

# 东兴兴晟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	7
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	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	64
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	65
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	65
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	65
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	65
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	65
7.12 投资组合报告附注	65
§8 基金份额持有人信息	66
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	66
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	67
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	67

§9 开放式基金份额变动.....	67
§10 重大事件揭示.....	67
10.1 基金份额持有人大会决议.....	67
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.....	68
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	68
10.4 基金投资策略的改变.....	68
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	68
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.....	68
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	68
10.8 其他重大事件.....	69
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	69
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.....	69
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	70
§12 备查文件目录.....	70
12.1 备查文件目录.....	70
12.2 存放地点.....	70
12.3 查阅方式.....	70

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	东兴兴晟混合型证券投资基金	
基金简称	东兴兴晟混合	
基金主代码	009327	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年08月05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	44,720,690.03份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	东兴兴晟混合A	东兴兴晟混合C
下属分级基金的交易代码	009327	009328
报告期末下属分级基金的份额总额	37,349,072.29份	7,371,617.74份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置和投资管理，追求超越基金业绩比较基准的投资回报和基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将根据对宏观经济运行情况的预判和对市场运行情况的分析，来确定投资组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。 本基金根据经济运行周期变动、市场利率变化、市场估值、证券市场变化等因素以及基金的风险评估等灵活调整股票等权益类、债券等固定收益类和现金资产分布，动态调整各类资产在基金投资组合中的比例。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%
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，属于中高风险水平的投资品种。

### 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
信息披露负责人	姓名	银国宏	朱巍
	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	中国证券报
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)	
	东兴兴晟混合A	东兴兴晟混合C
本期已实现收益	-2,418,215.48	-977,976.91
本期利润	-1,061,212.52	-563,603.77
加权平均基金份额本期利润	-0.0327	-0.0688
本期加权平均净值利润率	-3.00%	-6.40%
本期基金份额净值增长率	-5.80%	-6.09%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022年06月30日)	
期末可供分配利润	5,356,609.39	962,801.90
期末可供分配基金份额利润	0.1434	0.1306
期末基金资产净值	42,796,439.27	8,350,606.01
期末基金份额净值	1.1459	1.1328
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	14.59%	13.28%

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

东兴兴晟混合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	8.34%	0.96%	5.60%	0.64%	2.74%	0.32%

过去三个月	5.84%	1.43%	3.96%	0.86%	1.88%	0.57%
过去六个月	-5.80%	1.36%	-5.21%	0.87%	-0.59%	0.49%
过去一年	5.11%	1.14%	-7.66%	0.75%	12.77%	0.39%
自基金合同生效起至今	14.59%	1.01%	-2.01%	0.73%	16.60%	0.28%

## 东兴兴晟混合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	8.28%	0.96%	5.60%	0.64%	2.68%	0.32%
过去三个月	5.67%	1.43%	3.96%	0.86%	1.71%	0.57%
过去六个月	-6.09%	1.36%	-5.21%	0.87%	-0.88%	0.49%
过去一年	4.47%	1.14%	-7.66%	0.75%	12.13%	0.39%
自基金合同生效起至今	13.28%	1.01%	-2.01%	0.73%	15.29%	0.28%

### 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

东兴兴晟混合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

(2020年08月05日-2022年06月30日)





东兴兴晟混合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  
(2020年08月05日-2022年06月30日)



- 注：1、本基金基金合同生效日为 2020 年 8 月 5 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；
- 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		
李晨辉先生	本基金基金经理	2020-08-05	-	10年	中国科学院工学硕士，武汉大学学士，具有10年证券从业经验。2011年进入东兴证券研究所从事行业研究，历任行业研究员、高级行业研究员。2014年2月加入东兴证券基金部筹备组，主要负责跟踪计算机、软件等行业投资机会。现任东兴蓝海财富灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东兴未来价值灵活配置混合型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。
李兵	本基金基	2020-	-	11年	中央财经大学金融学硕士，11年以上证券

伟先生	金经理	09-07			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遵规守信情况的说明

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《东兴兴晟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

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。

东兴兴晟在投资策略方面采用分散化投资和指数增强的理念，重点关注兼具估值和成长的公司，A股估值虽然有所修复，但从历史上看，目前的估值水平依然不高，具有较大投资价值。我们在投资策略方面依旧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-5.80%，业绩比较基准收益率为-5.21%，低于业绩比较基准0.59%；本基金C类份额净值增长率为-6.09%，业绩比较基准收益率为-5.21%，低于业绩比较基准0.88%。

#### 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二十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和基金资产净值连续六十个工作日低于五千万元的情况；截止本报告期末，本基金不存在基金资产净值低于五千万元的情况。

### § 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兴晟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：东兴兴晟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	1,416,280.34	10,185,559.30
结算备付金		509,406.19	644,960.47
存出保证金		32,901.09	56,870.30
交易性金融资产	6.4.7.2	43,478,276.56	58,536,031.02
其中：股票投资		40,836,961.33	47,442,421.52
基金投资		-	-
债券投资		2,641,315.23	11,093,609.50
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	6,000,882.74	12,000,000.00
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		182,912.40	1,716,679.09
应收股利		-	-
应收申购款		31,500.15	378.32
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	232,980.20
资产总计		51,652,159.47	83,373,458.70
<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		99,449.64	8,096,414.44
应付赎回款		196,825.59	15,425,351.16
应付管理人报酬		41,332.84	64,728.94
应付托管费		8,266.56	12,945.79
应付销售服务费		4,036.29	5,482.34
应付投资顾问费		-	-
应交税费		246.12	150.92
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	154,957.15	304,517.65
负债合计		505,114.19	23,909,591.24
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	44,720,690.03	48,946,705.51
其他综合收益		-	-

未分配利润	6.4.7.8	6,426,355.25	10,517,161.95
净资产合计		51,147,045.28	59,463,867.46
负债和净资产总计		51,652,159.47	83,373,458.70

注：报告截止日2022年6月30日，东兴兴晟混合A基金份额净值1.1459元，基金份额总额37,349,072.29份，东兴兴晟混合C基金份额净值1.1328元，基金份额总额7,371,617.74份。

