	9,895.50	-
301030	仕净科技	2021年07月15日	2022年01月24日	创业板新股锁定	6.10	31.52	242.00	1,476.20	7,627.84	-
301032	新柴股份	2021年07月15日	2022年01月24日	创业板新股锁定	4.97	12.51	513.00	2,549.61	6,417.63	-
301033	迈普医学	2021年07月15日	2022年01月26日	创业板新股锁定	15.14	59.97	108.00	1,635.12	6,476.76	-
301035	润丰股份	2021年07月21日	2022年01月28日	创业板新股锁定	22.04	56.28	644.00	14,193.76	36,244.32	-
301036	双乐股份	2021年07月21日	2022年02月07日	创业板新股锁定	23.38	29.93	205.00	4,792.90	6,135.65	-

301037	保立佳	2021年07月21日	2022年02月07日	创业板新股锁定	14.82	24.26	193.00	2,860.26	4,682.18	-
301038	深水规院	2021年07月22日	2022年02月07日	创业板新股锁定	6.68	20.23	266.00	1,776.88	5,381.18	-
301041	金百泽	2021年08月02日	2022年02月11日	创业板新股锁定	7.31	28.21	215.00	1,571.65	6,065.15	-
301046	能辉科技	2021年08月10日	2022年02月17日	创业板新股锁定	8.34	48.99	290.00	2,418.60	14,207.10	-
301048	金鹰重工	2021年08月11日	2022年02月18日	创业板新股锁定	4.13	12.96	843.00	3,481.59	10,925.28	-
301049	超越科技	2021年08月17日	2022年02月24日	创业板新股锁定	19.34	32.92	196.00	3,790.64	6,452.32	-
301053	远信工业	2021年08月25日	2022年03月01日	创业板新股锁定	11.87	28.78	155.00	1,839.85	4,460.90	-
301055	张小泉	2021年08月26日	2022年03月07日	创业板新股锁定	6.90	21.78	355.00	2,449.50	7,731.90	-
301056	森赫股份	2021年08月27日	2022年03月07日	创业板新股锁定	3.93	11.09	572.00	2,247.96	6,343.48	-
301057	汇隆新材	2021年08月31日	2022年03月09日	创业板新股锁定	8.03	19.02	218.00	1,750.54	4,146.36	-
301059	金三江	2021年09月03日	2022年03月14日	创业板新股锁定	8.09	19.30	259.00	2,095.31	4,998.70	-

301060	兰卫医学	2021年09月06日	2022年03月14日	创业板新股锁定	4.17	30.94	587.00	2,447.79	18,161.78	-
301062	上海艾录	2021年09月07日	2022年03月14日	创业板新股锁定	3.31	17.01	523.00	1,731.13	8,896.23	-
301063	海锅股份	2021年09月09日	2022年03月24日	创业板新股锁定	17.40	36.11	153.00	2,662.20	5,524.83	-
301068	大地海洋	2021年09月16日	2022年03月28日	创业板新股锁定	13.98	28.38	144.00	2,013.12	4,086.72	-
301069	凯盛新材	2021年09月16日	2022年03月28日	创业板新股锁定	5.17	44.21	539.00	2,786.63	23,829.19	-
301073	君亭酒店	2021年09月22日	2022年03月30日	创业板新股锁定	12.24	32.00	144.00	1,762.56	4,608.00	-
301078	孩子王	2021年09月30日	2022年04月14日	创业板新股锁定	5.77	12.14	756.00	4,362.12	9,177.84	-
301079	邵阳液压	2021年10月11日	2022年04月19日	创业板新股锁定	11.92	24.82	140.00	1,668.80	3,474.80	-
301082	久盛电气	2021年10月14日	2022年04月27日	创业板新股锁定	15.48	21.53	701.00	10,851.48	15,092.53	-
301087	可孚医疗	2021年10月15日	2022年04月25日	创业板新股锁定	93.09	75.34	137.00	12,753.33	10,321.58	-
301088	戎美股份	2021年10月19日	2022年04月28日	创业板新股锁定	33.16	24.67	247.00	8,190.52	6,093.49	-

301089	拓新药业	2021年10月20日	2022年04月27日	创业板新股锁定	19.11	67.93	135.00	2,579.85	9,170.55	-
301090	华润材料	2021年10月19日	2022年04月26日	创业板新股锁定	10.45	11.22	656.00	6,855.20	7,360.32	-
301091	深城交	2021年10月20日	2022年04月29日	创业板新股锁定	36.50	31.31	210.00	7,665.00	6,575.10	-
301092	争光股份	2021年10月21日	2022年05月05日	创业板新股锁定	36.31	35.52	118.00	4,284.58	4,191.36	-
301093	华兰股份	2021年10月21日	2022年05月05日	创业板新股锁定	58.08	49.85	143.00	8,305.44	7,128.55	-
301100	风光股份	2021年12月10日	2022年06月17日	创业板新股锁定	27.81	31.14	240.00	6,674.40	7,473.60	-
301101	明月镜片	2021年12月09日	2022年06月16日	创业板新股锁定	26.91	43.36	245.00	6,592.95	10,623.20	-
301111	粤万年青	2021年11月30日	2022年06月07日	创业板新股锁定	10.48	36.68	379.00	3,971.92	13,901.72	-
301126	达嘉维康	2021年11月30日	2022年06月07日	创业板新股锁定	12.37	19.23	518.00	6,407.66	9,961.14	-
301133	金钟股份	2021年11月19日	2022年05月26日	创业板新股锁定	14.33	26.95	286.00	4,098.38	7,707.70	-
301136	招标股份	2021年12月31日	2022年01月11日	新股流通受限	10.52	10.52	1,585.00	16,674.20	16,674.20	-

301138	华研精机	2021年12月08日	2022年06月15日	创业板新股锁定	26.17	44.86	222.00	5,809.74	9,958.92	-
301149	隆华新材	2021年11月03日	2022年05月10日	创业板新股锁定	10.07	16.76	546.00	5,498.22	9,150.96	-
301179	泽宇智能	2021年12月01日	2022年06月08日	创业板新股锁定	43.99	50.77	110.00	4,838.90	5,584.70	-
301182	凯旺科技	2021年12月16日	2022年06月23日	创业板新股锁定	27.12	30.58	242.00	6,563.04	7,400.36	-
301190	善水科技	2021年12月17日	2022年06月24日	创业板新股锁定	27.85	27.46	223.00	6,210.55	6,123.58	-
301199	迈赫股份	2021年11月30日	2022年06月07日	创业板新股锁定	29.28	32.00	183.00	5,358.24	5,856.00	-
301211	亨迪药业	2021年12月14日	2022年06月22日	创业板新股锁定	25.80	33.65	363.00	9,365.40	12,214.95	-
301221	光庭信息	2021年12月15日	2022年06月22日	创业板新股锁定	69.89	88.72	112.00	7,827.68	9,936.64	-
688262	国芯科技	2021年12月28日	2022年01月06日	新股流通受限	41.98	41.98	1,722.00	72,289.56	72,289.56	-
688280	精进电动	2021年10月19日	2022年04月27日	科创板新股锁定	13.78	13.63	7,795.00	107,415.10	106,245.85	-
688305	科德数控	2021年07月02日	2022年01月10日	科创板新股锁定	11.03	105.68	1,496.00	16,500.88	158,097.28	-

688385	复旦微电	2021年07月27日	2022年02月07日	科创板新股锁定	6.23	48.58	8,986.00	55,982.78	436,539.88	-
688728	格科微	2021年08月11日	2022年02月18日	科创板新股锁定	14.38	29.31	6,526.00	93,843.88	191,277.06	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

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

注：本基金本报告期末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

本基金本报告期末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

注：于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

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

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了董事会（下设“合规及风险管理委员会”）、经营管理层（下设“风险控制委员会”）、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

