

# 东兴宸瑞量化混合型证券投资基金

## 2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人:东兴基金管理有限公司

基金托管人:浙商银行股份有限公司

送出日期:2022 年 08 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、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年8月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年1月1日起至2022年6月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作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	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 中期财务会计报告(未经审计)	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产(基金净值)变动表	18
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	62
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	63
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	63
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	63
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
7.12 投资组合报告附注	63
§8 基金份额持有人信息	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	64

§9 开放式基金份额变动.....	64
§10 重大事件揭示.....	65
10.1 基金份额持有人大会决议.....	65
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	65
10.4 基金投资策略的改变.....	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	65
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	65
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	65
10.8 其他重大事件.....	66
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	66
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	67
§12 备查文件目录.....	67
12.1 备查文件目录.....	67
12.2 存放地点.....	67
12.3 查阅方式.....	67

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	东兴宸瑞量化混合型证券投资基金	
基金简称	东兴宸瑞量化混合	
基金主代码	012297	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年06月30日	
基金管理人	东兴基金管理有限公司	
基金托管人	浙商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	34,998,762.92份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	东兴宸瑞量化混合A	东兴宸瑞量化混合C
下属分级基金的交易代码	012297	012298
报告期末下属分级基金的份额总额	28,236,929.31份	6,761,833.61份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，力争实现达到或超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金基于定量与定性相结合的方式跟踪国内外宏观经济数据及政策变化，密切关注市场流动性变化情况，动态评估不同资产的估值水平变化，合理确定组合中权益资产、债券资产及货币市场工具及其他金融工具的投资比例。
业绩比较基准	中证800指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	东兴基金管理有限公司	浙商银行股份有限公司
信息披露 姓名	银国宏	朱巍

露负责人	联系电话	400-670-1800	0571-87659806
	电子邮箱	kefu@dxamc.cn	zhuwei@czbank.com
客户服务电话		400-670-1800	95527
传真		010-57307388	0571-88268688
注册地址		北京市丰台区东管头1号院1号楼1-190室	浙江省杭州市萧山区鸿宁路1788号
办公地址		北京市西城区平安里西大街28号中海国际中心6层	浙江省杭州市拱墅区延安路368号
邮政编码		100035	310006
法定代表人		银国宏	张荣森(代为履行法定代表人职责)

注：因原法定代表人辞任，浙商银行股份有限公司于2022年1月14日以书面传签方式召开第六届董事会2022年第一次临时会议，审议通过了《关于推举董事代为履行董事长职责的议案》。经全体董事一致表决同意，由执行董事、行长张荣森先生代为履行董事长、董事会战略委员会主任委员、董事会普惠金融发展委员会主任委员及法定代表人职责，直至选举产生新任董事长且其任职资格获银保监会核准之日止。

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.dxamc.cn">http://www.dxamc.cn</a>
基金中期报告备置地点	北京市西城区平安里西大街28号中海国际中心6层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	东兴基金管理有限公司	北京市西城区平安里西大街28号中海国际中心6层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

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

	(2022年01月01日-2022年06月30日)	
	东兴宸瑞量化混合 A	东兴宸瑞量化混合 C
本期已实现收益	-3,757,259.72	-1,222,008.15
本期利润	-2,037,730.42	-1,312,967.28
加权平均基金份额本期利润	-0.0689	-0.1271
本期加权平均净值利润率	-7.49%	-13.82%
本期基金份额净值增长率	-5.73%	-5.80%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末 (2022年06月30日)	
期末可供分配利润	-2,042,012.92	-496,973.29
期末可供分配基金份额利润	-0.0723	-0.0735
期末基金资产净值	27,709,108.53	6,626,682.62
期末基金份额净值	0.9813	0.9800
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末 (2022年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-1.87%	-2.00%

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、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。

3、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

东兴宸瑞量化混合A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值增长 率标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	10.53%	1.09%	7.11%	0.84%	3.42%	0.25%
过去三个月	6.76%	1.72%	4.30%	1.18%	2.46%	0.54%
过去六个月	-5.73%	1.57%	-7.80%	1.17%	2.07%	0.40%

过去一年	-1.87%	1.23%	-9.27%	0.97%	7.40%	0.26%
自基金合同生效起至今	-1.87%	1.22%	-8.79%	0.97%	6.92%	0.25%

## 东兴宸瑞量化混合C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	10.52%	1.09%	7.11%	0.84%	3.41%	0.25%
过去三个月	6.70%	1.72%	4.30%	1.18%	2.40%	0.54%
过去六个月	-5.80%	1.57%	-7.80%	1.17%	2.00%	0.40%
过去一年	-2.00%	1.23%	-9.27%	0.97%	7.27%	0.26%
自基金合同生效起至今	-2.00%	1.22%	-8.79%	0.97%	6.79%	0.25%

### 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

东兴宸瑞量化混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021年06月30日-2022年06月30日)





东兴宸瑞量化混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：1、本基金基金合同生效日为 2021 年 6 月 30 日，根据相关法律法规和基金合同，本基金建仓期为基金合同生效之日起 6 个月内，截止本报告期末距建仓期结束不满一年；

2、建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

东兴基金管理有限公司（以下简称“东兴基金”）成立于2020年3月，注册地北京，注册资本2亿元。东兴证券股份有限公司（以下简称“东兴证券”）持有东兴基金100%股份，其控股股东为中国东方资产管理股份有限公司（以下简称“中国东方”），实际控制人为中国财政部。东兴基金系中国东方下属唯一公募基金业务经营主体，是中国东方金融服务平台的重要组成部分。

东兴基金前身为东兴证券基金业务部，先后在主动权益、固定收益、现金管理和指数类产品方面进行了大量布局，积累了丰富的投资运作经验：

特色指数类产品——在行业指数、量化增强方面进行深入研究设计，致力于打造特色精品指数类基金阵列；

主动管理类产品——以追求绝对收益为目标，贯彻自上而下和自下而上相结合的投研思路，坚持价值投资；

固定收益类产品—坚持守住价值、发现价值的原则，在严格把控信用风险的前提下，充分挖掘市场机会。

东兴基金拥有一支行业经验丰富、具备高度凝聚力、战斗力和专业性的优秀团队。公司大部分员工来自于基金、券商、投资、信评等各类金融机构，90%以上员工具有硕士及以上学历。公司承载中国东方的红色基因，践行诚信、创新、激情、专注、协作的企业文化，坚持以投资者利益为上的原则，致力为客户持续创造价值。

截至2022年6月30日，本公司管理东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金、东兴蓝海财富灵活配置混合型证券投资基金、东兴安盈宝货币市场基金、东兴兴利债券型证券投资基金、东兴量化优享灵活配置混合型证券投资基金、东兴品牌精选灵活配置混合型证券投资基金、东兴兴福一年定期开放债券型证券投资基金、东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金、东兴兴瑞一年定期开放债券型证券投资基金、东兴兴财短债债券型证券投资基金、东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金、东兴中证消费50指数证券投资基金、东兴兴晟混合型证券投资基金、东兴宸瑞量化混合型证券投资基金、东兴鑫享6个月滚动持有债券型发起式证券投资基金、东兴兴盈三个月定期开放债券型证券投资基金、东兴兴源债券型证券投资基金、东兴宸祥量化混合型证券投资基金、东兴连裕6个月滚动持有债券型证券投资基金共19只开放式基金。

#### 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		
张旭先生	本基金基金经理	2021-06-30	-	9年	张旭先生，硕士研究生，曾就职于东软集团、隆圣投资管理有限公司，具有基金从业资格。2012年3月至2015年3月就职于银华基金管理有限公司，任年金与特定客户资产管理计划投资经理，2015年3月加入中加基金管理有限公司，任权益投资部总监、基金经理。2019年11月加入东兴证券股份有限公司基金业务部，任助理总经理、投资总监。现任东兴量化优享灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东兴宸瑞量化混合型证券投资基金基金经理、东