## 6.2 利润表

会计主体：东兴兴晟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01月01日至 2021年06月30日
<b>一、营业总收入</b>		-1,289,591.76	16,327,673.98
1. 利息收入		31,733.78	479,740.10
其中：存款利息收入	6.4.7.9	7,935.05	32,595.87
债券利息收入		-	349,551.80
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		23,798.73	97,592.43
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-3,120,511.56	7,002,103.33
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-3,614,651.66	6,112,388.45
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	34,789.64	-164,920.08
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
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	459,350.46	1,054,634.96
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	1,771,376.10	8,628,932.75
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	27,809.92	216,897.80
<b>减：二、营业总支出</b>		335,224.53	2,525,317.05
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	219,286.04	872,784.05
2. 托管费	6.4.10.2.2	43,857.25	174,556.89
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	26,472.84	126,972.70
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		368.22	40.04
其中：卖出回购金融资产 支出		368.22	40.04
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		85.68	599.25
8. 其他费用	6.4.7.19	45,154.50	1,350,364.12
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		-1,624,816.29	13,802,356.93
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		-1,624,816.29	13,802,356.93
<b>五、其他综合收益的税后 净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-1,624,816.29	13,802,356.93

## 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：东兴兴晟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）	48,946,705.51	-	10,517,161.95	59,463,867.46
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）	48,946,705.51	-	10,517,161.95	59,463,867.46
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-4,226,015.48	-	-4,090,806.70	-8,316,822.18
（一）、综合收益总额	-	-	-1,624,816.29	-1,624,816.29
（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）	-4,226,015.48	-	-2,465,990.41	-6,692,005.89
其中：1. 基金申购款	21,380,204.76	-	508,182.38	21,888,387.14
2. 基金赎回款	-25,606,220.24	-	-2,974,172.79	-28,580,393.03
（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）	44,720,690.03	-	6,426,355.25	51,147,045.28
项目	上年度可比期间 2021年01月01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）	308,067,283.04	-	-860,199.53	307,207,083.51
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）	308,067,283.04	-	-860,199.53	307,207,083.51

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-199,825,328.76	-	10,454,971.22	-189,370,357.54
（一）、综合收益总额	-	-	13,802,356.93	13,802,356.93
（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）	-199,825,328.76	-	-3,347,385.71	-203,172,714.47
其中：1. 基金申购款	3,876,535.46	-	-3,506.67	3,873,028.79
2. 基金赎回款	-203,701,864.22	-	-3,343,879.04	-207,045,743.26
（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）	108,241,954.28	-	9,594,771.69	117,836,725.97

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

东兴兴晟混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据2020年3月17日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予东兴兴晟混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2020]455号）的批复，自2020年7月15日至2020年7月31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384,935,258.14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(20)第00353号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《东兴兴晟混合型证券投资基金基金合同》于2020年8月5日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为384,994,177.87份，其中认购资金利息折合58,919.73份。本基金基金管理人为东兴基金管理有限公司（本基金原基金管理人为东兴证券股份有限公司，自2021年5月24日起变更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《东兴兴晟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上市的股票）、国债、金融

债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、股指期货、货币市场工具、同业存单、资产支持证券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：本基金股票投资占基金资产的比例为35%-80%；本基金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，现金或者到期日在一年以内的政府债券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1.00%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0.60%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，本基金每年收益分配次数最多为12次，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	1,416,280.34
等于：本金	1,416,083.51
加：应计利息	196.83
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	1,416,280.34

## 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	37,606,236.02	-	40,836,961.33	3,230,725.31	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	2,613,671.10	25,397.23	2,641,315.23	2,246.90
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,613,671.10	25,397.23	2,641,315.23	2,246.90
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	

其他	-	-	-	-
合计	40,219,907.12	25,397.23	43,478,276.56	3,232,972.21

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	6,000,882.74	-
银行间市场	-	-
合计	6,000,882.74	-

##### 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	42.50
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	116,260.15
其中：交易所市场	116,260.15
银行间市场	-
应付利息	-

预提费用	38,654.50
合计	154,957.15

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 东兴兴晟混合A

金额单位：人民币元

项目 (东兴兴晟混合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	40,939,872.69	40,939,872.69
本期申购	15,154,169.19	15,154,169.19
本期赎回(以“-”号填列)	-18,744,969.59	-18,744,969.59
本期末	37,349,072.29	37,349,072.29

##### 6.4.7.7.2 东兴兴晟混合C

金额单位：人民币元

项目 (东兴兴晟混合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	8,006,832.82	8,006,832.82
本期申购	6,226,035.57	6,226,035.57
本期赎回(以“-”号填列)	-6,861,250.65	-6,861,250.65
本期末	7,371,617.74	7,371,617.74

#### 6.4.7.8 未分配利润

##### 6.4.7.8.1 东兴兴晟混合A

单位：人民币元

项目 (东兴兴晟混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	9,793,547.71	-928,231.08	8,865,316.63
本期利润	-2,418,215.48	1,357,002.96	-1,061,212.52

本期基金份额交易产生的变动数	-2,018,722.84	-338,014.29	-2,356,737.13
其中：基金申购款	2,329,774.41	-1,883,047.05	446,727.36
基金赎回款	-4,348,497.25	1,545,032.76	-2,803,464.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,356,609.39	90,757.59	5,447,366.98

## 6.4.7.8.2 东兴兴晟混合C

单位：人民币元

项目 (东兴兴晟混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	1,831,553.81	-179,708.49	1,651,845.32
本期利润	-977,976.91	414,373.14	-563,603.77
本期基金份额交易产生的变动数	109,225.00	-218,478.28	-109,253.28
其中：基金申购款	881,133.90	-819,678.88	61,455.02
基金赎回款	-771,908.90	601,200.60	-170,708.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	962,801.90	16,186.37	978,988.27

## 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	4,856.19
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	2,783.04
其他	295.82
合计	7,935.05

注：其他包括结算保证金利息收入。

## 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	138,826,031.21
减：卖出股票成本总额	142,082,925.24
减：交易费用	357,757.63
买卖股票差价收入	-3,614,651.66

## 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	55,485.24
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-20,695.60
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	34,789.64

## 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	17,967,120.13
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	17,500,106.20
减：应计利息总额	487,693.64
减：交易费用	15.89
买卖债券差价收入	-20,695.60

**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	459,350.46
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	459,350.46

**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	1,771,376.10
——股票投资	1,765,167.50
——债券投资	6,208.60
——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	1,771,376.10