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同责任，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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市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管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金于本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末未持有需按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末未持有需按短期信用评级列示的同业存单。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金于本报告期末未持有按长期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末未持有需按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末未持有需按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短期内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

7.4.13.3.2 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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基

金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

本基金所持大部分证券为依法上市的股票、债券等资产，本报告期末本基金持有的资产均能及时变现。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资产的公允价值。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持有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现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金经营活动的现金流量与市场利率变化有一定的相关性，因此利率风险在一定程度上存在。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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年12 月31日	1个月 以内	1-3 个月	3个月 -1年	1-5年	5年以 上	不计息	合计
资产							
银行存款	2,037,676.09	-	-	-	-	-	2,037,676.09
存出保证金	9,763,203.98	-	-	-	-	-	9,763,203.98
交易性金融资产	-	-	-	-	-	194,578,987.62	194,578,987.62
应收利息	-	-	-	-	-	1,621.55	1,621.55
应收申购款	-	-	-	-	-	197,342.55	197,342.55
资产总计	11,800,880.07	-	-	-	-	194,777,951.72	206,578,831.79
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	48,379.18	48,379.18
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	274,929.49	274,929.49
应付托管费	-	-	-	-	-	36,657.27	36,657.27
应付销售服	-	-	-	-	-	9,817.	9,817.

务费						18	18
其他负债	-	-	-	-	-	191,060.76	191,060.76
负债总计	-	-	-	-	-	560,843.88	560,843.88
利率敏感度缺口	11,800,880.07	-	-	-	-	194,217,107.84	206,017,987.91

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除利率之外的其他市场变量保持不变； 该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券与可交换债券。	
	分析	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 2021 年 12 月 31 日
	相关风险变量的变动	
	市场利率上升 25 个基点	-
	市场利率下降 25 个基点	-

注：于 12 月 31 日，本基金未持有对利率敏感的金融资产与金融负债。因此，市场利率的变动对本基金资产的净值无重大影响。

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场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证券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

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 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	194,578,987.62	94.45
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-

合计	194,578,987.62	94.45
----	----------------	-------

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除下述市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。	
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 2021 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上涨 5%	7,098,906.39
	沪深 300 指数下跌 5%	-7,098,906.39

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

于 2021 年 12 月 31 日，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工具中属于第一层次的余额为人民币 193,097,899.01 元，第二层次的余额为人民币 1,481,088.61 元，无属于第三层次的余额。

(a) 第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，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时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑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，确定相关证券公允价值的层次。

(b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

§ 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	194,578,987.62	94.19
	其中：股票	194,578,987.62	94.19
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	11,800,880.07	5.71
8	其他各项资产	198,964.10	0.10
9	合计	206,578,831.79	100.00

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	2,914,478.00	1.41
B	采矿业	-	-
C	制造业	157,818,691.78	76.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,681,161.00	3.73
E	建筑业	3,922,200.00	1.90
F	批发和零售业	38,441.47	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	3,046,028.00	1.48
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,767,095.90	3.28
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,172,861.00	1.54
M	科学研究和技术服务业	9,165,494.34	4.45
N	水利、环境和公共设施管理业	21,351.71	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,161.78	0.01
R	文化、体育和娱乐业	8,414.64	0.00
S	综合	-	-
	合计	194,578,987.62	94.45

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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	占基金资产净值比例（%）
1	600765	中航重机	183,600	9,269,964.00	4.50
2	002371	北方华创	24,200	8,397,884.	4.08

				00	
3	002415	海康威视	119,000	6,226,080.00	3.02
4	002013	中航机电	283,300	5,150,394.00	2.50
5	600875	东方电气	239,000	5,119,380.00	2.48
6	300034	钢研高纳	87,500	5,040,000.00	2.45
7	300480	光力科技	145,300	4,986,696.00	2.42
8	000338	潍柴动力	278,400	4,980,576.00	2.42
9	600989	宝丰能源	284,600	4,940,656.00	2.40
10	002534	杭锅股份	155,500	4,927,795.00	2.39
11	300065	海兰信	318,800	4,864,888.00	2.36
12	000423	东阿阿胶	99,500	4,850,625.00	2.35
13	600690	海尔智家	150,600	4,501,434.00	2.18
14	601677	明泰铝业	100,482	4,430,251.38	2.15
15	300395	菲利华	63,000	4,141,620.00	2.01
16	000723	美锦能源	252,900	4,104,567.00	1.99
17	688179	阿拉丁	51,453	4,045,234.86	1.96
18	300452	山河药辅	181,000	3,963,900.00	1.92
19	600170	上海建工	1,089,500	3,922,200.00	1.90
20	002837	英维克	95,247	3,894,649.83	1.89
21	300799	左江科技	40,350	3,792,900.00	1.84
22	600436	片仔癀	8,600	3,759,490.00	1.82
23	605090	九丰能源	102,600	3,608,442.00	1.75

24	300705	九典制药	96,700	3,398,038.00	1.65
25	300358	楚天科技	128,400	3,347,388.00	1.62
26	002273	水晶光电	190,600	3,314,534.00	1.61
27	300775	三角防务	66,100	3,231,629.00	1.57
28	688122	西部超导	33,251	3,223,351.94	1.56
29	300058	蓝色光标	295,700	3,172,861.00	1.54
30	300327	中颖电子	46,500	3,157,350.00	1.53
31	000811	冰轮环境	203,500	3,131,865.00	1.52
32	002171	楚江新材	235,500	3,122,730.00	1.52
33	300274	阳光电源	21,300	3,105,540.00	1.51
34	603713	密尔克卫	22,600	3,046,028.00	1.48
35	300373	扬杰科技	45,100	3,029,818.00	1.47
36	601890	亚星锚链	326,000	3,028,540.00	1.47
37	300474	景嘉微	19,800	3,013,560.00	1.46
38	300081	恒信东方	163,500	3,006,765.00	1.46
39	600172	黄河旋风	295,600	3,003,296.00	1.46
40	300790	宇瞳光学	65,400	2,954,772.00	1.43
41	000998	隆平高科	125,300	2,914,478.00	1.41
42	600131	国网信通	132,100	2,886,385.00	1.40
43	002026	山东威达	153,700	2,829,617.00	1.37
44	300499	高澜股份	135,700	2,141,346.00	1.04
45	300384	三联虹普	85,900	2,065,895.00	1.00

46	300709	精研科技	34,400	2,062,280.00	1.00
47	601016	节能风电	314,900	2,049,999.00	1.00
48	000591	太阳能	180,600	2,022,720.00	0.98
49	605007	五洲特纸	87,300	2,008,773.00	0.98
50	300228	富瑞特装	207,500	2,006,525.00	0.97
51	300014	亿纬锂能	16,600	1,961,788.00	0.95
52	300750	宁德时代	3,300	1,940,400.00	0.94
53	688385	复旦微电	8,986	436,539.88	0.21
54	688728	格科微	6,526	191,277.06	0.09
55	688305	科德数控	1,496	158,097.28	0.08
56	688280	精进电动	7,795	106,245.85	0.05
57	688262	国芯科技	1,722	72,289.56	0.04
58	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.02
59	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.01
60	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.01
61	301136	C招标	1,585	16,674.20	0.01
62	301082	久盛电气	701	15,092.53	0.01
63	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.01
64	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.01
65	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.01
66	301020	密封科技	421	12,815.24	0.01
67	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.01
68	301211	亨迪药业	363	12,214.95	0.01
69	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.01
70	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.01
71	301101	明月镜片	245	10,623.20	0.01
72	301087	可孚医疗	137	10,321.58	0.01
73	301126	达嘉维康	518	9,961.14	0.00
74	301138	华研精机	222	9,958.92	0.00
75	301221	光庭信息	112	9,936.64	0.00
76	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
77	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
78	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
79	301089	拓新药业	135	9,170.55	0.00
80	301149	隆华新材	546	9,150.96	0.00
81	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00