					兴兴源债券型证券投资基金基金经理。
李兵伟先生	本基金基金经理	2021-06-30	-	11年	中央财经大学金融学硕士，11年以上证券行业从业经历，11年以上证券投研管理经验。2010年7月至2015年8月，任信达证券金融工程研究员、投资经理；2015年9月加入东兴证券股份有限公司基金业务部。现任东兴量化优享灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东兴中证消费50指数证券投资基金基金经理、东兴兴晟混合型证券投资基金基金经理、东兴宸瑞量化混合型证券投资基金基金经理、东兴宸祥量化混合型证券投资基金基金经理。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

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。

#### 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、中国证券监督管理委员会和《东兴宸瑞量化混合型证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《东兴基金管理有限公司公平交易管理办法》。

基金管理人建立了投资决策的内部控制体系和客观的研究方法，各投资组合经理在授权范围内自主决策，各投资组合共享研究平台，在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

基金管理人实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于交易所公开竞价交易，基金管理人执行交易系统内的公平交易程序；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易，在参与申购之

前，各基金经理应在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量。在获配额度确定后，按照价格优先的原则对交易结果进行分配；如果申购价格相同，则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配。债券一级市场申购分配不足最小单位的，可由基金经理协商分配，协商不一致则由投资总监决定；对于银行间市场交易，应按照场外交易流程执行，由各基金经理给出询价区间，交易部根据询价区间在银行间市场上应该按照价格优先、时间优先的原则进行询价并完成交易，并留存询价交易记录备查。

基金管理人定期对不同投资组合不同时间段的同向交易价差、反向交易情况、异常交易情况进行统计分析，投资组合经理对相关交易情况进行合理性解释并留存记录。

我们对本报告期内公司管理的不同投资组合在相同时间窗口下（日内、3日内和5日内）同向交易的价差进行了t分布假设检验，通过对检验结果进行分析，未发现旗下投资组合之间存在可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

本报告期内，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，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中公平对待不同投资组合，未直接或通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。本基金运作符合法律法规和公平交易管理制度规定。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022年一季度，市场面临错综复杂的国内外环境，全球疫情反复、俄乌冲突爆发、美联储收紧流动性以及国内经济面临增长压力，A股市场持续震荡下行。二季度随着稳增长措施的持续发力及国内疫情边际好转，投资者对国内经济预期也转向积极，宏观流动性宽松，A股市场风险偏好从底部回升，个股活跃度显著上升。

东兴宸瑞在投资策略方面采用分散化投资和指数增强的理念，在稳增长预期持续加强的背景下，选取具有较好的长期投资价值的股票形成组合。我们在投资策略方面坚持分散化投资的理念，以规避黑天鹅风险。在选股层面，通过多方面筛选，重点选择成长性好，盈利能力强的公司，结合估值预期形成投资组合。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2022年1月1日起至2022年6月30日，本基金A类份额净值增长率为-5.73%，业绩比较基准收益率为-7.80%，高于业绩比较基准2.07%；本基金C类份额净值增长率为-5.80%，业绩比较基准收益率为-7.80%，高于业绩比较基准2.00%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

往后看，随着疫情防控措施边际放松，稳增长政策加快落地，我国经济下半年将维持温和回升的态势。当前市场的流动性依然较为充裕，对A股行情形成正面支撑，我们认为市场的系统风险已经缓解，上市公司业绩会伴随宏观景气企稳回升，进入修复阶段，未来仍有结构性机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、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。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本基金本报告期未进行利润分配。

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

报告期内，受基金份额持有人赎回等影响，本基金存在基金资产净值连续六十个工作日低于五千万元的情况，但不存在连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形，本基金管理人已将此情况上报中国证监会并采取适当措施。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，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

本报告期内，本基金的管理人—东兴基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对东兴基金管理有限公司编制和披露的东兴宸瑞量化混合型证券投资基金2022年中期报告中财务指标、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进行了复核，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 中期财务会计报告(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：东兴宸瑞量化混合型证券投资基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	2,037,361.45	579,057.74
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	32,639,601.56	38,576,561.40
其中：股票投资		30,809,287.41	36,776,381.40
基金投资		-	-
债券投资		1,830,314.15	1,800,180.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-

资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	295.57
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	35,023.56
资产总计		34,676,963.01	39,190,938.27
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年06月30日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		262,393.64	199,432.10
应付管理人报酬		40,770.23	54,165.63
应付托管费		5,436.03	7,222.11
应付销售服务费		520.19	525.98
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	32,051.77	19,000.00
负债合计		341,171.86	280,345.82
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	34,998,762.92	37,385,830.28
其他综合收益		-	-

未分配利润	6.4.7.8	-662,971.77	1,524,762.17
净资产合计		34,335,791.15	38,910,592.45
负债和净资产总计		34,676,963.01	39,190,938.27

注：报告截止日2022年6月30日，东兴宸瑞量化混合A基金份额净值0.9813元，基金份额总额28,236,929.31份，东兴宸瑞量化混合C基金份额净值0.9800元，基金份额总额6,761,833.61份。

## 6.2 利润表

会计主体：东兴宸瑞量化混合型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至 2022年06月30日	上年度可比期间 2021年06月30日 (基金合同生效 日)至2021年06月3 0日
<b>一、营业总收入</b>		-3,004,566.15	4,605.86
1. 利息收入		8,551.31	4,605.86
其中：存款利息收入	6.4.7.9	4,638.02	4,605.86
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		3,913.29	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-4,641,706.81	-
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-5,006,591.51	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	15,832.66	-
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-



收益			
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	349,052.04	-
以摊余成本计量的 金融资产终止确认 产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,628,570.17	-
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.17	19.18	-
<b>减：二、营业总支出</b>		346,131.55	486.49
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	272,972.02	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	36,396.22	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	4,697.45	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		14.09	-
8. 其他费用	6.4.7.19	32,051.77	486.49
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		-3,350,697.70	4,119.37
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		-3,350,697.70	4,119.37
<b>五、其他综合收益的税后 净额</b>		-	-

六、综合收益总额		-3,350,697.70	4,119.37
----------	--	---------------	----------

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：东兴宸瑞量化混合型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合 收益	未分配利润	净资产合 计
一、上期期末净资产（基金净值）	37,385,830.28	-	1,524,762.17	38,910,592.45
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	37,385,830.28	-	1,524,762.17	38,910,592.45
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,387,067.36	-	-2,187,733.94	-4,574,801.30
（一）、综合收益总额	-	-	-3,350,697.70	-3,350,697.70
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-2,387,067.36	-	1,162,963.76	-1,224,103.60
其中：1. 基金申购款	17,970,932.27	-	-739,184.71	17,231,747.56
2. 基金赎回款	-20,357,999.63	-	1,902,148.47	-18,455,851.16
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	34,998,762.92	-	-662,971.77	34,335,791.15
项 目	上年度可比期间 2021年06月30日（基金合同生效日）至2021年06月30日			
	实收基金	其他综合 收益	未分配利 润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	236,873,220.51	0.00	0.00	236,873,220.51
加：会计政策变更	0.00	0.00	0.00	0.00

前期差错更正	0.00	0.00	0.00	0.00
其他	0.00	0.00	0.00	0.00
二、本期期初净资产（基金净值）	236,873,220.51	0.00	0.00	236,873,220.51
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	0.00	0.00	4,119.37	4,119.37
（一）、综合收益总额	0.00	0.00	4,119.37	4,119.37
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	0.00	0.00	-	0.00
其中：1. 基金申购款	0.00	0.00	-	0.00
2. 基金赎回款	0.00	0.00	-	0.00
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	0.00	0.00	0.00	0.00
（四）、其他综合收益结转留存收益	0.00	0.00	0.00	0.00
四、本期期末净资产（基金净值）	236,873,220.51	0.00	4,119.37	236,877,339.88

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

银国宏

王青

王广辉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

东兴宸瑞量化混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据2021年3月19日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予东兴宸瑞量化混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2021]956号）的批复，自2021年5月28日至2021年6月25日公开募集设立。本基金为混合型证券投资基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集236,819,943.42元人民币，业经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）“德师报(验)字(21)第00308号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《东兴宸瑞量化混合型证券投资基金基金合同》于2021年6月30日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为236,873,220.51份，其中认购资金利息折合53,277.09份。本基金基金管理人为东兴基金管理有限公司，基金托管人为浙商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东兴宸瑞量化混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创