#### 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	27,809.92
合计	27,809.92

#### 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	29,233.45
证券出借违约金	-
账户维护费	6,200.00
其他	300.00
合计	45,154.50

注：其他为银行间账户查询费。

#### 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**

金额单位：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01月01日至2021年06月30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
东兴证券股份有限公司	-	0.00%	907,182,146.54	100.00%

**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**

金额单位：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01月01日至2021年06月30 日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额	成交金额	占当期债券买卖成交总额

		额的比例		额的比例
东兴证券股份有限公司	-	0.00%	33,241,945.40	100.00%

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日	
	成交金额	占当期债券 回购成交总 额的比例	成交金额	占当期债券 回购成交总 额的比例
东兴证券股份有限公司	-	0.00%	720,700,000.00	100.00%

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30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
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30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
东兴证券股份有限公司	641,280.15	100.00%	227,959.55	100.00%

#### 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01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	219,286.04	872,784.05
其中：支付销售机构的客户维护费	97,855.93	166,858.37

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.00%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

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01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	43,857.25	174,556.89

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		
	东兴兴晟混合A	东兴兴晟混合C	合计
东兴证券股份有限公司	0.00	11,224.95	11,224.95
浙商银行股份有限公司	0.00	12,343.76	12,343.76

大连银行股份有限公司	0.00	164.39	164.39
合计	0.00	23,733.10	23,733.10
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东兴兴晟混合A	东兴兴晟混合C	合计
东兴证券股份有限公司	0.00	46,462.51	46,462.51
浙商银行股份有限公司	0.00	78,294.56	78,294.56
大连银行股份有限公司	0.00	404.37	404.37
合计	0.00	125,161.44	125,161.44

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0.60%的年费率计提。C类基金份额销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

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

东兴兴晟混合A

份额单位：份

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01月01日至 2021年06月30日
报告期初持有的基金份额	12,999,000.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	12,999,000.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

注：基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用按招募说明书中规定的费率收取。

##### 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		上年度可比期间	
	2022年01月01日至2022年06月30日		2021年01月01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	1,416,280.34	4,856.19	2,286,772.26	13,226.72

#### 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付息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不付息，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	1,416,083.51	-	-	-	-	196.83	1,416,280.34
结算备付金	509,177.09	-	-	-	-	229.10	509,406.19
存出保证金	32,886.29	-	-	-	-	14.80	32,901.09
交易性金融资产	-	-	2,615,918.00	-	-	40,862,358.56	43,478,276.56
买入返售金融资产	6,000,000.00	-	-	-	-	882.74	6,000,882.74
应收清算款	-	-	-	-	-	182,912.40	182,912.40
应收申购款	-	-	-	-	-	31,500.15	31,500.15
资产总计	7,958,146.89	-	2,615,918.00	-	-	41,078,094.58	51,652,159.47
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	99,449.64	99,449.64
应付赎回款	-	-	-	-	-	196,825.59	196,825.59
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	41,332.84	41,332.84
应付托管费	-	-	-	-	-	8,266.56	8,266.56
应付销售服务费	-	-	-	-	-	4,036.29	4,036.29
应交税费	-	-	-	-	-	246.12	246.12
其他负债	-	-	-	-	-	154,957.15	154,957.15
负债总计	-	-	-	-	-	505,114.19	505,114.19
利率敏感度缺口	7,958,146.89	-	2,615,918.00	-	-	40,572,980.39	51,147,045.28
上年度末 2021 年 12 月 31 日							
资产							
银行存款	10,185,559.30	-	-	-	-	-	10,185,559.30
结算备付金	644,960.47	-	-	-	-	-	644,960.47
存出保证金	56,870.30	-	-	-	-	-	56,870.30
交易性金融资产	5,004,000.60	6,089,608.90	-	-	-	47,442,421.52	58,536,031.02
买入返售金融资产	12,000,000.00	-	-	-	-	-	12,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,716,679.09	1,716,679.09
应收申购款	-	-	-	-	-	378.32	378.32
其他资产	-	-	-	-	-	232,980.20	232,980.20
资产总计	27,891,390.67	6,089,608.90	-	-	-	49,392,459.13	83,373,458.70
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	8,096,414.44	8,096,414.44
应付赎回款	-	-	-	-	-	15,425,351.16	15,425,351.16
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	64,728.94	64,728.94
应付托管费	-	-	-	-	-	12,945.79	12,945.79
应付销售服务费	-	-	-	-	-	5,482.34	5,482.34

应交税费	-	-	-	-	-	150.92	150.92
其他负债	-	-	-	-	-	304,517.65	304,517.65
负债总计	-	-	-	-	-	23,909,591.24	23,909,591.24
利率敏感度缺口	27,891,390.67	6,089,608.90	-	-	-	25,482,867.89	59,463,867.46

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		-3,491.50	-2,591.20
2、市场利率下降25个基点		3,500.85	2,592.56

#### 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 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	40,836,961.33	79.84	47,442,421.52	79.78
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	2,641,315.23	5.16	11,093,609.50	18.66
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	43,478,276.56	85.01	58,536,031.02	98.44

#### 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	40,836,961.33	46,665,917.75
第二层次	2,641,315.23	11,870,113.27
第三层次	-	-
合计	43,478,276.56	58,536,031.02

**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	40,836,961.33	79.06
	其中：股票	40,836,961.33	79.06
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,641,315.23	5.11
	其中：债券	2,641,315.23	5.11
	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	6,000,882.74	11.62
	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	1,925,686.53	3.73
8	其他各项资产	247,313.64	0.48
9	合计	51,652,159.47	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	23,199.00	0.05
B	采矿业	2,257,812.00	4.41
C	制造业	28,162,591.30	55.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	771,461.80	1.51
E	建筑业	1,306,567.40	2.55
F	批发和零售业	1,004,349.19	1.96
G	交通运输、仓储和邮政业	1,171,085.17	2.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,767,649.83	5.41
J	金融业	2,209,218.80	4.32
K	房地产业	513,781.02	1.00
L	租赁和商务服务业	181,724.80	0.36
M	科学研究和技术服务业	194,092.08	0.38
N	水利、环境和公共设施管理业	187,150.14	0.37
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	37,320.00	0.07
R	文化、体育和娱乐业	24,685.80	0.05
S	综合	24,273.00	0.05
	合计	40,836,961.33	79.84