82	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
83	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
84	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
85	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
86	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
87	301100	风光股份	240	7,473.60	0.00
88	301182	凯旺科技	242	7,400.36	0.00
89	301090	华润材料	656	7,360.32	0.00
90	301093	华兰股份	143	7,128.55	0.00
91	301091	深城交	210	6,575.10	0.00
92	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
93	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
94	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
95	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
96	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
97	301190	善水科技	223	6,123.58	0.00
98	301088	戎美股份	247	6,093.49	0.00
99	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
100	301199	迈赫股份	183	5,856.00	0.00
101	301179	泽宇智能	110	5,584.70	0.00
102	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
103	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
104	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
105	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
106	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
107	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
108	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
109	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
110	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
111	301092	争光股份	118	4,191.36	0.00
112	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
113	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
114	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000625	长安汽车	68,286,717.91	33.15
2	600196	复星医药	58,896,599.77	28.59
3	300750	宁德时代	54,831,530.60	26.61
4	600111	北方稀土	52,807,801.20	25.63

5	002371	北方华创	50,942,707.30	24.73
6	300671	富满微	42,580,429.55	20.67
7	300274	阳光电源	40,313,283.44	19.57
8	300347	泰格医药	40,262,370.76	19.54
9	600905	三峡能源	40,021,717.00	19.43
10	688699	明微电子	38,712,930.14	18.79
11	600760	中航沈飞	38,091,184.72	18.49
12	300059	东方财富	36,584,433.68	17.76
13	300390	天华超净	36,447,097.99	17.69
14	600893	航发动力	36,057,506.72	17.50
15	002876	三利谱	35,401,258.86	17.18
16	601899	紫金矿业	35,328,560.89	17.15
17	600926	杭州银行	34,200,776.97	16.60
18	300458	全志科技	32,954,024.00	16.00
19	600460	士兰微	32,597,572.43	15.82
20	300014	亿纬锂能	31,580,967.42	15.33
21	300677	英科医疗	31,444,476.00	15.26
22	000301	东方盛虹	31,236,612.71	15.16
23	688122	西部超导	29,866,558.44	14.50
24	603026	石大胜华	29,661,661.60	14.40
25	300674	宇信科技	29,620,594.00	14.38
26	601016	节能风电	29,097,375.00	14.12
27	600703	三安光电	28,622,784.65	13.89
28	300253	卫宁健康	28,459,414.83	13.81
29	600031	三一重工	27,750,296.53	13.47
30	600436	片仔癀	27,388,311.17	13.29
31	600438	通威股份	27,263,475.00	13.23
32	605111	新洁能	26,880,706.50	13.05
33	600036	招商银行	26,821,621.00	13.02
34	601111	中国国航	26,612,564.74	12.92
35	002594	比亚迪	26,432,079.50	12.83
36	600875	东方电气	26,246,613.00	12.74
37	601601	中国太保	25,902,135.00	12.57
38	000932	华菱钢铁	25,717,677.00	12.48
39	000928	中钢国际	25,348,121.96	12.30
40	300760	迈瑞医疗	25,278,566.00	12.27
41	300142	沃森生物	25,014,150.00	12.14
42	000799	酒鬼酒	24,961,094.00	12.12
43	600188	兖矿能源	24,397,888.14	11.84
44	601598	中国外运	24,251,284.30	11.77
45	601995	中金公司	24,189,794.72	11.74
46	000636	风华高科	24,060,155.01	11.68
47	300775	三角防务	23,558,773.80	11.44

48	688499	利元亨	23,045,283.74	11.19
49	601666	平煤股份	22,500,844.81	10.92
50	002714	牧原股份	22,497,873.10	10.92
51	300343	联创股份	22,389,588.57	10.87
52	002152	广电运通	21,951,160.07	10.65
53	600711	盛屯矿业	21,780,137.05	10.57
54	688200	华峰测控	21,603,048.48	10.49
55	603260	合盛硅业	21,581,388.55	10.48
56	600059	古越龙山	21,554,940.75	10.46
57	002192	融捷股份	21,252,162.00	10.32
58	600765	中航重机	20,412,406.00	9.91
59	601898	中煤能源	20,379,023.81	9.89
60	002466	天齐锂业	20,193,499.90	9.80
61	002460	赣锋锂业	19,940,746.20	9.68
62	601168	西部矿业	19,434,852.10	9.43
63	300454	深信服	19,425,389.20	9.43
64	688626	翔宇医疗	19,105,257.70	9.27
65	605358	立昂微	19,052,858.00	9.25
66	002415	海康威视	19,017,781.00	9.23
67	600771	广誉远	18,991,100.66	9.22
68	300712	永福股份	18,649,362.90	9.05
69	300790	宇瞳光学	18,544,452.30	9.00
70	002645	华宏科技	18,229,014.00	8.85
71	601658	邮储银行	18,059,517.85	8.77
72	000725	京东方 A	17,993,342.00	8.73
73	688516	奥特维	17,872,815.14	8.68
74	000723	美锦能源	17,867,700.82	8.67
75	300474	景嘉微	17,832,295.00	8.66
76	688037	芯源微	17,808,465.50	8.64
77	300327	中颖电子	17,701,021.92	8.59
78	000739	普洛药业	17,412,680.00	8.45
79	688116	天奈科技	17,313,974.30	8.40
80	600570	恒生电子	17,260,419.70	8.38
81	688111	金山办公	17,180,230.72	8.34
82	002340	格林美	16,986,192.00	8.25
83	000538	云南白药	16,958,885.30	8.23
84	601615	明阳智能	16,815,456.88	8.16
85	002756	永兴材料	16,779,127.00	8.14
86	600702	舍得酒业	16,716,483.00	8.11
87	600309	万华化学	16,688,087.59	8.10
88	000516	国际医学	16,650,650.00	8.08
89	003022	联泓新科	16,646,627.30	8.08
90	002821	凯莱英	16,592,477.50	8.05

91	600989	宝丰能源	16,500,834.00	8.01
92	688012	中微公司	16,046,802.64	7.79
93	300077	国民技术	15,956,395.00	7.75
94	300413	芒果超媒	15,514,756.40	7.53
95	603876	鼎胜新材	15,485,409.20	7.52
96	300395	菲利华	15,366,722.93	7.46
97	601021	春秋航空	15,213,358.00	7.38
98	002028	思源电气	15,116,706.60	7.34
99	300772	运达股份	14,843,841.00	7.21
100	688201	信安世纪	14,602,253.80	7.09
101	603396	金辰股份	14,448,989.00	7.01
102	603098	森特股份	14,404,069.50	6.99
103	601669	中国电建	14,325,291.91	6.95
104	002142	宁波银行	14,207,167.84	6.90
105	600176	中国巨石	14,020,230.00	6.81
106	600367	红星发展	13,990,697.00	6.79
107	000776	广发证券	13,726,470.00	6.66
108	601567	三星医疗	13,662,769.50	6.63
109	600509	天富能源	13,508,538.00	6.56
110	600019	宝钢股份	13,311,924.00	6.46
111	000027	深圳能源	13,305,244.71	6.46
112	600507	方大特钢	13,260,129.44	6.44
113	600172	黄河旋风	13,181,260.60	6.40
114	300316	晶盛机电	13,161,016.70	6.39
115	600399	抚顺特钢	13,146,451.50	6.38
116	603076	乐惠国际	13,144,066.00	6.38
117	000963	华东医药	13,102,607.00	6.36
118	300624	万兴科技	13,101,081.20	6.36
119	300296	利亚德	13,013,134.00	6.32
120	002222	福晶科技	12,959,452.50	6.29
121	000591	太阳能	12,927,583.66	6.27
122	300655	晶瑞电材	12,724,960.70	6.18
123	600089	特变电工	12,689,650.08	6.16
124	600109	国金证券	12,643,718.99	6.14
125	300896	爱美客	12,544,716.00	6.09
126	002487	大金重工	12,512,826.00	6.07
127	000650	仁和药业	12,429,678.98	6.03
128	002241	歌尔股份	12,373,951.29	6.01
129	003026	中晶科技	12,261,930.00	5.95
130	000889	中嘉博创	12,205,824.60	5.92
131	300821	东岳硅材	12,140,692.40	5.89
132	600958	东方证券	12,065,198.02	5.86
133	601155	新城控股	12,044,065.20	5.85