业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、次级债、二级资本债、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债、企业债、公司债、可转换公司债券(含分离交易的可转换公司债券)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款等)、同业存单、货币市场工具、国债期货、股票期权、股指期货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:本基金股票投资占基金资产的60%-95%,每个交易日日终在扣除国债期货合约、股票期权合约、股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券的投资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。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的会计报表按照财政部2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》(财政部令第33号发布、财政部令第76号修订)、于2006年2月15日及其后颁布和修订的42项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第3号—半年度报告的内容与格式》、《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》、《证券投资基金信息披露编报规则第3号—会计报表附注的编制及披露》及中国证监会颁布的其他相关规定编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合企业会计准则及其他有关规定要求,真实、完整地反映了本基金2022年6月30日的财务状况以及2022年1月1日至2022年6月30日的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下述变更后的会计政策外,本基金在本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日。本期财务报表的实际编制期间为2022年1月1日至2022年6月30日。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### 1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：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其他综合收益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产。在通常情况下，本基金所持有的金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产。

基金持有的股票投资、债券投资、基金投资、资产支持证券投资等金融资产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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，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。

基金持有的以摊余成本计量的、按照返售协议约定先买入再按固定价格返售的票据、证券等金融资产所融出的资金分类为买入返售金融资产。

基金采用买入并持有至到期策略的金融资产，即到期日固定、回收金额固定或可确定，且有明确意图和能力持有至到期的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产，在债权投资中核算。

基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### 2、金融负债的分类

金融负债分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以及以摊余成本计量的金融负债两类。基金持有的未划分为以摊余成本计量的金融负债通常以公允价值计量且其变动计入当期损益，列示为交易性金融负债。基金持有的其他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。

#### 6.4.4.4 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于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按取得时的公允价值作为初始确认金额。取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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，期间取得的利息或现金股利，确认为当期收益。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以成本进行后续计量，在摊销时产生的利得或损失，应当确认为当期收益。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产；金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

1、对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应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，应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，应对报价进行调整，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其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2、对不存在活跃市场的投资品种，应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，应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证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时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时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 6.4.4.7 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。

#### 6.4.4.8 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基金净值比例计算的金额。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认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

##### （1）利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

分类为以摊余成本计量的金融资产利息收入在持有期内，按金融资产的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由金融资产发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认金融资产利息收入。其中：贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入；买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息收入。

##### （2）投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本和对应投资品种产生的交易费用的差额确认。

债券、资产支持证券、同业存单等固定收益类金融资产的投资收益分为：

① 持有期间的利息收入：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利息收入在持有期内，按金融资产的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由金融资产发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认金融资产投资收益。其中：贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认投资收益；

② 交易日按卖出金融资产交易日的成交总额扣除应结转的投资成本与应计利息(若有)和对应投资品种产生的交易费用后的差额确认投资收益。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本和对应投资品种产生的交易费用后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

#### (3) 公允价值变动损益

公允价值变动损益系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性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，并于相关金融资产或金融负债卖出或到期时转出计入投资收益。

#### (4) 其他收入

其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量时确认。

### 6.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 根据基金合同，基金管理费按前一日基金资产净值的1.50%的年费率逐日计提；

(2) 根据基金合同，基金托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率逐日计提；

(3) 根据基金合同，基金销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.10%的年费率计提；

(4) 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费用；基金份额持有人大会费用、基金的证券交易或结算费用；基金的银行汇划费用；证券账户开户费用、银行账户维护费用、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的30%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、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；选择采取红利再投资形式的，分红资金将按红利发放日的基金份额净值转成相应的基金份额，红利再投资的份额免收申购费。如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，则登记机构将以投资者在各销售机构最后一次选择的分红方式为准；

3、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；

4、同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5、分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红，分红权益登记日申请赎回的基金份额享受当次分红；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。



在不违反法律法规且对现有基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人、登记机构可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

#### 6.4.4.12 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及计量基础一致。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他需要披露的重要会计政策和会计估计。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

根据《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》、《企业会计准则第37号—金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自2022年1月1日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金期初资产负债表项目无重大影响。上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

根据中国证监会于2022年颁布的修订后的《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〉》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期无需说明的重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期无需说明的重大会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税【2004】78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税【2008】1号《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》、2008

年4月23日发布的《上海、深圳证券交易所关于做好交易相关系统印花税率参数调整的通知》、2008年9月18日发布的《上海、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【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【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】70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》、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《财政部、国家税务总局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、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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《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》，主要税项列示如下：

1. 于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。自2018年1月1日起，在基金运营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。

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，股权的股息、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. 对基金取得的股票股息、红利收入，自2015年9月8日起，基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4. 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5. 对于基金从事A股买卖，自2008年09月19日起，由出让方按0.1%的税率缴纳证券（股票）交易印花税，受让方不再缴纳印花税。

6. 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、现金等对价，暂免于缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
----	--------------------

活期存款	582,671.82
等于：本金	582,657.69
加：应计利息	14.13
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	1,454,689.63
等于：本金	1,454,515.85
加：应计利息	173.78
减：坏账准备	-
合计	2,037,361.45

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券资金账户的证券交易结算资金。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	28,860,062.02	-	30,809,287.41	1,949,225.39	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	1,811,035.44	17,599.15	1,830,314.15	1,679.56
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,811,035.44	17,599.15	1,830,314.15	1,679.56
资产支持证券	-	-	-	-	

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	30,671,097.46	17,599.15	32,639,601.56	1,950,904.95

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	32,051.77
合计	32,051.77

注：预提费用为按日计提的审计费和信息披露费。

#### 6.4.7.7 实收基金

## 6.4.7.7.1 东兴宸瑞量化混合A

金额单位：人民币元

项目 (东兴宸瑞量化混合A)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	31,754,882.13	31,754,882.13
本期申购	153,179.40	153,179.40
本期赎回(以“-”号填列)	-3,671,132.22	-3,671,132.22
本期末	28,236,929.31	28,236,929.31

## 6.4.7.7.2 东兴宸瑞量化混合C

金额单位：人民币元

项目 (东兴宸瑞量化混合C)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	5,630,948.15	5,630,948.15
本期申购	17,817,752.87	17,817,752.87
本期赎回(以“-”号填列)	-16,686,867.41	-16,686,867.41
本期末	6,761,833.61	6,761,833.61

## 6.4.7.8 未分配利润

## 6.4.7.8.1 东兴宸瑞量化混合A

单位：人民币元

项目 (东兴宸瑞量化混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	1,704,838.61	-407,045.59	1,297,793.02
本期利润	-3,757,259.72	1,719,529.30	-2,037,730.42
本期基金份额交易产生的变动数	10,408.19	201,708.43	212,116.62
其中：基金申购款	1,386.26	-10,215.11	-8,828.85
基金赎回款	9,021.93	211,923.54	220,945.47
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-2,042,012.92	1,514,192.14	-527,820.78
-----	---------------	--------------	-------------

## 6.4.7.8.2 东兴宸瑞量化混合C

单位：人民币元

项目 (东兴宸瑞量化混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	299,107.55	-72,138.40	226,969.15
本期利润	-1,222,008.15	-90,959.13	-1,312,967.28
本期基金份额交易产生的变动数	425,927.31	524,919.83	950,847.14
其中：基金申购款	139,747.80	-870,103.66	-730,355.86
基金赎回款	286,179.51	1,395,023.49	1,681,203.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-496,973.29	361,822.30	-135,150.99

## 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
活期存款利息收入	1,482.99
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	3,155.03
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	4,638.02

## 6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
卖出股票成交总额	140,774,555.16
减：卖出股票成本总额	145,410,146.41

减：交易费用	371,000.26
买卖股票差价收入	-5,006,591.51

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
债券投资收益——利息收入	23,913.34
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-8,080.68
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	15,832.66

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,568,799.77
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,440,508.51
减：应计利息总额	135,395.87
减：交易费用	976.07
买卖债券差价收入	-8,080.68

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
股票投资产生的股利收益	349,052.04
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	349,052.04

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	1,628,570.17
——股票投资	1,626,647.66
——债券投资	1,922.51
——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	1,628,570.17

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
----	-------------------------------