## 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	600919	江苏银行	113,600	808,832.00	1.58
2	600438	通威股份	8,800	526,768.00	1.03
3	601898	中煤能源	48,500	503,430.00	0.98

4	300630	普利制药	14,100	495,615.00	0.97
5	600873	梅花生物	42,569	480,178.32	0.94
6	002709	天赐材料	7,700	477,862.00	0.93
7	002738	中矿资源	4,980	461,197.80	0.90
8	603050	科林电气	33,400	457,246.00	0.89
9	603198	迎驾贡酒	7,000	455,980.00	0.89
10	688589	力合微	10,158	455,281.56	0.89
11	601390	中国中铁	73,000	448,220.00	0.88
12	002332	仙琚制药	45,600	447,792.00	0.88
13	300363	博腾股份	5,700	444,543.00	0.87
14	603368	柳药集团	25,800	444,276.00	0.87
15	300453	三鑫医疗	44,100	438,354.00	0.86
16	002947	恒铭达	23,700	436,080.00	0.85
17	002728	特一药业	29,200	431,868.00	0.84
18	002768	国恩股份	16,800	431,424.00	0.84
19	603713	密尔克卫	3,100	423,770.00	0.83
20	688687	凯因科技	23,598	416,740.68	0.81
21	300666	江丰电子	6,800	414,800.00	0.81
22	688618	三旺通信	9,453	400,240.02	0.78
23	002850	科达利	2,500	397,500.00	0.78
24	000885	城发环境	40,200	373,860.00	0.73
25	300775	三角防务	7,600	365,940.00	0.72
26	605398	新炬网络	10,300	361,427.00	0.71
27	688521	芯原股份	7,293	360,274.20	0.70
28	000898	鞍钢股份	111,800	359,996.00	0.70
29	688278	特宝生物	12,172	358,830.56	0.70
30	688358	祥生医疗	9,994	357,685.26	0.70
31	002129	TCL中环	6,000	353,340.00	0.69
32	300777	中简科技	7,300	351,860.00	0.69
33	601615	明阳智能	10,200	344,760.00	0.67
34	600285	羚锐制药	27,300	342,069.00	0.67

35	300389	艾比森	32,700	339,753.00	0.66
36	003019	宸展光电	13,440	339,225.60	0.66
37	002649	博彦科技	32,800	334,888.00	0.65
38	000060	中金岭南	74,500	332,270.00	0.65
39	601456	国联证券	26,900	330,063.00	0.65
40	603506	南都物业	23,300	325,268.00	0.64
41	300218	安利股份	22,700	323,929.00	0.63
42	002955	鸿合科技	14,500	315,665.00	0.62
43	688360	德马科技	11,346	302,030.52	0.59
44	002039	黔源电力	19,840	291,052.80	0.57
45	300231	银信科技	38,200	289,174.00	0.57
46	003033	征和工业	10,400	278,720.00	0.54
47	603586	金麒麟	21,200	273,904.00	0.54
48	600929	雪天盐业	29,500	273,760.00	0.54
49	688636	智明达	2,383	270,208.37	0.53
50	688200	华峰测控	755	269,082.00	0.53
51	300566	激智科技	14,800	267,880.00	0.52
52	600123	兰花科创	16,000	263,200.00	0.51
53	600089	特变电工	9,600	262,944.00	0.51
54	003000	劲仔食品	29,100	258,990.00	0.51
55	002020	京新药业	28,460	258,986.00	0.51
56	601668	中国建筑	48,200	256,424.00	0.50
57	600863	内蒙华电	69,800	254,770.00	0.50
58	002241	歌尔股份	7,500	252,000.00	0.49
59	300514	友讯达	23,400	244,062.00	0.48
60	600188	兖矿能源	6,100	240,828.00	0.47
61	000906	浙商中拓	25,300	229,724.00	0.45
62	000778	新兴铸管	47,600	229,432.00	0.45
63	601872	招商轮船	38,900	224,064.00	0.44
64	002801	微光股份	7,450	222,382.50	0.43
65	600481	双良节能	13,000	219,050.00	0.43



66	600096	云天化	6,500	204,620.00	0.40
67	600846	同济科技	25,700	203,030.00	0.40
68	688456	有研粉材	8,018	194,115.78	0.38
69	600028	中国石化	46,300	188,904.00	0.37
70	600030	中信证券	8,670	187,792.20	0.37
71	688658	悦康药业	9,938	187,033.16	0.37
72	603613	国联股份	2,102	186,237.20	0.36
73	000830	鲁西化工	10,700	185,003.00	0.36
74	605123	派克新材	1,300	182,936.00	0.36
75	000968	蓝焰控股	17,400	181,830.00	0.36
76	002978	安宁股份	4,700	181,561.00	0.35
77	300820	英杰电气	2,800	180,740.00	0.35
78	002913	奥士康	5,600	177,240.00	0.35
79	600284	浦东建设	23,900	177,099.00	0.35
80	002276	万马股份	22,200	173,604.00	0.34
81	300593	新雷能	4,096	170,024.96	0.33
82	002484	江海股份	6,900	161,046.00	0.31
83	002988	豪美新材	10,000	160,700.00	0.31
84	603579	荣泰健康	6,500	160,225.00	0.31
85	002384	东山精密	6,900	158,217.00	0.31
86	300059	东方财富	6,140	155,956.00	0.30
87	600901	江苏租赁	29,700	152,361.00	0.30
88	000975	银泰黄金	15,300	149,022.00	0.29
89	603267	鸿远电子	1,100	147,763.00	0.29
90	300457	赢合科技	5,000	142,050.00	0.28
91	300696	爱乐达	3,220	141,519.00	0.28
92	300181	佐力药业	13,800	137,172.00	0.27
93	300476	胜宏科技	7,424	136,304.64	0.27
94	000733	振华科技	1,000	135,970.00	0.27
95	601677	明泰铝业	5,700	135,660.00	0.27
96	603600	永艺股份	14,700	134,652.00	0.26