134	300087	荃银高科	12,020,972.50	5.83
135	601677	明泰铝业	11,807,954.42	5.73
136	601877	正泰电器	11,610,486.65	5.64
137	002125	湘潭电化	11,391,807.24	5.53
138	300034	钢研高纳	11,388,692.71	5.53
139	300502	新易盛	11,295,203.11	5.48
140	600490	鹏欣资源	11,288,283.20	5.48
141	300052	中青宝	11,171,377.80	5.42
142	002318	久立特材	11,166,339.00	5.42
143	601633	长城汽车	11,082,153.00	5.38
144	000069	华侨城A	11,033,892.18	5.36
145	600383	金地集团	10,993,124.00	5.34
146	002176	江特电机	10,684,908.00	5.19
147	601058	赛轮轮胎	10,535,992.00	5.11
148	000338	潍柴动力	10,412,747.96	5.05
149	600141	兴发集团	10,381,489.88	5.04
150	002837	英维克	9,973,108.26	4.84
151	600110	诺德股份	9,855,910.00	4.78
152	002297	博云新材	9,849,480.99	4.78
153	002895	川恒股份	9,815,787.00	4.76
154	600160	巨化股份	9,680,632.94	4.70
155	600096	云天化	9,672,821.00	4.70
156	002709	天赐材料	9,631,233.00	4.67
157	600362	江西铜业	9,621,200.99	4.67
158	300319	麦捷科技	9,598,271.00	4.66
159	300657	弘信电子	9,566,074.20	4.64
160	000425	徐工机械	9,558,454.00	4.64
161	000977	浪潮信息	9,546,481.56	4.63
162	601919	中远海控	9,537,656.30	4.63
163	601939	建设银行	9,533,146.60	4.63
164	000100	TCL 科技	9,525,612.00	4.62
165	600038	中直股份	9,465,165.62	4.59
166	002236	大华股份	9,305,586.00	4.52
167	601009	南京银行	9,283,597.00	4.51
168	600025	华能水电	9,283,037.70	4.51
169	002555	三七互娱	9,282,553.00	4.51
170	000063	中兴通讯	9,241,470.92	4.49
171	000651	格力电器	9,219,858.00	4.48
172	600029	南方航空	9,218,109.00	4.47
173	601006	大秦铁路	9,211,530.00	4.47
174	600170	上海建工	9,203,051.35	4.47
175	002368	太极股份	9,191,490.00	4.46
176	002602	世纪华通	9,164,194.00	4.45

177	601985	中国核电	9,079,696.00	4.41
178	002080	中材科技	9,076,682.35	4.41
179	603501	韦尔股份	8,977,919.00	4.36
180	300122	智飞生物	8,954,828.00	4.35
181	002484	江海股份	8,943,682.00	4.34
182	000550	江铃汽车	8,940,341.00	4.34
183	600027	华电国际	8,932,421.24	4.34
184	688700	东威科技	8,911,308.35	4.33
185	000400	许继电气	8,901,246.06	4.32
186	605020	永和股份	8,836,895.00	4.29
187	600862	中航高科	8,815,710.00	4.28
188	601098	中南传媒	8,804,211.00	4.27
189	603456	九洲药业	8,662,013.00	4.20
190	300850	新强联	8,641,220.40	4.19
191	603888	新华网	8,634,709.00	4.19
192	002139	拓邦股份	8,594,772.00	4.17
193	688383	新益昌	8,574,106.63	4.16
194	601699	潞安环能	8,524,851.00	4.14
195	600295	鄂尔多斯	8,520,587.00	4.14
196	600276	恒瑞医药	8,347,221.24	4.05
197	300460	惠伦晶体	8,273,342.00	4.02
198	603588	高能环境	8,027,780.58	3.90
199	601555	东吴证券	8,010,772.00	3.89
200	601865	福莱特	7,950,595.00	3.86
201	300228	富瑞特装	7,930,967.00	3.85
202	300598	诚迈科技	7,780,657.30	3.78
203	300398	飞凯材料	7,714,583.00	3.74
204	688368	晶丰明源	7,458,046.17	3.62
205	002850	科达利	7,371,123.00	3.58
206	002202	金风科技	7,325,156.42	3.56
207	300751	迈为股份	7,129,325.00	3.46
208	002407	多氟多	7,124,474.00	3.46
209	300432	富临精工	7,108,923.40	3.45
210	601100	恒立液压	7,096,905.72	3.44
211	300811	铂科新材	7,058,615.87	3.43
212	300480	光力科技	7,034,532.00	3.41
213	002651	利君股份	6,938,914.00	3.37
214	300498	温氏股份	6,930,593.40	3.36
215	600163	中闽能源	6,896,152.00	3.35
216	603650	彤程新材	6,846,637.65	3.32
217	600581	八一钢铁	6,724,844.00	3.26
218	688339	亿华通	6,695,762.04	3.25
219	002741	光华科技	6,648,729.88	3.23

220	300065	海兰信	6,560,089.00	3.18
221	601618	中国中冶	6,525,950.00	3.17
222	603259	药明康德	6,516,970.68	3.16
223	002335	科华数据	6,496,246.00	3.15
224	300802	矩子科技	6,478,030.00	3.14
225	603997	继峰股份	6,424,624.00	3.12
226	300633	开立医疗	6,423,044.00	3.12
227	002291	星期六	6,417,356.00	3.11
228	300437	清水源	6,371,314.72	3.09
229	000792	盐湖股份	6,335,109.50	3.08
230	600707	彩虹股份	6,249,485.00	3.03
231	601689	拓普集团	6,163,602.86	2.99
232	000733	振华科技	6,051,269.22	2.94
233	002610	爱康科技	6,034,032.00	2.93
234	600759	洲际油气	5,917,058.00	2.87
235	600010	包钢股份	5,848,918.00	2.84
236	601012	隆基股份	5,830,448.00	2.83
237	600166	福田汽车	5,818,853.97	2.82
238	601015	陕西黑猫	5,766,378.00	2.80
239	000807	云铝股份	5,747,611.97	2.79
240	300827	上能电气	5,728,448.00	2.78
241	603612	索通发展	5,698,376.00	2.77
242	300368	汇金股份	5,672,740.00	2.75
243	000423	东阿阿胶	5,659,463.00	2.75
244	002049	紫光国微	5,499,764.00	2.67
245	600116	三峡水利	5,450,870.00	2.65
246	603128	华贸物流	5,365,643.00	2.60
247	300806	斯迪克	5,344,472.20	2.59
248	601233	桐昆股份	5,326,633.00	2.59
249	300696	爱乐达	5,324,522.80	2.58
250	688586	江航装备	5,313,952.17	2.58
251	605499	东鹏饮料	5,295,590.64	2.57
252	300346	南大光电	5,293,181.00	2.57
253	600888	新疆众和	5,282,653.94	2.56
254	002315	焦点科技	5,265,924.00	2.56
255	000960	锡业股份	5,262,277.00	2.55
256	688002	睿创微纳	5,251,057.95	2.55
257	605388	均瑶健康	5,212,548.00	2.53
258	688186	广大特材	5,202,168.78	2.53
259	601727	上海电气	5,172,245.00	2.51
260	300501	海顺新材	5,147,535.98	2.50
261	300057	万顺新材	5,131,871.00	2.49
262	300855	图南股份	5,115,518.00	2.48