基金赎回费收入	19.18
合计	19.18

#### 6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
审计费用	9,421.05
信息披露费	22,630.72
证券出借违约金	-
合计	32,051.77

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

本基金本报告期末不存在需要说明的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本基金报告报出日，本基金不存在需要说明的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中国东方资产管理股份有限公司	基金管理人的实际控制人
东兴证券股份有限公司	基金管理人的控股股东、基金销售机构
东兴基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
浙商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
大连银行股份有限公司	与基金管理人同一实际控制人的关联方、基金销

	售机构
--	-----

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方的佣金费用，期末无应支付关联方的佣金。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日 至2022年06月30 日	上年度可比期间 2021年06月30日（基金合同 生效日）至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	272,972.02	-
其中：支付销售机构的客户维护费	136,349.90	-

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年01月01日至2022年06月30日	2021年06月30日（基金合同生效日）至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	36,396.22	-

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2022年01月01日至2022年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东兴宸瑞量化混合A	东兴宸瑞量化混合C	合计
东兴证券股份有限公司	0.00	3,319.19	3,319.19
浙商银行股份有限公司	0.00	265.36	265.36
合计	0.00	3,584.55	3,584.55

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按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.10%的年费率计提。C类基金份额销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E为前一日的C类基金份额基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取，由基金管理人支付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

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

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

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

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

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30 日		上年度可比期间 2021年06月30日（基金合同生效 日）至2021年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浙商银行股份有限公司	582,671.82	1,482.99	236,873,220.51	4,605.86

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项的说明。

#### 6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2022年06月30日）本基金持有的流通受限证券

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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险和操作风险及其他不可抗拒的风险。其中在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

对于上述风险本基金管理人建立了系统化、流程化和数量化的风险管理体系，确保投资组合在获取较高收益的同时承受尽可能低的风险，从而实现本基金的投资目标。本

基金设立了由投资决策委员会、风险控制委员会、风险管理部和合规法律部组成的风险管理组织体系，该体系通过分工合作的制度对风险进行管理控制。本基金通过事前的风险识别，事中的风险测量和处理以及事后的风险评估和调整风险实行全程风险控制。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、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；本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的百分之十，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，不超过该证券的百分之十。

除通过上述投资限定控制相应信用风险外，本基金在交易所进行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，发生违约风险的可能性很低；本基金也可在银行间同业市场进行交易，在交易前均会对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本期末及上年度末持有的债券均为国债，未包含在按短期信用评级列示的债券投资中。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有资产支持证券。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有同业存单。

##### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本期末及上年度末持有的债券均为国债，未包含在按长期信用评级列示的债券投资中。

##### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有资产支持证券。

##### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有同业存单。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人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上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、组合在短时间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的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注6.4.12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，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。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投资的公允价值。

于2022年6月30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。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本报告所称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，风险管理的目标是确保基金组合资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。基金管理人在报告期内综合考虑投资标的流动性、投资策略、投资限制、销售渠道、潜在投资者类型与风险偏好、投资者结构等因素，综合进行流动性风险管理。

基金管理人坚持按照“组合管理、分散投资”的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制进行投资管理，通过灵活配置的二级市场投资策略、分散化的投资原则、严格的投资比例限制等投资安排，使基金组合资产的流动性安排与基金申赎安排相匹配，报告期内未发生流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指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。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。

本基金管理人在利率风险管理方面，定期监控本基金面临的利率风险敞口，并通过调整基金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银行存款、结算备付金及债券投资等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 06 月 30 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	2,037,173.54	-	-	-	-	187.91	2,037,361.45
交易性金融资产	-	-	1,812,715.00	-	-	30,826,886.56	32,639,601.56
资产总计	2,037,173.54	-	1,812,715.00	-	-	30,827,074.47	34,676,963.01
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	262,393.64	262,393.64
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	40,770.23	40,770.23
应付托管费	-	-	-	-	-	5,436.03	5,436.03
应付销售服务费	-	-	-	-	-	520.19	520.19
其他负债	-	-	-	-	-	32,051.77	32,051.77
负债总计	-	-	-	-	-	341,171.86	341,171.86
利率敏感度缺口	2,037,173.54	-	1,812,715.00	-	-	30,485,902.61	34,335,791.15
上年度末 2021 年 12 月 31 日							
资产							
银行存款	579,057.74	-	-	-	-	-	579,057.74
交易性金融资产	-	1,800,180.00	-	-	-	36,776,381.40	38,576,561.40
应收申购款	-	-	-	-	-	295.57	295.57
其他资产	-	-	-	-	-	35,023.56	35,023.56
资产总计	579,057.74	1,800,180.00	-	-	-	36,811,700.53	39,190,938.27
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	199,432.10	199,432.10
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	54,165.63	54,165.63
应付托管费	-	-	-	-	-	7,222.11	7,222.11
应付销售服务费	-	-	-	-	-	525.98	525.98
其他负债	-	-	-	-	-	19,000.00	19,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	280,345.82	280,345.82
利率敏感度缺口	579,057.74	1,800,180.00	-	-	-	36,531,354.71	38,910,592.45

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



## 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假 设	1、该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况； 2、所有期限的利率均以相同幅度变动25个基点，其他市场变量均不发生变化； 3、银行存款、结算备付金、存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益、而对其本身的公允价值无重大影响； 4、该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	1、市场利率上升25个基点	-2,419.46	-553.39
	2、市场利率下降25个基点	2,425.93	553.73

## 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

## 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要是市场价格风险。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股票和债券，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。

## 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净	公允价值	占基金 资产净

		值比例 (%)		值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	30,809,287.41	89.73	36,776,381.40	94.52
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,830,314.15	5.33	1,800,180.00	4.63
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	32,639,601.56	95.06	38,576,561.40	99.14

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	30,809,287.41	36,773,323.35
第二层次	1,830,314.15	1,800,180.00
第三层次	-	3,058.05
合计	32,639,601.56	38,576,561.40

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本报告期内不存在持有的金融工具公允价值所属层次间发生重大变动的情况。

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期内不存在持有非持续以公允价值计量的金融工具的情况。

**6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明**

本基金本报告期内不存在持有不以公允价值计量的金融工具的情况。

**6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

截至本报告报出日，本基金无需要披露的有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

**§ 7 投资组合报告****7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	30,809,287.41	88.85
	其中：股票	30,809,287.41	88.85
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,830,314.15	5.28
	其中：债券	1,830,314.15	5.28
	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	2,037,361.45	5.88
8	其他各项资产	-	-
9	合计	34,676,963.01	100.00

**7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合**

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	29,217.00	0.09
B	采矿业	1,390,025.00	4.05

C	制造业	18,347,959.56	53.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	850,222.00	2.48
E	建筑业	1,157,583.00	3.37
F	批发和零售业	815,451.00	2.37
G	交通运输、仓储和邮政业	557,109.76	1.62
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	796,442.00	2.32
J	金融业	5,341,613.70	15.56
K	房地产业	156,356.90	0.46
L	租赁和商务服务业	367,420.40	1.07
M	科学研究和技术服务业	161,523.91	0.47
N	水利、环境和公共设施管理业	16,058.88	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	43,829.30	0.13
R	文化、体育和娱乐业	4,120.00	0.01
S	综合	774,355.00	2.26
	合计	30,809,287.41	89.73

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601166	兴业银行	54,100	1,076,590.00	3.14
2	601898	中煤能源	73,700	765,006.00	2.23
3	600863	内蒙华电	167,300	610,645.00	1.78
4	601390	中国中铁	94,700	581,458.00	1.69
5	600438	通威股份	9,600	574,656.00	1.67
6	600089	特变电工	20,900	572,451.00	1.67
7	600919	江苏银行	80,300	571,736.00	1.67
8	002709	天赐材料	9,100	564,746.00	1.64