97	688596	正帆科技	6,434	127,521.88	0.25
98	002216	三全食品	6,300	123,417.00	0.24
99	688239	航宇科技	2,305	122,856.50	0.24
100	300196	长海股份	6,500	122,785.00	0.24
101	603822	嘉澳环保	2,600	121,654.00	0.24
102	002961	瑞达期货	6,700	120,868.00	0.24
103	000090	天健集团	17,400	119,886.00	0.23
104	002237	恒邦股份	12,200	119,560.00	0.23
105	000989	九芝堂	13,100	119,210.00	0.23
106	688330	宏力达	1,385	119,096.15	0.23
107	300494	盛天网络	8,100	117,045.00	0.23
108	002777	久远银海	8,120	116,765.60	0.23
109	002821	凯莱英	400	115,600.00	0.23
110	002049	紫光国微	600	113,832.00	0.22
111	003020	立方制药	3,866	113,737.72	0.22
112	002825	纳尔股份	10,080	111,787.20	0.22
113	002985	北摩高科	1,900	111,302.00	0.22
114	688516	奥特维	403	107,580.85	0.21
115	300750	宁德时代	200	106,800.00	0.21
116	300769	德方纳米	260	106,256.80	0.21
117	688077	大地熊	1,193	100,581.83	0.20
118	002452	长高电新	14,500	94,105.00	0.18
119	600600	青岛啤酒	900	93,528.00	0.18
120	603300	华铁应急	11,440	91,176.80	0.18
121	002182	云海金属	3,600	90,288.00	0.18
122	603825	华扬联众	5,200	89,596.00	0.18
123	601166	兴业银行	4,500	89,550.00	0.18
124	601666	平煤股份	6,500	88,335.00	0.17
124	600639	浦东金桥	6,500	88,335.00	0.17
126	600761	安徽合力	7,400	88,060.00	0.17
127	600968	海油发展	33,800	87,204.00	0.17

128	000552	靖远煤电	19,800	85,338.00	0.17
129	002876	三利谱	2,100	84,042.00	0.16
130	300709	精研科技	2,840	84,035.60	0.16
131	603896	寿仙谷	2,150	83,377.00	0.16
132	601609	金田股份	11,100	83,361.00	0.16
133	688556	高测股份	1,029	83,040.30	0.16
134	300772	运达股份	3,220	81,916.80	0.16
135	002180	纳思达	1,600	80,992.00	0.16
136	603416	信捷电气	1,900	78,166.00	0.15
137	688202	美迪西	228	77,431.08	0.15
138	002179	中航光电	1,220	77,250.40	0.15
139	300121	阳谷华泰	7,100	76,183.00	0.15
140	000567	海德股份	5,130	75,924.00	0.15
141	600380	健康元	6,100	75,335.00	0.15
142	603699	纽威股份	8,900	74,849.00	0.15
143	002460	赣锋锂业	500	74,350.00	0.15
144	000888	峨眉山 A	8,000	73,360.00	0.14
145	300138	晨光生物	4,700	73,179.00	0.14
146	688005	容百科技	547	70,803.68	0.14
147	601838	成都银行	4,200	69,636.00	0.14
148	603898	好莱客	6,600	68,112.00	0.13
149	600971	恒源煤电	8,600	67,940.00	0.13
150	600908	无锡银行	11,700	65,871.00	0.13
151	002648	卫星化学	2,543	65,736.55	0.13
152	300354	东华测试	2,000	64,300.00	0.13
153	600886	国投电力	5,800	60,900.00	0.12
154	300797	钢研纳克	4,400	59,928.00	0.12
155	603489	八方股份	300	58,347.00	0.11
156	603995	甬金股份	1,685	56,717.10	0.11
157	002549	凯美特气	3,100	56,110.00	0.11
158	300861	美畅股份	600	55,614.00	0.11

159	002833	弘亚数控	3,316	55,310.88	0.11
160	300661	圣邦股份	300	54,606.00	0.11
161	605088	冠盛股份	4,000	53,920.00	0.11
162	601137	博威合金	3,000	53,100.00	0.10
163	002301	齐心集团	7,900	52,140.00	0.10
164	603456	九洲药业	1,000	51,700.00	0.10
165	002225	濮耐股份	12,533	50,257.33	0.10
166	603365	水星家纺	3,300	49,434.00	0.10
167	002236	大华股份	3,000	49,260.00	0.10
168	002025	航天电器	700	48,874.00	0.10
169	600219	南山铝业	13,200	48,708.00	0.10
170	002415	海康威视	1,300	47,060.00	0.09
171	000629	攀钢钒钛	12,300	46,740.00	0.09
172	300841	康华生物	400	46,176.00	0.09
173	002841	视源股份	600	45,192.00	0.09
174	002133	广宇集团	11,700	42,471.00	0.08
175	300770	新媒股份	1,100	41,613.00	0.08
176	002203	海亮股份	3,600	41,580.00	0.08
177	000099	中信海直	5,300	41,552.00	0.08
178	600557	康缘药业	2,800	41,132.00	0.08
179	002459	晶澳科技	500	39,450.00	0.08
180	300332	天壕环境	3,500	39,200.00	0.08
181	603444	吉比特	100	38,800.00	0.08
182	002054	德美化工	4,700	37,788.00	0.07
183	300244	迪安诊断	1,200	37,320.00	0.07
184	603986	兆易创新	260	36,974.60	0.07
185	002315	焦点科技	2,600	36,452.00	0.07
186	300219	鸿利智汇	4,100	35,670.00	0.07
187	002938	鹏鼎控股	1,100	33,231.00	0.06
188	002014	永新股份	4,900	32,781.00	0.06
189	300660	江苏雷利	900	32,733.00	0.06

190	600809	山西汾酒	100	32,480.00	0.06
191	000519	中兵红箭	1,100	32,065.00	0.06
192	300223	北京君正	300	31,875.00	0.06
193	600436	片仔癀	87	31,035.51	0.06
194	600348	华阳股份	2,000	30,920.00	0.06
195	600967	内蒙一机	3,300	30,096.00	0.06
196	688499	利元亨	135	29,875.50	0.06
197	601225	陕西煤业	1,400	29,652.00	0.06
198	600801	华新水泥	1,500	29,265.00	0.06
199	002643	万润股份	1,400	29,204.00	0.06
200	605376	博迁新材	500	29,150.00	0.06
201	603388	元成股份	3,800	29,108.00	0.06
202	688595	芯海科技	498	28,794.36	0.06
203	002929	润建股份	800	28,720.00	0.06
204	002286	保龄宝	2,500	28,625.00	0.06
205	688356	键凯科技	118	28,533.58	0.06
206	688016	心脉医疗	146	28,442.26	0.06
207	300037	新宙邦	540	28,382.40	0.06
208	600419	天润乳业	2,100	28,308.00	0.06
209	300656	民德电子	800	28,184.00	0.06
210	000709	河钢股份	12,100	27,346.00	0.05
211	603936	博敏电子	2,000	27,240.00	0.05
212	002396	星网锐捷	1,200	27,168.00	0.05
213	000875	吉电股份	3,900	27,105.00	0.05
214	600584	长电科技	1,000	27,000.00	0.05
215	603682	锦和商管	4,600	26,358.00	0.05
216	603067	振华股份	2,100	26,313.00	0.05
217	600426	华鲁恒升	900	26,280.00	0.05
217	300695	兆丰股份	500	26,280.00	0.05
219	603496	恒为科技	2,200	26,224.00	0.05
220	300390	天华超净	300	26,220.00	0.05