263	002013	中航机电	5,088,029.00	2.47
264	688233	神工股份	5,066,468.82	2.46
265	300054	鼎龙股份	5,049,377.20	2.45
266	003031	中瓷电子	5,043,628.80	2.45
267	000933	神火股份	5,034,976.00	2.44
268	600048	保利发展	4,969,379.00	2.41
269	000596	古井贡酒	4,950,488.00	2.40
270	000568	泸州老窖	4,944,362.00	2.40
271	002271	东方雨虹	4,924,852.00	2.39
272	002444	巨星科技	4,906,098.00	2.38
273	300499	高澜股份	4,818,328.00	2.34
274	600863	内蒙华电	4,789,743.82	2.32
275	002299	圣农发展	4,779,252.67	2.32
276	300383	光环新网	4,778,506.00	2.32
277	600497	驰宏锌锗	4,770,336.00	2.32
278	300659	中孚信息	4,752,603.45	2.31
279	000066	中国长城	4,736,657.57	2.30
280	000768	中航西飞	4,734,894.00	2.30
281	300726	宏达电子	4,730,613.00	2.30
282	002580	圣阳股份	4,708,943.48	2.29
283	600884	杉杉股份	4,693,781.00	2.28
284	002353	杰瑞股份	4,688,448.00	2.28
285	002979	雷赛智能	4,686,888.00	2.27
286	688696	极米科技	4,684,230.55	2.27
287	603060	国检集团	4,670,704.00	2.27
288	002534	杭锅股份	4,650,936.00	2.26
289	601888	中国中免	4,646,352.00	2.26
290	600754	锦江酒店	4,633,898.00	2.25
291	002739	万达电影	4,629,480.00	2.25
292	000690	宝新能源	4,616,260.00	2.24
293	000703	恒逸石化	4,609,804.00	2.24
294	300496	中科创达	4,606,922.00	2.24
295	600745	闻泰科技	4,604,350.00	2.23
296	603393	新天然气	4,603,531.65	2.23
297	300386	飞天诚信	4,603,320.00	2.23
298	600138	中青旅	4,601,175.00	2.23
299	300355	蒙草生态	4,599,405.00	2.23
300	600258	首旅酒店	4,598,674.00	2.23
301	300613	富瀚微	4,598,475.00	2.23
302	300604	长川科技	4,596,878.70	2.23
303	600004	白云机场	4,596,425.00	2.23
304	300373	扬杰科技	4,595,919.00	2.23
305	600690	海尔智家	4,594,773.00	2.23

306	688161	威高骨科	4,592,462.56	2.23
307	603906	龙蟠科技	4,572,747.00	2.22
308	300082	奥克股份	4,571,510.00	2.22
309	601208	东材科技	4,570,113.50	2.22
310	001208	华菱线缆	4,566,991.73	2.22
311	603290	斯达半导	4,542,348.00	2.20
312	000600	建投能源	4,538,449.00	2.20
313	688390	固德威	4,520,381.68	2.19
314	300835	龙磁科技	4,508,244.00	2.19
315	601611	中国核建	4,506,609.00	2.19
316	601600	中国铝业	4,504,410.00	2.19
317	002149	西部材料	4,504,381.00	2.19
318	603606	东方电缆	4,498,458.86	2.18
319	000681	视觉中国	4,470,542.00	2.17
320	600741	华域汽车	4,470,228.68	2.17
321	000612	焦作万方	4,468,077.00	2.17
322	600125	铁龙物流	4,466,747.00	2.17
323	601688	华泰证券	4,464,955.67	2.17
324	300207	欣旺达	4,464,652.00	2.17
325	300941	创识科技	4,464,312.00	2.17
326	300113	顺网科技	4,462,935.85	2.17
327	600596	新安股份	4,459,199.00	2.16
328	600217	中再资环	4,454,244.00	2.16
329	300280	紫天科技	4,453,797.00	2.16
330	300768	迪普科技	4,450,274.00	2.16
331	002812	恩捷股份	4,448,913.00	2.16
332	603378	亚士创能	4,448,516.00	2.16
333	603801	志邦家居	4,445,356.00	2.16
334	002922	伊戈尔	4,442,100.00	2.16
335	603987	康德莱	4,441,469.20	2.16
336	688202	美迪西	4,429,445.57	2.15
337	605090	九丰能源	4,422,064.30	2.15
338	002120	韵达股份	4,419,586.00	2.15
339	000034	神州数码	4,416,725.00	2.14
340	300770	新媒股份	4,410,315.00	2.14
341	002549	凯美特气	4,409,046.80	2.14
342	300505	川金诺	4,404,232.00	2.14
343	300487	蓝晓科技	4,283,862.00	2.08
344	600641	万业企业	4,232,032.96	2.05

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300671	富满微	107,967,727.18	52.41
2	688699	明微电子	88,979,622.55	43.19
3	000625	长安汽车	71,918,392.86	34.91
4	300750	宁德时代	68,084,363.20	33.05
5	600196	复星医药	57,810,507.88	28.06
6	002371	北方华创	56,792,874.86	27.57
7	600111	北方稀土	53,827,089.00	26.13
8	300458	全志科技	51,122,784.47	24.81
9	603026	石大胜华	46,909,689.35	22.77
10	300347	泰格医药	44,841,881.31	21.77
11	600905	三峡能源	40,951,271.00	19.88
12	300274	阳光电源	40,530,317.70	19.67
13	300014	亿纬锂能	39,693,160.36	19.27
14	600460	士兰微	39,442,963.36	19.15
15	603260	合盛硅业	38,628,461.55	18.75
16	300059	东方财富	38,539,432.74	18.71
17	002876	三利谱	38,119,140.62	18.50
18	600760	中航沈飞	37,409,420.64	18.16
19	600926	杭州银行	34,002,009.93	16.50
20	300343	联创股份	33,941,340.05	16.47
21	300390	天华超净	33,416,307.80	16.22
22	600893	航发动力	33,409,579.73	16.22
23	600703	三安光电	32,565,814.00	15.81
24	601899	紫金矿业	32,296,549.95	15.68
25	000301	东方盛虹	30,735,884.66	14.92
26	300142	沃森生物	29,324,912.00	14.23
27	600031	三一重工	27,718,254.90	13.45
28	601016	节能风电	27,426,426.00	13.31
29	688122	西部超导	27,398,736.04	13.30
30	300674	宇信科技	27,207,864.20	13.21
31	688499	利元亨	26,554,546.12	12.89
32	600036	招商银行	26,521,594.20	12.87
33	600436	片仔癀	26,490,218.90	12.86
34	300677	英科医疗	26,463,433.23	12.85
35	601111	中国国航	25,867,858.80	12.56
36	300760	迈瑞医疗	25,797,349.00	12.52
37	000928	中钢国际	25,742,978.59	12.50
38	688116	天奈科技	25,487,597.44	12.37
39	000799	酒鬼酒	25,464,392.00	12.36
40	000932	华菱钢铁	25,373,285.00	12.32