9	600673	东阳光	61,700	554,683.00	1.62
10	300059	东方财富	21,380	543,052.00	1.58
11	603198	迎驾贡酒	8,300	540,662.00	1.57
12	601838	成都银行	31,600	523,928.00	1.53
13	601456	国联证券	40,100	492,027.00	1.43
14	688005	容百科技	3,775	488,636.00	1.42
15	002332	仙琚制药	48,800	479,216.00	1.40
16	002241	歌尔股份	14,100	473,760.00	1.38
17	300363	博腾股份	5,600	436,744.00	1.27
18	601668	中国建筑	80,600	428,792.00	1.25
19	688330	宏力达	4,885	420,061.15	1.22
20	600741	华域汽车	16,300	374,900.00	1.09
21	600873	梅花生物	33,100	373,368.00	1.09
22	601318	中国平安	7,900	368,851.00	1.07
23	300777	中简科技	7,300	351,860.00	1.02
24	600030	中信证券	16,165	350,133.90	1.02
25	603369	今世缘	6,600	336,600.00	0.98
26	000661	长春高新	1,400	326,788.00	0.95
27	688521	芯原股份	6,533	322,730.20	0.94
28	601658	邮储银行	59,100	318,549.00	0.93
29	603300	华铁应急	39,520	314,974.40	0.92
30	688200	华峰测控	835	297,594.00	0.87
31	000568	泸州老窖	1,200	295,848.00	0.86
32	300593	新雷能	6,780	281,437.80	0.82
33	300709	精研科技	9,280	274,595.20	0.80
34	600096	云天化	8,700	273,876.00	0.80
35	603368	柳药集团	14,800	254,856.00	0.74
36	600256	广汇能源	24,100	254,014.00	0.74
37	601677	明泰铝业	10,360	246,568.00	0.72
38	002738	中矿资源	2,540	235,229.40	0.69
39	002129	TCL中环	3,900	229,671.00	0.67

40	002497	雅化集团	7,000	228,550.00	0.67
41	600596	新安股份	10,460	226,459.00	0.66
42	300138	晨光生物	14,500	225,765.00	0.66
43	002947	恒铭达	12,100	222,640.00	0.65
44	000060	中金岭南	49,300	219,878.00	0.64
45	000833	粤桂股份	24,300	219,672.00	0.64
46	600908	无锡银行	38,400	216,192.00	0.63
47	600481	双良节能	12,800	215,680.00	0.63
48	002850	科达利	1,300	206,700.00	0.60
49	601872	招商轮船	35,700	205,632.00	0.60
50	002876	三利谱	5,000	200,100.00	0.58
51	600036	招商银行	4,700	198,340.00	0.58
52	300820	英杰电气	3,050	196,877.50	0.57
53	002460	赣锋锂业	1,300	193,310.00	0.56
54	603713	密尔克卫	1,400	191,380.00	0.56
55	600566	济川药业	6,800	184,688.00	0.54
56	600153	建发股份	13,100	171,217.00	0.50
57	002801	微光股份	5,600	167,160.00	0.49
58	600285	羚锐制药	13,100	164,143.00	0.48
59	002142	宁波银行	4,200	150,402.00	0.44
60	002821	凯莱英	500	144,500.00	0.42
61	300630	普利制药	4,100	144,115.00	0.42
62	688636	智明达	1,269	143,891.91	0.42
63	600219	南山铝业	38,900	143,541.00	0.42
64	300566	激智科技	7,500	135,750.00	0.40
65	688516	奥特维	486	129,737.70	0.38
66	300775	三角防务	2,500	120,375.00	0.35
67	600028	中国石化	28,700	117,096.00	0.34
68	002009	天奇股份	6,300	116,550.00	0.34
69	688559	海目星	1,578	114,720.60	0.33
70	000906	浙商中拓	12,400	112,592.00	0.33

71	000968	蓝焰控股	10,600	110,770.00	0.32
72	002556	辉隆股份	9,300	108,810.00	0.32
73	300750	宁德时代	200	106,800.00	0.31
74	002484	江海股份	4,500	105,030.00	0.31
75	002881	美格智能	3,160	101,309.60	0.30
76	002594	比亚迪	300	100,047.00	0.29
77	601615	明阳智能	2,900	98,020.00	0.29
78	600600	青岛啤酒	900	93,528.00	0.27
79	002304	洋河股份	500	91,575.00	0.27
80	300666	江丰电子	1,500	91,500.00	0.27
81	688100	威胜信息	3,996	83,876.04	0.24
82	603112	华翔股份	5,500	82,005.00	0.24
83	300769	德方纳米	200	81,736.00	0.24
84	000830	鲁西化工	4,700	81,263.00	0.24
85	600901	江苏租赁	15,200	77,976.00	0.23
86	601128	常熟银行	10,200	77,928.00	0.23
87	300130	新国都	6,300	77,238.00	0.22
88	600886	国投电力	6,900	72,450.00	0.21
89	002475	立讯精密	2,100	70,959.00	0.21
90	600639	浦东金桥	5,010	68,085.90	0.20
91	002372	伟星新材	2,800	67,312.00	0.20
92	600809	山西汾酒	200	64,960.00	0.19
93	603345	安井食品	378	63,454.86	0.18
94	300896	爱美客	100	60,001.00	0.17
95	002459	晶澳科技	760	59,964.00	0.17
96	002648	卫星化学	2,288	59,144.80	0.17
97	000090	天健集团	8,400	57,876.00	0.17
98	600392	盛和资源	2,500	56,500.00	0.16
99	603267	鸿远电子	400	53,732.00	0.16
100	002705	新宝股份	2,400	52,776.00	0.15
101	603613	国联股份	590	52,274.00	0.15

102	000921	海信家电	3,600	51,048.00	0.15
103	688598	金博股份	172	50,688.40	0.15
104	688696	极米科技	163	50,182.81	0.15
105	002812	恩捷股份	200	50,090.00	0.15
106	000898	鞍钢股份	15,400	49,588.00	0.14
107	000885	城发环境	5,200	48,360.00	0.14
108	000567	海德股份	3,195	47,286.00	0.14
109	603506	南都物业	3,300	46,068.00	0.13
110	002003	伟星股份	4,690	44,555.00	0.13
111	600690	海尔智家	1,600	43,936.00	0.13
112	002643	万润股份	2,100	43,806.00	0.13
113	300428	立中集团	1,300	42,965.00	0.13
114	605123	派克新材	300	42,216.00	0.12
115	000975	银泰黄金	4,300	41,882.00	0.12
116	002384	东山精密	1,800	41,274.00	0.12
117	688556	高测股份	507	40,914.90	0.12
118	000733	振华科技	300	40,791.00	0.12
119	002649	博彦科技	3,900	39,819.00	0.12
120	605117	德业股份	140	39,184.60	0.11
121	603444	吉比特	100	38,800.00	0.11
122	688356	键凯科技	160	38,689.60	0.11
123	605398	新炬网络	1,100	38,599.00	0.11
124	002049	紫光国微	200	37,944.00	0.11
125	002182	云海金属	1,500	37,620.00	0.11
126	000875	吉电股份	5,400	37,530.00	0.11
127	000799	酒鬼酒	200	37,162.00	0.11
128	300661	圣邦股份	200	36,404.00	0.11
129	002415	海康威视	1,000	36,200.00	0.11
130	000001	平安银行	2,400	35,952.00	0.10
131	600839	四川长虹	12,400	35,712.00	0.10
132	300260	新莱应材	700	35,609.00	0.10



133	002301	齐心集团	5,300	34,980.00	0.10
134	605499	东鹏饮料	200	34,172.00	0.10
135	002179	中航光电	520	32,926.40	0.10
136	300037	新宙邦	620	32,587.20	0.09
137	000625	长安汽车	1,880	32,561.60	0.09
138	688368	晶丰明源	200	31,972.00	0.09
139	300763	锦浪科技	150	31,950.00	0.09
140	002396	星网锐捷	1,400	31,696.00	0.09
141	300696	爱乐达	720	31,644.00	0.09
142	600968	海油发展	12,200	31,476.00	0.09
143	002368	太极股份	1,600	30,736.00	0.09
144	600976	健民集团	600	30,690.00	0.09
145	300573	兴齐眼药	200	30,664.00	0.09
146	603018	华设集团	3,200	30,560.00	0.09
147	002920	德赛西威	200	29,600.00	0.09
148	600132	重庆啤酒	200	29,320.00	0.09
149	300841	康华生物	250	28,860.00	0.08
150	603986	兆易创新	200	28,442.00	0.08
151	300332	天壕环境	2,500	28,000.00	0.08
152	601009	南京银行	2,600	27,092.00	0.08
153	688037	芯源微	185	26,819.45	0.08
154	300601	康泰生物	580	26,204.40	0.08
155	300496	中科创达	200	26,096.00	0.08
156	300457	赢合科技	900	25,569.00	0.07
157	002216	三全食品	1,300	25,467.00	0.07
158	600970	中材国际	2,600	25,194.00	0.07
159	002101	广东鸿图	1,100	25,080.00	0.07
160	603799	华友钴业	260	24,861.20	0.07
161	300571	平治信息	600	24,780.00	0.07
162	603882	金城医学	300	24,765.00	0.07
163	688131	皓元医药	168	23,871.12	0.07