221	603037	凯众股份	1,500	26,175.00	0.05
222	688668	鼎通科技	372	26,166.48	0.05
223	600970	中材国际	2,700	26,163.00	0.05
224	300568	星源材质	900	26,136.00	0.05
225	688389	普门科技	1,490	26,060.10	0.05
226	002732	燕塘乳业	1,300	26,052.00	0.05
227	603003	龙宇燃油	3,500	26,040.00	0.05
228	300401	花园生物	1,500	26,010.00	0.05
229	300835	龙磁科技	680	25,955.60	0.05
230	300481	濮阳惠成	1,100	25,850.00	0.05
231	603738	泰晶科技	820	25,756.20	0.05
232	688662	富信科技	626	25,697.30	0.05
233	688500	慧辰股份	1,154	25,676.50	0.05
234	300539	横河精密	2,800	25,648.00	0.05
235	603369	今世缘	500	25,500.00	0.05
236	300260	新莱应材	500	25,435.00	0.05
237	000507	珠海港	4,000	25,400.00	0.05
238	603305	旭升股份	840	25,384.80	0.05
239	600036	招商银行	600	25,320.00	0.05
240	603040	新坐标	1,350	25,312.50	0.05
241	000930	中粮科技	2,800	25,312.00	0.05
242	600879	航天电子	3,900	25,311.00	0.05
243	601881	中国银河	2,600	25,142.00	0.05
244	601702	华峰铝业	1,900	25,080.00	0.05
244	002101	广东鸿图	1,100	25,080.00	0.05
246	605266	健之佳	520	25,074.40	0.05
247	002062	宏润建设	3,600	24,984.00	0.05
248	000166	申万宏源	5,800	24,882.00	0.05
249	603161	科华控股	2,200	24,772.00	0.05
250	000625	长安汽车	1,430	24,767.60	0.05
251	002003	伟星股份	2,600	24,700.00	0.05

252	600012	皖通高速	3,300	24,651.00	0.05
253	603890	春秋电子	2,500	24,650.00	0.05
254	603319	湘油泵	1,300	24,648.00	0.05
255	002327	富安娜	3,100	24,645.00	0.05
256	002365	永安药业	2,000	24,640.00	0.05
257	002556	辉隆股份	2,100	24,570.00	0.05
258	688195	腾景科技	885	24,532.20	0.05
259	300440	运达科技	3,700	24,531.00	0.05
260	600163	中闽能源	2,900	24,505.00	0.05
261	601717	郑煤机	1,700	24,497.00	0.05
262	300726	宏达电子	400	24,468.00	0.05
263	300286	安科瑞	900	24,435.00	0.05
264	688590	新致软件	1,705	24,432.65	0.05
265	000723	美锦能源	2,000	24,400.00	0.05
266	002953	日丰股份	1,430	24,367.20	0.05
267	002128	电投能源	1,700	24,344.00	0.05
268	600673	东阳光	2,700	24,273.00	0.05
269	600596	新安股份	1,120	24,248.00	0.05
270	603878	武进不锈	3,800	24,244.00	0.05
271	002880	卫光生物	920	24,214.40	0.05
272	688314	康拓医疗	496	24,080.80	0.05
273	605006	山东玻纤	2,100	24,045.00	0.05
274	603926	铁流股份	2,340	24,031.80	0.05
275	603068	博通集成	600	23,982.00	0.05
276	688312	燕麦科技	1,357	23,951.05	0.05
277	300474	景嘉微	350	23,936.50	0.05
278	688004	博汇科技	963	23,843.88	0.05
279	300915	海融科技	500	23,710.00	0.05
280	002436	兴森科技	2,100	23,667.00	0.05
281	603889	新澳股份	3,740	23,636.80	0.05
282	002441	众业达	2,500	23,550.00	0.05

283	300699	光威复材	400	23,548.00	0.05
284	688368	晶丰明源	147	23,499.42	0.05
285	600885	宏发股份	560	23,436.00	0.05
286	000419	通程控股	4,300	23,435.00	0.05
287	603678	火炬电子	500	23,405.00	0.05
288	002206	海利得	3,700	23,384.00	0.05
289	600887	伊利股份	600	23,370.00	0.05
290	600177	雅戈尔	3,500	23,205.00	0.05
291	002041	登海种业	1,100	23,199.00	0.05
292	601001	晋控煤业	1,300	23,075.00	0.05
293	002326	永太科技	700	23,051.00	0.05
294	300773	拉卡拉	1,200	22,872.00	0.04
295	600057	厦门象屿	2,600	22,854.00	0.04
296	600150	中国船舶	1,200	22,776.00	0.04
297	600808	马钢股份	6,000	22,740.00	0.04
298	600764	中国海防	900	22,716.00	0.04
299	688018	乐鑫科技	202	22,704.80	0.04
300	002687	乔治白	5,075	22,685.25	0.04
301	601138	工业富联	2,300	22,632.00	0.04
302	603392	万泰生物	145	22,518.50	0.04
303	000959	首钢股份	4,700	22,372.00	0.04
304	603663	三祥新材	1,000	22,340.00	0.04
305	002697	红旗连锁	4,400	22,220.00	0.04
306	600153	建发股份	1,700	22,219.00	0.04
307	603115	海星股份	900	22,113.00	0.04
308	300748	金力永磁	600	22,080.00	0.04
309	603712	七一二	700	22,050.00	0.04
310	600064	南京高科	2,000	22,000.00	0.04
311	600141	兴发集团	500	21,995.00	0.04
312	000880	潍柴重机	2,100	21,966.00	0.04
313	688560	明冠新材	640	21,913.60	0.04