41	300712	永福股份	25,371,357.00	12.32
42	002594	比亚迪	25,205,855.00	12.23
43	601598	中国外运	25,189,548.46	12.23
44	300253	卫宁健康	24,848,937.78	12.06
45	600188	兖矿能源	24,228,471.79	11.76
46	605111	新洁能	24,151,442.60	11.72
47	000636	风华高科	23,695,420.60	11.50
48	601601	中国太保	23,506,955.76	11.41
49	601995	中金公司	23,308,054.51	11.31
50	688200	华峰测控	22,985,091.32	11.16
51	002645	华宏科技	22,706,051.68	11.02
52	002192	融捷股份	22,662,211.00	11.00
53	300655	晶瑞电材	22,557,600.57	10.95
54	300775	三角防务	22,557,371.00	10.95
55	601898	中煤能源	22,537,980.59	10.94
56	600438	通威股份	22,210,535.00	10.78
57	002756	永兴材料	22,034,075.00	10.70
58	600711	盛屯矿业	21,759,886.28	10.56
59	600771	广誉远	21,723,344.48	10.54
60	300790	宇瞳光学	21,362,309.32	10.37
61	002714	牧原股份	21,118,560.96	10.25
62	002152	广电运通	21,112,445.75	10.25
63	600702	舍得酒业	20,875,299.00	10.13
64	600875	东方电气	20,859,282.00	10.12
65	601666	平煤股份	20,594,108.86	10.00
66	002466	天齐锂业	20,198,017.00	9.80
67	000516	国际医学	19,370,204.66	9.40
68	600399	抚顺特钢	18,909,800.00	9.18
69	603396	金辰股份	18,851,416.00	9.15
70	002460	赣锋锂业	18,767,847.00	9.11
71	600059	古越龙山	18,754,966.00	9.10
72	688111	金山办公	18,344,369.04	8.90
73	300327	中颖电子	18,315,438.90	8.89
74	002340	格林美	18,234,441.48	8.85
75	688037	芯源微	18,199,529.80	8.83
76	601168	西部矿业	18,087,029.00	8.78
77	603098	森特股份	17,964,903.12	8.72
78	003022	联泓新科	17,638,785.70	8.56
79	600309	万华化学	17,390,584.46	8.44
80	605358	立昂微	17,269,616.77	8.38
81	300454	深信服	17,064,637.00	8.28
82	688516	奥特维	16,803,919.85	8.16
83	300772	运达股份	16,689,676.00	8.10

84	000725	京东方 A	16,514,937.00	8.02
85	688012	中微公司	16,505,771.17	8.01
86	002821	凯莱英	16,251,769.00	7.89
87	600570	恒生电子	16,094,672.00	7.81
88	000739	普洛药业	15,803,992.00	7.67
89	601669	中国电建	15,672,356.00	7.61
90	603876	鼎胜新材	15,621,789.00	7.58
91	601658	邮储银行	15,617,148.11	7.58
92	600765	中航重机	15,495,637.92	7.52
93	300474	景嘉微	15,489,476.00	7.52
94	600367	红星发展	15,391,217.32	7.47
95	601615	明阳智能	15,222,229.73	7.39
96	002028	思源电气	14,823,442.00	7.20
97	002142	宁波银行	14,681,536.08	7.13
98	300077	国民技术	14,553,533.00	7.06
99	601021	春秋航空	14,141,939.37	6.86
100	000538	云南白药	14,126,239.00	6.86
101	002487	大金重工	14,035,132.00	6.81
102	000776	广发证券	13,852,836.21	6.72
103	600019	宝钢股份	13,708,889.00	6.65
104	600109	国金证券	13,610,350.00	6.61
105	000650	仁和药业	13,551,241.00	6.58
106	603076	乐惠国际	13,320,468.60	6.47
107	300821	东岳硅材	13,165,980.12	6.39
108	600141	兴发集团	13,048,253.00	6.33
109	688201	信安世纪	12,936,385.09	6.28
110	002241	歌尔股份	12,890,708.04	6.26
111	300413	芒果超媒	12,879,664.00	6.25
112	600507	方大特钢	12,729,563.20	6.18
113	000723	美锦能源	12,718,571.00	6.17
114	300296	利亚德	12,686,756.00	6.16
115	600958	东方证券	12,686,524.52	6.16
116	688626	翔宇医疗	12,686,322.09	6.16
117	000069	华侨城 A	12,547,912.30	6.09
118	600509	天富能源	12,451,596.93	6.04
119	300624	万兴科技	12,176,635.32	5.91
120	000027	深圳能源	12,153,276.64	5.90
121	600176	中国巨石	12,141,967.33	5.89
122	300395	菲利华	12,085,774.00	5.87
123	300896	爱美客	12,023,292.00	5.84
124	601058	赛轮轮胎	11,969,611.46	5.81
125	003026	中晶科技	11,790,167.00	5.72
126	000963	华东医药	11,772,896.47	5.71

127	300087	荃银高科	11,611,802.00	5.64
128	600989	宝丰能源	11,610,505.00	5.64
129	002415	海康威视	11,279,940.00	5.48
130	601877	正泰电器	11,265,379.00	5.47
131	300052	中青宝	11,238,073.00	5.45
132	300316	晶盛机电	10,957,503.00	5.32
133	601567	三星医疗	10,876,050.00	5.28
134	002318	久立特材	10,805,666.90	5.25
135	600089	特变电工	10,795,251.00	5.24
136	601155	新城控股	10,762,309.00	5.22
137	002125	湘潭电化	10,736,009.09	5.21
138	300502	新易盛	10,701,437.29	5.19
139	601633	长城汽车	10,593,475.94	5.14
140	002222	福晶科技	10,414,478.00	5.06
141	002236	大华股份	10,360,666.00	5.03
142	600160	巨化股份	10,301,767.52	5.00
143	002080	中材科技	10,185,684.67	4.94
144	000889	中嘉博创	10,101,651.60	4.90
145	600383	金地集团	10,091,739.50	4.90
146	002176	江特电机	9,969,624.65	4.84
147	600096	云天化	9,947,111.00	4.83
148	002709	天赐材料	9,868,132.36	4.79
149	300850	新强联	9,851,477.20	4.78
150	002297	博云新材	9,786,570.00	4.75
151	300319	麦捷科技	9,771,916.08	4.74
152	000591	太阳能	9,591,818.31	4.66
153	600110	诺德股份	9,515,701.00	4.62
154	600362	江西铜业	9,481,661.00	4.60
155	601985	中国核电	9,478,899.00	4.60
156	600025	华能水电	9,446,051.71	4.59
157	601009	南京银行	9,352,170.00	4.54
158	601939	建设银行	9,346,704.00	4.54
159	000425	徐工机械	9,314,540.00	4.52
160	000100	TCL 科技	9,251,110.00	4.49
161	300122	智飞生物	9,194,456.00	4.46
162	300657	弘信电子	9,136,958.34	4.44
163	002895	川恒股份	9,136,077.00	4.43
164	002555	三七互娱	9,099,486.00	4.42
165	601006	大秦铁路	8,982,342.00	4.36
166	688700	东威科技	8,889,668.63	4.31
167	600172	黄河旋风	8,866,020.66	4.30
168	002602	世纪华通	8,819,919.60	4.28
169	000063	中兴通讯	8,787,709.35	4.27

170	002368	太极股份	8,733,026.14	4.24
171	300460	惠伦晶体	8,709,051.72	4.23
172	601677	明泰铝业	8,702,171.00	4.22
173	600862	中航高科	8,642,335.00	4.19
174	601098	中南传媒	8,631,531.72	4.19
175	600038	中直股份	8,580,991.04	4.17
176	002139	拓邦股份	8,577,655.00	4.16
177	600490	鹏欣资源	8,572,533.73	4.16
178	600027	华电国际	8,546,318.31	4.15
179	000651	格力电器	8,488,414.48	4.12
180	603501	韦尔股份	8,381,426.00	4.07
181	688383	新益昌	8,339,619.53	4.05
182	000400	许继电气	8,291,085.00	4.02
183	600276	恒瑞医药	8,242,699.00	4.00
184	603588	高能环境	8,193,645.55	3.98
185	600295	鄂尔多斯	8,127,028.87	3.94
186	000977	浪潮信息	8,111,297.48	3.94
187	605020	永和股份	8,102,593.70	3.93
188	600029	南方航空	8,084,077.00	3.92
189	002484	江海股份	8,058,241.00	3.91
190	603456	九洲药业	8,010,284.36	3.89
191	601699	潞安环能	7,979,577.00	3.87
192	600581	八一钢铁	7,806,016.00	3.79
193	002407	多氟多	7,672,265.00	3.72
194	002850	科达利	7,558,725.80	3.67
195	000550	江铃汽车	7,495,846.00	3.64
196	601555	东吴证券	7,492,411.00	3.64
197	601919	中远海控	7,487,236.00	3.63
198	300398	飞凯材料	7,356,813.94	3.57
199	603888	新华网	7,341,450.00	3.56
200	002291	星期六	7,284,368.00	3.54
201	002202	金风科技	6,959,473.00	3.38
202	000792	盐湖股份	6,941,696.00	3.37
203	601100	恒立液压	6,937,501.00	3.37
204	300432	富临精工	6,888,187.00	3.34
205	601689	拓普集团	6,809,129.00	3.31
206	601865	福莱特	6,775,503.94	3.29
207	002651	利君股份	6,737,880.00	3.27
208	300498	温氏股份	6,733,858.00	3.27
209	300751	迈为股份	6,563,227.46	3.19
210	300811	铂科新材	6,554,702.00	3.18
211	000807	云铝股份	6,480,607.00	3.15
212	002335	科华数据	6,470,810.00	3.14