164	600380	健康元	1,900	23,465.00	0.07
165	000519	中兵红箭	800	23,320.00	0.07
166	601888	中国中免	100	23,293.00	0.07
167	600480	凌云股份	2,600	23,114.00	0.07
168	603392	万泰生物	145	22,518.50	0.07
169	600060	海信视像	1,800	22,500.00	0.07
170	300231	银信科技	2,900	21,953.00	0.06
171	688008	澜起科技	360	21,808.80	0.06
172	002961	瑞达期货	1,200	21,648.00	0.06
173	300782	卓胜微	160	21,600.00	0.06
174	603866	桃李面包	1,300	21,515.00	0.06
175	603186	华正新材	800	21,504.00	0.06
176	688550	瑞联新材	311	21,331.49	0.06
177	603896	寿仙谷	550	21,329.00	0.06
178	300223	北京君正	200	21,250.00	0.06
179	688388	嘉元科技	249	21,132.63	0.06
180	600460	士兰微	400	20,800.00	0.06
181	603259	药明康德	200	20,798.00	0.06
182	603456	九洲药业	400	20,680.00	0.06
183	600426	华鲁恒升	700	20,440.00	0.06
184	300171	东富龙	600	20,346.00	0.06
185	300316	晶盛机电	300	20,277.00	0.06
186	605089	味知香	300	20,253.00	0.06
187	000858	五粮液	100	20,193.00	0.06
188	600348	华阳股份	1,300	20,098.00	0.06
189	603890	春秋电子	2,000	19,720.00	0.06
190	300835	龙磁科技	510	19,466.70	0.06
191	603489	八方股份	100	19,449.00	0.06
192	600309	万华化学	200	19,398.00	0.06
193	002088	鲁阳节能	920	19,366.00	0.06
194	000848	承德露露	2,000	19,360.00	0.06

195	000725	京东方 A	4,900	19,306.00	0.06
196	300033	同花顺	200	19,230.00	0.06
197	002001	新 和 成	840	19,160.40	0.06
198	600967	内蒙一机	2,100	19,152.00	0.06
199	300244	迪安诊断	613	19,064.30	0.06
200	300759	康龙化成	200	19,044.00	0.06
201	600619	海立股份	2,800	18,984.00	0.06
202	002777	久远银海	1,320	18,981.60	0.06
203	603712	七一二	600	18,900.00	0.06
204	688298	东方生物	165	18,834.75	0.05
205	601601	中国太保	800	18,824.00	0.05
206	000099	中信海直	2,400	18,816.00	0.05
207	605266	健之佳	390	18,805.80	0.05
208	000709	河钢股份	8,300	18,758.00	0.05
209	300791	仙乐健康	600	18,732.00	0.05
210	603678	火炬电子	400	18,724.00	0.05
211	688016	心脉医疗	96	18,701.76	0.05
212	601012	隆基绿能	280	18,656.40	0.05
213	600929	雪天盐业	2,000	18,560.00	0.05
214	600297	广汇汽车	7,100	18,531.00	0.05
215	601890	亚星锚链	2,400	18,528.00	0.05
216	000521	长虹美菱	4,900	18,522.00	0.05
217	600489	中金黄金	2,500	18,475.00	0.05
218	002254	泰和新材	1,100	18,425.00	0.05
219	300748	金力永磁	500	18,400.00	0.05
220	300726	宏达电子	300	18,351.00	0.05
221	605090	九丰能源	900	18,243.00	0.05
222	000887	中鼎股份	1,000	18,240.00	0.05
223	002946	新乳业	1,400	18,186.00	0.05
224	300639	凯普生物	850	18,173.00	0.05
225	000708	中信特钢	900	18,135.00	0.05

226	002938	鹏鼎控股	600	18,126.00	0.05
227	000333	美的集团	300	18,117.00	0.05
228	002240	盛新锂能	300	18,108.00	0.05
229	688099	晶晨股份	179	18,079.00	0.05
230	300604	长川科技	400	18,060.00	0.05
231	002568	百润股份	600	18,024.00	0.05
232	000999	华润三九	400	18,000.00	0.05
233	002929	润建股份	500	17,950.00	0.05
234	600039	四川路桥	1,700	17,901.00	0.05
235	601985	中国核电	2,600	17,836.00	0.05
236	000778	新兴铸管	3,700	17,834.00	0.05
237	600104	上汽集团	1,000	17,810.00	0.05
238	300772	运达股份	700	17,808.00	0.05
239	300358	楚天科技	1,000	17,790.00	0.05
240	601319	中国人保	3,500	17,710.00	0.05
241	002262	恩华药业	1,300	17,680.00	0.05
242	002697	红旗连锁	3,500	17,675.00	0.05
243	600764	中国海防	700	17,668.00	0.05
244	002152	广电运通	1,900	17,613.00	0.05
245	688188	柏楚电子	80	17,603.20	0.05
246	600141	兴发集团	400	17,596.00	0.05
247	603738	泰晶科技	560	17,589.60	0.05
248	603589	口子窖	300	17,583.00	0.05
249	600885	宏发股份	420	17,577.00	0.05
250	300825	阿尔特	1,150	17,560.50	0.05
251	600516	方大炭素	2,300	17,480.00	0.05
251	300390	天华超净	200	17,480.00	0.05
253	601598	中国外运	4,500	17,460.00	0.05
253	000938	紫光股份	900	17,460.00	0.05
255	002645	华宏科技	800	17,456.00	0.05
256	600487	亨通光电	1,200	17,448.00	0.05

257	300833	浩洋股份	200	17,432.00	0.05
258	300219	鸿利智汇	2,000	17,400.00	0.05
259	000498	山东路桥	1,800	17,388.00	0.05
260	603236	移远通信	130	17,375.80	0.05
261	603517	绝味食品	300	17,346.00	0.05
261	601066	中信建投	600	17,346.00	0.05
263	002597	金禾实业	400	17,332.00	0.05
264	603501	DR韦尔股	100	17,303.00	0.05
265	300773	拉卡拉	900	17,154.00	0.05
266	002434	万里扬	2,000	17,100.00	0.05
267	600150	中国船舶	900	17,082.00	0.05
268	002557	洽洽食品	300	17,079.00	0.05
269	600116	三峡水利	1,700	17,068.00	0.05
270	603319	湘油泵	900	17,064.00	0.05
271	600745	闻泰科技	200	17,022.00	0.05
272	603305	旭升股份	560	16,923.20	0.05
273	002032	苏泊尔	300	16,902.00	0.05
274	600163	中闽能源	2,000	16,900.00	0.05
275	000404	长虹华意	3,100	16,895.00	0.05
276	002041	登海种业	800	16,872.00	0.05
277	000776	广发证券	900	16,830.00	0.05
278	300636	同和药业	700	16,800.00	0.05
279	603010	万盛股份	900	16,785.00	0.05
280	688389	普门科技	958	16,755.42	0.05
281	600803	新奥股份	900	16,731.00	0.05
281	000166	申万宏源	3,900	16,731.00	0.05
283	688202	美迪西	49	16,640.89	0.05
284	300620	光库科技	500	16,595.00	0.05
285	600888	新疆众和	1,800	16,560.00	0.05
286	300476	胜宏科技	900	16,524.00	0.05
287	000507	珠海港	2,600	16,510.00	0.05