314	002410	广联达	400	21,776.00	0.04
315	002254	泰和新材	1,300	21,775.00	0.04
316	603359	东珠生态	1,800	21,744.00	0.04
317	002156	通富微电	1,400	21,560.00	0.04
318	002576	通达动力	1,600	21,520.00	0.04
319	000156	华数传媒	2,700	21,519.00	0.04
320	002949	华阳国际	1,600	21,440.00	0.04
321	300681	英搏尔	370	21,374.90	0.04
322	603585	苏利股份	1,100	21,373.00	0.04
323	002960	青鸟消防	780	21,364.20	0.04
324	603010	万盛股份	1,140	21,261.00	0.04
325	002001	新和成	932	21,258.92	0.04
326	002957	科瑞技术	1,300	21,255.00	0.04
327	000729	燕京啤酒	2,200	21,252.00	0.04
327	000498	山东路桥	2,200	21,252.00	0.04
329	600765	中航重机	660	21,238.80	0.04
330	300639	凯普生物	992	21,208.96	0.04
331	688628	优利德	720	21,160.80	0.04
332	002790	瑞尔特	2,700	21,141.00	0.04
333	300703	创源股份	2,300	21,114.00	0.04
334	600116	三峡水利	2,100	21,084.00	0.04
335	603018	华设集团	2,200	21,010.00	0.04
336	603006	联明股份	2,300	20,953.00	0.04
337	002443	金洲管道	2,500	20,900.00	0.04
338	002043	兔宝宝	1,800	20,880.00	0.04
339	601518	吉林高速	7,800	20,826.00	0.04
340	000869	张裕A	700	20,818.00	0.04
341	300280	紫天科技	900	20,727.00	0.04
342	600073	上海梅林	2,600	20,722.00	0.04
343	003005	竞业达	800	20,680.00	0.04
343	000823	超声电子	2,000	20,680.00	0.04

345	000915	华特达因	500	20,675.00	0.04
346	600415	小商品城	3,700	20,609.00	0.04
347	002863	今飞凯达	3,800	20,596.00	0.04
348	601899	紫金矿业	2,200	20,526.00	0.04
349	002478	常宝股份	4,500	20,520.00	0.04
350	000895	双汇发展	700	20,510.00	0.04
351	601699	潞安环能	1,400	20,468.00	0.04
352	600976	健民集团	400	20,460.00	0.04
353	600705	中航产融	5,900	20,414.00	0.04
354	603386	骏亚科技	1,300	20,397.00	0.04
355	000603	盛达资源	1,800	20,304.00	0.04
356	603192	汇得科技	800	20,256.00	0.04
357	600295	鄂尔多斯	1,120	20,216.00	0.04
358	300232	洲明科技	3,100	20,212.00	0.04
359	603203	快克股份	780	19,968.00	0.04
360	600888	新疆众和	2,160	19,872.00	0.04
361	300305	裕兴股份	1,400	19,852.00	0.04
362	603599	广信股份	700	19,705.00	0.04
363	002842	翔鹭钨业	2,300	19,642.00	0.04
364	300548	博创科技	1,100	19,602.00	0.04
365	002497	雅化集团	600	19,590.00	0.04
366	688513	苑东生物	394	19,510.88	0.04
367	000657	中钨高新	1,300	19,500.00	0.04
368	600926	杭州银行	1,300	19,474.00	0.04
369	603380	易德龙	500	19,450.00	0.04
370	601890	亚星锚链	2,500	19,300.00	0.04
371	605077	华康股份	871	19,205.55	0.04
372	000100	TCL科技	4,000	19,160.00	0.04
373	603128	华贸物流	1,900	19,057.00	0.04
374	002262	恩华药业	1,400	19,040.00	0.04
375	600566	济川药业	700	19,012.00	0.04

376	002088	鲁阳节能	900	18,945.00	0.04
377	603043	广州酒家	740	18,662.80	0.04
378	601985	中国核电	2,700	18,522.00	0.04
379	000960	锡业股份	1,100	18,447.00	0.04
380	600162	香江控股	8,600	18,404.00	0.04
381	600741	华域汽车	800	18,400.00	0.04
382	688181	八亿时空	422	18,272.60	0.04
383	300415	伊之密	1,000	18,230.00	0.04
384	300532	今天国际	1,400	17,976.00	0.04
385	600256	广汇能源	1,700	17,918.00	0.04
386	603855	华荣股份	700	17,850.00	0.03
387	688028	沃尔德	529	17,827.30	0.03
388	000932	华菱钢铁	3,500	17,815.00	0.03
389	002765	蓝黛科技	2,200	17,754.00	0.03
390	000800	一汽解放	1,900	17,746.00	0.03
391	688092	爱科科技	688	17,722.88	0.03
392	002832	比音勒芬	700	17,640.00	0.03
393	600867	通化东宝	1,700	17,578.00	0.03
394	600979	广安爱众	5,400	17,334.00	0.03
395	300789	唐源电气	858	17,305.86	0.03
396	002736	国信证券	1,800	17,226.00	0.03
397	300636	同和药业	712	17,088.00	0.03
398	600489	中金黄金	2,300	16,997.00	0.03
399	300785	值得买	650	16,991.00	0.03
400	600461	洪城环境	2,100	16,989.00	0.03
401	002345	潮宏基	3,700	16,983.00	0.03
402	688656	浩欧博	434	16,982.42	0.03
403	603918	金桥信息	2,000	16,840.00	0.03
404	688659	元琛科技	1,777	16,828.19	0.03
405	601009	南京银行	1,600	16,672.00	0.03
406	000039	中集集团	1,200	16,620.00	0.03