213	300598	诚迈科技	6,447,171.00	3.13
214	603997	继峰股份	6,382,889.50	3.10
215	300034	钢研高纳	6,260,967.80	3.04
216	603259	药明康德	6,255,024.00	3.04
217	600166	福田汽车	6,202,091.00	3.01
218	002837	英维克	6,167,874.00	2.99
219	300855	图南股份	6,074,167.00	2.95
220	600163	中闽能源	6,053,928.00	2.94
221	688368	晶丰明源	6,009,458.57	2.92
222	600707	彩虹股份	5,994,017.00	2.91
223	300633	开立医疗	5,961,268.00	2.89
224	688339	亿华通	5,959,660.92	2.89
225	603650	彤程新材	5,721,177.41	2.78
226	601618	中国中冶	5,714,127.00	2.77
227	600010	包钢股份	5,712,563.00	2.77
228	002741	光华科技	5,519,990.58	2.68
229	600116	三峡水利	5,516,886.26	2.68
230	601015	陕西黑猫	5,511,495.00	2.68
231	002049	紫光国微	5,473,776.00	2.66
232	603606	东方电缆	5,448,093.00	2.64
233	603612	索通发展	5,426,762.00	2.63
234	000338	潍柴动力	5,416,743.37	2.63
235	300696	爱乐达	5,403,779.00	2.62
236	300659	中孚信息	5,386,538.20	2.61
237	600759	洲际油气	5,377,294.00	2.61
238	688586	江航装备	5,359,764.96	2.60
239	000733	振华科技	5,349,361.00	2.60
240	300228	富瑞特装	5,309,016.00	2.58
241	688002	睿创微纳	5,308,014.39	2.58
242	603060	国检集团	5,300,076.11	2.57
243	300054	鼎龙股份	5,271,583.00	2.56
244	000568	泸州老窖	5,270,762.00	2.56
245	300437	清水源	5,256,897.22	2.55
246	002444	巨星科技	5,205,038.00	2.53
247	688186	广大特材	5,159,137.84	2.50
248	605499	东鹏饮料	5,136,637.48	2.49
249	601727	上海电气	5,095,238.00	2.47
250	300802	矩子科技	5,070,876.00	2.46
251	000960	锡业股份	5,051,362.00	2.45
252	600754	锦江酒店	5,015,398.00	2.43
253	603290	斯达半导	4,973,287.00	2.41
254	003031	中瓷电子	4,955,478.60	2.41
255	002610	爱康科技	4,955,082.00	2.41

256	300827	上能电气	4,929,336.00	2.39
257	002315	焦点科技	4,921,655.00	2.39
258	688233	神工股份	4,905,012.56	2.38
259	601012	隆基股份	4,900,063.00	2.38
260	605388	均瑶健康	4,892,392.00	2.37
261	300346	南大光电	4,880,106.00	2.37
262	603906	龙蟠科技	4,846,648.00	2.35
263	600888	新疆众和	4,827,798.50	2.34
264	300368	汇金股份	4,812,422.00	2.34
265	601233	桐昆股份	4,807,835.00	2.33
266	000933	神火股份	4,807,693.00	2.33
267	603128	华贸物流	4,799,378.00	2.33
268	002149	西部材料	4,789,144.00	2.32
269	300501	海顺新材	4,786,026.00	2.32
270	300806	斯迪克	4,763,054.00	2.31
271	300835	龙磁科技	4,736,466.00	2.30
272	300604	长川科技	4,734,744.00	2.30
273	300496	中科创达	4,685,903.00	2.27
274	600258	首旅酒店	4,675,738.00	2.27
275	000690	宝新能源	4,654,393.00	2.26
276	600048	保利发展	4,652,071.00	2.26
277	000596	古井贡酒	4,650,397.00	2.26
278	601611	中国核建	4,648,006.83	2.26
279	002580	圣阳股份	4,636,009.00	2.25
280	600863	内蒙华电	4,586,879.32	2.23
281	002271	东方雨虹	4,584,503.50	2.23
282	601600	中国铝业	4,578,893.00	2.22
283	600170	上海建工	4,574,092.00	2.22
284	688390	固德威	4,564,755.67	2.22
285	600596	新安股份	4,558,623.00	2.21
286	300113	顺网科技	4,544,505.00	2.21
287	300386	飞天诚信	4,537,381.00	2.20
288	600884	杉杉股份	4,526,834.00	2.20
289	601208	东材科技	4,450,663.00	2.16
290	002299	圣农发展	4,437,155.23	2.15
291	002739	万达电影	4,431,707.50	2.15
292	601888	中国中免	4,430,561.00	2.15
293	000600	建投能源	4,424,841.00	2.15
294	688696	极米科技	4,420,440.30	2.15
295	603801	志邦家居	4,396,681.00	2.13
296	600745	闻泰科技	4,376,847.63	2.12
297	688202	美迪西	4,360,266.00	2.12
298	300770	新媒股份	4,349,747.00	2.11

299	300207	欣旺达	4,342,780.00	2.11
300	300057	万顺新材	4,330,595.69	2.10
301	002549	凯美特气	4,329,581.61	2.10
302	601137	博威合金	4,329,228.25	2.10
303	002979	雷赛智能	4,325,968.80	2.10
304	600138	中青旅	4,290,129.00	2.08
305	600641	万业企业	4,285,765.52	2.08
306	000034	神州数码	4,285,230.00	2.08
307	300383	光环新网	4,262,464.00	2.07
308	603378	亚士创能	4,239,359.00	2.06
309	600741	华域汽车	4,230,998.00	2.05
310	300082	奥克股份	4,221,081.55	2.05
311	002120	韵达股份	4,218,505.50	2.05
312	688357	建龙微纳	4,213,739.11	2.05
313	300941	创识科技	4,203,182.00	2.04
314	000768	中航西飞	4,201,045.00	2.04
315	600004	白云机场	4,180,057.00	2.03
316	603987	康德莱	4,158,452.00	2.02
317	001208	华菱线缆	4,146,978.52	2.01

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 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	4,646,190,405.30
卖出股票收入（成交）总额	4,664,030,402.93

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（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

注：无。

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

注：无。

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

注：无。

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

注：无。

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

注：无。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：报告期内本基金未进行股指期货投资。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

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

本基金投资范围不包含国债期货，无相关投资政策。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：报告期内本基金未进行国债期货投资。

8.11.3 本期国债期货投资评价

无。

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监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

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	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,621.55
5	应收申购款	197,342.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	198,964.10

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金无股指期货投资。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 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

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
兴银科技增长1个月滚动持有混合A	4,471	34,213.97	196,624.63	0.13%	152,774,053.30	99.87%
兴银科技增长1个月滚动持有混合C	515	36,458.30	36,379.51	0.19%	18,739,644.19	99.81%
合计	4,986	34,445.79	233,004.14	0.14%	171,513,697.49	99.86%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	兴银科技增长1个月滚动持有混合A	12.27	0.0000%
	兴银科技增长1个月滚动持有混合C	55,409.19	0.2951%
	合计	55,421.46	0.0323%