288	000657	中钨高新	1,100	16,500.00	0.05
289	300378	鼎捷软件	1,000	16,470.00	0.05
290	002326	永太科技	500	16,465.00	0.05
291	002206	海利得	2,600	16,432.00	0.05
292	000729	燕京啤酒	1,700	16,422.00	0.05
293	688687	凯因科技	927	16,370.82	0.05
294	002410	广联达	300	16,332.00	0.05
295	600705	中航产融	4,700	16,262.00	0.05
296	002043	兔宝宝	1,400	16,240.00	0.05
297	600879	航天电子	2,500	16,225.00	0.05
298	600584	长电科技	600	16,200.00	0.05
299	601336	新华保险	500	16,095.00	0.05
300	002139	拓邦股份	1,300	15,951.00	0.05
301	002472	双环传动	500	15,920.00	0.05
302	603156	养元饮品	700	15,904.00	0.05
303	000977	浪潮信息	600	15,888.00	0.05
304	601577	长沙银行	2,000	15,860.00	0.05
305	600846	同济科技	2,000	15,800.00	0.05
306	603599	广信股份	560	15,764.00	0.05
307	600282	南钢股份	5,000	15,750.00	0.05
308	600837	海通证券	1,600	15,696.00	0.05
309	600756	浪潮软件	1,100	15,609.00	0.05
310	600887	伊利股份	400	15,580.00	0.05
311	000930	中粮科技	1,700	15,368.00	0.04
312	603855	华荣股份	600	15,300.00	0.04
313	601919	中远海控	1,100	15,290.00	0.04
314	600548	深高速	1,600	15,264.00	0.04
314	300613	富瀚微	180	15,264.00	0.04
316	601512	中新集团	1,700	15,249.00	0.04
317	300634	彩讯股份	1,200	15,240.00	0.04
318	002955	鸿合科技	700	15,239.00	0.04

319	300628	亿联网络	200	15,230.00	0.04
320	603588	高能环境	1,320	15,219.60	0.04
321	601211	国泰君安	1,000	15,200.00	0.04
322	002180	纳思达	300	15,186.00	0.04
323	688357	建龙微纳	135	15,179.40	0.04
324	603355	莱克电气	600	15,138.00	0.04
325	603043	广州酒家	600	15,132.00	0.04
326	002841	视源股份	200	15,064.00	0.04
327	601609	金田股份	2,000	15,020.00	0.04
328	002191	劲嘉股份	1,400	15,008.00	0.04
328	002111	威海广泰	1,600	15,008.00	0.04
330	003020	立方制药	510	15,004.20	0.04
331	600012	皖通高速	2,000	14,940.00	0.04
332	603728	鸣志电器	700	14,861.00	0.04
333	000883	湖北能源	2,900	14,819.00	0.04
334	601633	长城汽车	400	14,816.00	0.04
335	600007	中国国贸	1,000	14,750.00	0.04
336	002949	华阳国际	1,100	14,740.00	0.04
337	600552	凯盛科技	1,300	14,729.00	0.04
338	002957	科瑞技术	900	14,715.00	0.04
339	601699	潞安环能	1,000	14,620.00	0.04
340	300415	伊之密	800	14,584.00	0.04
341	300887	谱尼测试	340	14,521.40	0.04
342	003019	宸展光电	575	14,513.00	0.04
343	601881	中国银河	1,500	14,505.00	0.04
344	002988	豪美新材	900	14,463.00	0.04
345	688166	博瑞医药	598	14,441.70	0.04
346	603719	良品铺子	500	14,315.00	0.04
347	688278	特宝生物	479	14,120.92	0.04
348	301039	中集车辆	1,300	14,079.00	0.04
349	600057	厦门象屿	1,600	14,064.00	0.04

350	002601	龙佰集团	700	14,035.00	0.04
351	002732	燕塘乳业	700	14,028.00	0.04
352	002833	弘亚数控	840	14,011.20	0.04
353	000800	一汽解放	1,500	14,010.00	0.04
354	000039	中集集团	1,000	13,850.00	0.04
355	601398	工商银行	2,900	13,833.00	0.04
356	000807	云铝股份	1,400	13,832.00	0.04
357	601933	永辉超市	3,200	13,696.00	0.04
358	688001	华兴源创	502	13,664.44	0.04
359	600801	华新水泥	700	13,657.00	0.04
360	002020	京新药业	1,500	13,650.00	0.04
361	688360	德马科技	510	13,576.20	0.04
362	600710	苏美达	2,300	13,570.00	0.04
363	000877	天山股份	1,100	13,530.00	0.04
364	603901	永创智能	1,000	13,510.00	0.04
365	603365	水星家纺	900	13,482.00	0.04
366	603565	中谷物流	848	13,457.76	0.04
367	600867	通化东宝	1,300	13,442.00	0.04
368	000960	锡业股份	800	13,416.00	0.04
369	002736	国信证券	1,400	13,398.00	0.04
370	002014	永新股份	2,000	13,380.00	0.04
371	601702	华峰铝业	1,000	13,200.00	0.04
372	601117	中国化学	1,400	13,174.00	0.04
373	603233	大参林	420	13,146.00	0.04
374	688378	奥来德	332	12,951.32	0.04
375	002765	蓝黛科技	1,600	12,912.00	0.04
376	600765	中航重机	400	12,872.00	0.04
377	603995	甬金股份	380	12,790.80	0.04
378	688677	海泰新光	139	12,786.61	0.04
379	601688	华泰证券	900	12,780.00	0.04
380	688080	映翰通	317	12,708.53	0.04



381	601225	陕西煤业	600	12,708.00	0.04
382	603699	纽威股份	1,500	12,615.00	0.04
383	688299	长阳科技	688	12,556.00	0.04
384	000880	潍柴重机	1,200	12,552.00	0.04
385	002505	鹏都农牧	3,700	12,543.00	0.04
386	000425	徐工机械	2,300	12,397.00	0.04
387	688658	悦康药业	656	12,345.92	0.04
388	300087	荃银高科	750	12,345.00	0.04
389	600848	上海临港	900	12,204.00	0.04
390	600761	安徽合力	1,000	11,900.00	0.03
391	601952	苏垦农发	800	11,192.00	0.03
392	600330	天通股份	900	10,719.00	0.03
393	600295	鄂尔多斯	580	10,469.00	0.03
394	000933	神火股份	800	10,464.00	0.03
395	300662	科锐国际	200	10,378.00	0.03
396	300786	国林科技	720	10,008.00	0.03
397	688033	天宜上佳	453	9,621.72	0.03
398	300705	九典制药	280	6,109.60	0.02
399	300558	贝达药业	100	6,080.00	0.02
400	300693	盛弘股份	200	5,832.00	0.02
401	688036	传音控股	62	5,532.26	0.02
402	603100	川仪股份	300	5,292.00	0.02
403	002851	麦格米特	200	5,252.00	0.02
404	002236	大华股份	300	4,926.00	0.01
405	002027	分众传媒	700	4,711.00	0.01
406	600577	精达股份	800	4,440.00	0.01
407	300617	安靠智电	100	4,411.00	0.01
408	688139	海尔生物	60	4,369.80	0.01
409	002154	报喜鸟	1,000	4,320.00	0.01
410	300580	贝斯特	200	4,164.00	0.01
411	300788	中信出版	200	4,120.00	0.01

412	002745	木林森	400	3,908.00	0.01
413	600711	盛屯矿业	500	3,880.00	0.01
414	002798	帝欧家居	400	3,800.00	0.01
415	002967	广电计量	200	3,788.00	0.01
416	002614	奥佳华	400	3,464.00	0.01
417	600926	杭州银行	200	2,996.00	0.01
418	688050	爱博医疗	10	2,242.00	0.01
419	000050	深天马 A	100	997.00	0.00
420	603788	宁波高发	80	996.80	0.00
421	600475	华光环能	104	839.28	0.00
422	603639	海利尔	40	834.00	0.00
423	002839	张家港行	120	634.80	0.00
424	002402	和而泰	31	590.86	0.00
425	300218	安利股份	7	99.89	0.00
426	688122	西部超导	1	92.20	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601166	兴业银行	2,242,612.00	5.76
2	600219	南山铝业	1,676,179.00	4.31
3	002738	中矿资源	1,336,851.00	3.44
4	600976	健民集团	1,270,898.00	3.27
5	300059	东方财富	1,253,933.00	3.22
6	600285	羚锐制药	1,239,403.00	3.19
7	600919	江苏银行	1,209,925.00	3.11
8	600566	济川药业	1,205,782.00	3.10
9	601677	明泰铝业	1,194,942.00	3.07
10	600036	招商银行	1,175,531.00	3.02
11	601898	中煤能源	1,150,420.00	2.96