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情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	兴银科技增长1个月滚动持有混合A	0
	兴银科技增长1个月滚动持有混合C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基	兴银科技增长1	0

金	个月滚动持有混合 A	
	兴银科技增长 1 个月滚动持有混合 C	0
	合计	0

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

注：无。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	兴银科技增长 1 个月滚动持有混合 A	兴银科技增长 1 个月滚动持有混合 C
基金合同生效日（2021 年 02 月 18 日）基金份额总额	816,687,900.16	139,265,384.10
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	27,956,249.61	8,972,947.96
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	691,673,471.84	129,462,308.36
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）	-	-
本报告期期末基金份额总额	152,970,677.93	18,776,023.70

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

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

(1) 基金管理人于 2021 年 3 月 17 日公告，张贵云先生担任公司总经理，张力先生不再担任公司总经理。

(2) 基金管理人于 2021 年 7 月 20 日公告，郑翊鸣先生担任公司财务总监。

(3) 基金管理人于 2021 年 8 月 27 日公告，赵建兴先生担任公司总经理，张贵云先生不再担任公司总经理。

(4) 基金管理人于 2021 年 12 月 4 日公告，赵建兴先生担任公司首席信息官，刘建新先生不再担任公司副总经理、首席信息官。

(5) 基金管理人于 2021 年 12 月 31 日公告，刘钊先生担任公司副总经理。

(6) 基金管理人于 2022 年 1 月 28 日公告，吴真子女士担任公司督察长，余富材先生不再担任公司督察长。

(7) 基金管理人于 2022 年 3 月 1 日公告，沈阳女士担任公司副总经理。

(8) 报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

无。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自2021年1月1日起聘请毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。本报告期内本基金应付审计费41000.00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

报告期内本基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

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	
华福证券	2	9,301,780.107.16	100.00%	7,540,273.68	100.00%	-

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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华福证券	1,967,245.44	100.00%	9,711,600.00	100.00%	-	-	-	-

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	兴银科技增长1个月滚动持有期混合型证券投资基金基金份额发售公告；兴银科技	上海证券报	2021-01-13

	增长1个月滚动持有期混合型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告		
2	兴银科技增长1个月滚动持有期混合型证券投资基金基金份额发售公告、基金招募说明书、基金合同、基金托管协议、产品资料概要份额A、产品资料概要份额C	指定网站	2021-01-13
3	兴银科技增长1个月滚动持有期混合型证券投资基金提前结束募集的公告	上海证券报、指定网站	2021-02-02
4	兴银科技增长1个月滚动持有期混合型证券投资基金基金合同生效公告	上海证券报、指定网站	2021-02-19
5	兴银科技增长1个月滚动持有期混合型证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告	上海证券报、指定网站	2021-03-13
6	兴银科技增长1个月滚动持有期混合型证券投资基金（兴银科技增长1个月滚动持有混合A份额）基金产品资料概要（更新）、兴银科技增长1个月滚动持有期混合型证券投资基金（兴银科技增长1个月滚动持有混合C份额）基金产品资料概要（更新）	指定网站、中数平台	2021-03-16
7	兴银基金管理有限责任公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、证券时报、证券日报、中国证券报、指定网站	2021-03-17
8	兴银基金管理有限责任公司及子公司关于办公地址变更的公告	上海证券报、证券时报、证券日报、中国证券报、指定网站	2021-04-16
9	关于旗下基金在部分代销渠道开通定期定额投资并参与费率优惠活动的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报	2021-07-14
10	兴银基金管理有限责任公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、证券时报、证券日报、中国证券报、指定网站	2021-07-20
11	兴银基金管理有限责任公司关于旗下基金改聘会计师事务所的公告	上海证券报、证券时报、证券日报、中国证券报、指定网站	2021-07-20
12	兴银科技增长1个月滚动持	指定网站	2021-07-21

	有期混合型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告		
13	兴银基金管理有限责任公司 旗下部分基金 2021 年第 2 季 度报告提示性公告	上海证券报、证券日报、证 券时报、中国证券报	2021-07-21
14	关于旗下基金在部分代销渠 道开通定期定额投资、参与 费率优惠活动并公告	上海证券报、证券时报、证 券日报、中国证券报、指定 网站	2021-08-09
15	关于旗下基金在部分代销渠 道开通定期定额投资并参与 费率优惠活动的公告	上海证券报、证券时报、证 券日报、中国证券报、指定 网站	2021-08-18
16	兴银基金管理有限责任公司 关于高级管理人员变更的公 告	上海证券报、证券时报、证 券日报、中国证券报、指定 网站	2021-08-27
17	关于旗下基金参与招商银行 招赢通平台费率优惠活动的 公告	上海证券报、证券时报、证 券日报、中国证券报、指定 网站	2021-08-27
18	兴银科技增长 1 个月滚动持 有期混合型证券投资基金 2021 年中期报告	上海证券报、证券时报、证 券日报、中国证券报、指定 网站	2021-08-31
19	兴银基金管理有限责任公司 旗下部分基金 2021 年中期 报告提示性公告	上海证券报、证券日报、证 券时报、中国证券报	2021-08-31
20	关于《兴银科技增长 1 个月 滚动持有期混合型证券投资 基金 2021 年中期报告》的更 正公告	上海证券报、指定网站	2021-09-03
21	关于旗下基金参与宁波银行 同业易管家平台费率优惠活 动并开通定期定额投资的公 告	上海证券报、证券时报、证 券日报、中国证券报、指定 网站	2021-09-03
22	兴银基金管理有限责任公司 关于旗下基金持有的“首钢 股份”股票估值方法确认的 公告	上海证券报、证券时报、证 券日报、中国证券报、指定 网站	2021-09-10
23	关于旗下基金在部分代销渠 道开通定期定额投资并参与 费率优惠活动的公告	上海证券报、证券时报、证 券日报、中国证券报、指定 网站	2021-09-10
24	关于旗下基金在部分代销渠 道开通定期定额投资并参与 费率优惠活动的公告	上海证券报、证券时报、证 券日报、中国证券报、指定 网站	2021-09-23
25	兴银基金管理有限责任公司 关于旗下基金持有的“清水 源”股票估值方法调整的公 告	上海证券报、证券时报、证 券日报、中国证券报、指定 网站	2021-09-29

	告		
26	兴银科技增长1个月滚动持有期混合型证券投资基金2021年第3季度报告	指定网站	2021-10-27
27	兴银基金管理有限责任公司旗下部分基金2021年第3季度报告提示性公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报	2021-10-27
28	关于旗下基金参与基煜基金费率优惠活动并开通定期定额投资的公告	上海证券报、证券时报、证券日报、中国证券报、指定网站	2021-11-12
29	兴银科技增长1个月滚动持有期混合型证券投资基金招募说明书(更新)(2021年1号)、兴银科技增长1个月滚动持有期混合型证券投资基金(兴银景气优选混合A份额)基金产品资料概要(更新)、兴银科技增长1个月滚动持有期混合型证券投资基金(兴银景气优选混合C份额)基金产品资料概要(更新)	指定网站、中数平台	2021-12-01
30	兴银基金管理有限责任公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、证券时报、证券日报、中国证券报、指定网站	2021-12-04
31	兴银基金管理有限责任公司关于设立福建分公司的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、指定网站	2021-12-29
32	兴银基金管理有限责任公司2021年行业高级管理人员变更公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、指定网站	2021-12-31

§ 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

注：报告期内单一投资者持有基金份额比例未达到或超过20%。

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. 中国证监会准予基金募集注册的文件
2. 《兴银科技增长1个月滚动持有期混合型证券投资基金基金合同》
3. 《兴银科技增长1个月滚动持有期混合型证券投资基金招募说明书》

4. 《兴银科技增长 1 个月滚动持有期混合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

13.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处。

13.3 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
二〇二二年三月三十一日