12	603300	华铁应急	1,133,149.00	2.91
13	603198	迎驾贡酒	1,125,286.00	2.89
14	600256	广汇能源	1,081,804.00	2.78
15	002497	雅化集团	1,031,314.00	2.65
16	600596	新安股份	1,001,544.00	2.57
17	688036	传音控股	996,049.75	2.56
18	600438	通威股份	995,791.00	2.56
19	688330	宏力达	993,425.89	2.55
20	688516	奥特维	989,277.60	2.54
21	600885	宏发股份	986,418.50	2.54
22	002709	天赐材料	978,077.00	2.51
23	600741	华域汽车	970,410.00	2.49
24	002241	歌尔股份	961,139.00	2.47
25	000906	浙商中拓	945,273.00	2.43
26	300709	精研科技	944,477.00	2.43
27	002929	润建股份	929,736.00	2.39
28	300775	三角防务	921,910.00	2.37
29	300593	新雷能	903,407.00	2.32
30	688005	容百科技	901,753.69	2.32
31	002254	泰和新材	893,379.00	2.30
32	002460	赣锋锂业	890,349.00	2.29
33	600116	三峡水利	868,192.00	2.23
34	300363	博腾股份	854,837.00	2.20
35	002262	恩华药业	854,288.00	2.20
36	603713	密尔克卫	850,949.00	2.19
37	601009	南京银行	837,069.00	2.15
38	600863	内蒙华电	819,980.00	2.11
39	600141	兴发集团	816,959.00	2.10
40	000039	中集集团	815,175.00	2.09
41	002876	三利谱	814,844.00	2.09
42	601598	中国外运	804,913.00	2.07

43	300138	晨光生物	804,778.00	2.07
44	002597	金禾实业	776,792.00	2.00

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

2、“买入金额”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。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	3,193,186.00	8.21
2	600219	南山铝业	1,948,269.00	5.01
3	600285	羚锐制药	1,419,008.00	3.65
4	002738	中矿资源	1,410,643.00	3.63
5	600256	广汇能源	1,373,758.00	3.53
6	600141	兴发集团	1,367,232.00	3.51
7	601166	兴业银行	1,271,304.00	3.27
8	600596	新安股份	1,263,033.00	3.25
9	002881	美格智能	1,236,347.00	3.18
10	603678	火炬电子	1,231,324.00	3.16
11	601211	国泰君安	1,192,528.00	3.06
12	601677	明泰铝业	1,175,591.00	3.02
13	600976	健民集团	1,172,178.00	3.01
14	601009	南京银行	1,159,078.00	2.98
15	603300	华铁应急	1,146,818.00	2.95
16	600116	三峡水利	1,127,107.00	2.90
17	600885	宏发股份	1,072,854.00	2.76
18	600566	济川药业	1,050,249.00	2.70
19	600809	山西汾酒	1,032,549.00	2.65
20	300593	新雷能	1,032,427.00	2.65
21	688516	奥特维	1,023,984.97	2.63

22	600030	中信证券	1,012,571.00	2.60
23	000568	泸州老窖	986,941.00	2.54
24	002876	三利谱	968,795.00	2.49
25	300775	三角防务	967,558.00	2.49
26	300390	天华超净	951,651.00	2.45
27	603589	口子窖	949,203.00	2.44
28	002497	雅化集团	944,788.00	2.43
29	688036	传音控股	914,897.85	2.35
30	002929	润建股份	909,832.00	2.34
31	600438	通威股份	884,144.00	2.27
32	300601	康泰生物	881,563.00	2.27
33	688005	容百科技	861,502.80	2.21
34	002597	金禾实业	860,055.00	2.21
35	300573	兴齐眼药	860,015.52	2.21
36	000906	浙商中拓	831,076.00	2.14
37	002254	泰和新材	811,994.00	2.09
38	600765	中航重机	810,356.00	2.08
39	002262	恩华药业	807,239.00	2.07
40	600926	杭州银行	798,349.00	2.05
41	000498	山东路桥	798,175.00	2.05
42	601598	中国外运	789,010.00	2.03
43	603986	兆易创新	788,742.00	2.03
44	603369	今世缘	784,723.00	2.02

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

2、“卖出金额”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。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	137,816,404.76
--------------	----------------

卖出股票收入（成交）总额	140,774,555.16
--------------	----------------

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

2、“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。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	1,830,314.15	5.33
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	1,830,314.15	5.33

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019666	22国债01	18,100	1,830,314.15	5.33
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 7.12 投资组合报告附注

##### 7.12.1

本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被中国证监会及其派出机构、证券交易所立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

##### 7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

##### 7.12.3 期末其他各项资产构成

本基金本报告期末无其他资产。

##### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

##### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 8 基金份额持有人信息

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
东兴宸瑞量化混合A	704	40,109.27	98,872.00	0.35%	28,138,057.31	99.65%
东兴宸瑞量化混合C	133	50,840.85	0.00	0.00%	6,761,833.61	100.00%
合计	837	41,814.53	98,872.00	0.28%	34,899,890.92	99.72%

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有 从业人员持有本 基金	东兴宸瑞量化混合A	10.72	0.00%
	东兴宸瑞量化混合C	0.00	0.00%
	合计	10.72	0.00%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本 开放式基金	东兴宸瑞量化混合A	0
	东兴宸瑞量化混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放 式基金	东兴宸瑞量化混合A	0
	东兴宸瑞量化混合C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	东兴宸瑞量化混合A	东兴宸瑞量化混合C
基金合同生效日 (2021年06月30日) 基金份额总额	133,154,981.55	103,718,238.96
本报告期期初基金份额总额	31,754,882.13	5,630,948.15



本报告期基金总申购份额	153,179.40	17,817,752.87
减：本报告期基金总赎回份额	3,671,132.22	16,686,867.41
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	28,236,929.31	6,761,833.61

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人督察长王微于2022年3月16日离任，同日起由董事长银国宏代任督察长。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未更换会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，基金托管人未受到对本行经营管理有重大影响的行政处罚。基金托管人高级管理人员无受处罚情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总	佣金	占当期佣金总量的	

			额的比例		比例	
长江证券股份有限公司	2	278,590,959.92	100.00%	226,844.39	100.00%	-

注：1、此处的佣金指本基金通过券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

## 2、交易单元的选择标准和程序

券商选择标准：财务状况良好、经营行为规范、研究实力较强的证券公司。其中财务状况良好、经营行为规范以最近一年证券公司分类评价在C类或C类以上，且近一年内无重大违法违规事件为主要判断依据。研究实力较强以公司的评价意见为主要判断依据。

券商选择程序：①对符合选择标准的券商的服务进行评价；②拟定租用对象：由投研部门根据以上评价结果拟定备选的券商；③签约：拟定备选的券商后，按公司签约程序与备选券商签约。签约时，要明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等。

## 3、本基金本报告期内未新增交易单元。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
长江证券股份有限公司	4,782,524.90	100.00%	27,900,000.00	100.00%	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东兴宸瑞量化混合型证券投资基金2021年第四季度报告	指定网站	2022-01-24
2	东兴基金管理有限公司行业高级管理人员变更公告	指定报刊、指定网站	2022-03-17
3	东兴宸瑞量化混合型证券投资基金2021年年度报告	指定网站	2022-03-31
4	东兴宸瑞量化混合型证券投资基金2022年第一季度报告	指定网站	2022-04-22

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 一、中国证监会核准东兴宸瑞量化混合型证券投资基金募集的文件
- 二、《东兴宸瑞量化混合型证券投资基金基金合同》
- 三、《东兴宸瑞量化混合型证券投资基金托管协议》
- 四、《东兴宸瑞量化混合型证券投资基金招募说明书》
- 五、中国证监会关于核准东兴证券股份有限公司公开募集证券投资基金管理业务资格的批复、营业执照、公司章程

### 12.2 存放地点

北京市西城区平安里西大街28号中海国际中心6层

### 12.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（[www.dxamc.cn](http://www.dxamc.cn)）查阅。

东兴基金管理有限公司  
二〇二二年八月三十一日