407	600548	深高速	1,700	16,218.00	0.03
408	603590	康辰药业	600	16,068.00	0.03
409	600985	淮北矿业	1,100	16,016.00	0.03
410	688080	映翰通	395	15,835.55	0.03
411	000933	神火股份	1,200	15,696.00	0.03
412	000949	新乡化纤	4,300	15,652.00	0.03
413	000803	北清环能	1,000	15,640.00	0.03
414	600546	山煤国际	800	15,568.00	0.03
415	300573	兴齐眼药	100	15,332.00	0.03
416	603588	高能环境	1,320	15,219.60	0.03
417	300786	国林科技	1,080	15,012.00	0.03
418	688378	奥来德	382	14,901.82	0.03
419	688508	芯朋微	198	14,751.00	0.03
420	688550	瑞联新材	212	14,541.08	0.03
421	300721	怡达股份	400	14,428.00	0.03
422	300759	康龙化成	150	14,283.00	0.03
423	300316	晶盛机电	200	13,518.00	0.03
424	601996	丰林集团	4,500	13,320.00	0.03
425	300587	天铁股份	619	12,646.17	0.02
426	603966	法兰泰克	1,180	12,508.00	0.02
427	002111	威海广泰	1,280	12,006.40	0.02
428	688298	东方生物	104	11,871.60	0.02
429	688598	金博股份	39	11,493.30	0.02
430	300953	震裕科技	81	11,096.19	0.02
431	300997	欢乐家	823	10,995.28	0.02
432	603639	海利尔	520	10,842.00	0.02
433	688099	晶晨股份	106	10,706.00	0.02
434	300327	中颖电子	209	10,410.29	0.02
435	300747	锐科激光	250	9,725.00	0.02
436	600622	光大嘉宝	2,692	9,448.92	0.02
437	300993	玉马遮阳	714	9,124.92	0.02

438	300806	斯迪克	320	9,084.80	0.02
439	300482	万孚生物	220	8,956.20	0.02
440	600176	中国巨石	489	8,513.49	0.02
441	300642	透景生命	360	8,164.80	0.02
442	000951	中国重汽	620	8,053.80	0.02
443	603883	老百姓	234	7,927.92	0.02
444	600692	亚通股份	1,231	7,509.10	0.01
445	002873	新天药业	440	7,484.40	0.01
446	301010	晶雪节能	272	6,895.20	0.01
447	300992	泰福泵业	298	6,350.38	0.01
448	002028	思源电气	170	6,062.20	0.01
449	300625	三雄极光	500	6,010.00	0.01
450	688118	普元信息	352	5,871.36	0.01
451	603939	益丰药房	105	5,547.15	0.01
452	601388	怡球资源	1,500	5,250.00	0.01
453	688156	路德环境	238	5,076.54	0.01
454	301007	德迈仕	322	4,852.54	0.01
455	603985	恒润股份	169	4,755.66	0.01
456	300995	奇德新材	209	4,472.60	0.01
457	601211	国泰君安	200	3,040.00	0.01
458	603385	惠达卫浴	400	3,028.00	0.01
459	000425	徐工机械	500	2,695.00	0.01
460	002335	科华数据	80	2,468.00	0.00
461	000719	中原传媒	300	2,235.00	0.00
462	300101	振芯科技	76	1,568.64	0.00
463	000990	诚志股份	100	1,095.00	0.00
464	603810	丰山集团	84	1,091.16	0.00
465	603056	德邦股份	69	926.67	0.00
466	300687	赛意信息	40	918.80	0.00
467	002184	海得控制	65	792.35	0.00
468	300737	科顺股份	60	790.80	0.00

469	603871	嘉友国际	45	760.50	0.00
470	603096	新经典	40	738.00	0.00
471	002886	沃特股份	30	681.00	0.00
472	002536	飞龙股份	100	662.00	0.00
473	002580	圣阳股份	60	504.60	0.00
474	600731	湖南海利	70	501.20	0.00
475	002763	汇洁股份	60	450.60	0.00
476	603118	共进股份	60	445.20	0.00
477	002498	汉缆股份	100	425.00	0.00
478	603955	大千生态	30	401.40	0.00
479	002228	合兴包装	100	362.00	0.00
480	002849	威星智能	29	345.97	0.00
481	600665	天地源	100	345.00	0.00
482	600390	五矿资本	40	195.60	0.00
483	600757	长江传媒	34	193.80	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	600919	江苏银行	993,972.00	1.67
2	002020	京新药业	929,280.00	1.56
3	601666	平煤股份	922,891.00	1.55
4	600030	中信证券	841,571.10	1.42
5	002988	豪美新材	816,440.00	1.37
6	003020	立方制药	805,536.80	1.35
7	002182	云海金属	804,575.00	1.35
8	002179	中航光电	798,921.00	1.34
9	603712	七一二	785,856.00	1.32
10	000906	浙商中拓	764,535.00	1.29
11	601390	中国中铁	762,404.00	1.28

12	002648	卫星化学	744,178.00	1.25
13	002332	仙琚制药	725,553.00	1.22
14	600089	特变电工	706,720.00	1.19
15	000778	新兴铸管	703,319.00	1.18
16	002129	TCL中环	702,907.00	1.18
17	688360	德马科技	698,945.31	1.18
18	600123	兰花科创	698,486.00	1.17
19	600188	兖矿能源	683,649.00	1.15
20	688658	悦康药业	682,911.20	1.15

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	002648	卫星化学	1,397,603.00	2.35
2	600219	南山铝业	1,195,236.00	2.01
3	002988	豪美新材	1,125,563.00	1.89
4	002839	张家港行	1,009,323.00	1.70
5	688556	高测股份	995,400.08	1.67
6	300696	爱乐达	964,060.00	1.62
7	300775	三角防务	940,596.02	1.58
8	601666	平煤股份	920,440.00	1.55
9	300593	新雷能	917,872.00	1.54
10	688005	容百科技	905,324.26	1.52
11	603369	今世缘	898,369.01	1.51
12	002254	泰和新材	891,329.00	1.50
13	300772	运达股份	859,306.00	1.45
14	605266	健之佳	847,805.00	1.43

15	300630	普利制药	846,086.00	1.42
16	002332	仙琚制药	843,699.00	1.42
17	600089	特变电工	839,480.00	1.41
18	600116	三峡水利	836,083.00	1.41
19	002876	三利谱	831,426.00	1.40
20	000629	攀钢钒钛	828,326.00	1.39

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	133,712,297.55
卖出股票收入（成交）总额	138,826,031.21

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	2,641,315.23	5.16
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	2,641,315.23	5.16

#### 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	26,120	2,641,315.23	5.16
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

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	32,901.09
2	应收清算款	182,912.40
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	31,500.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	247,313.64

## 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
东兴兴晟混合A	919	40,640.99	14,606,264.47	39.11%	22,742,807.82	60.89%
东兴兴晟混合C	390	18,901.58	50,261.10	0.68%	7,321,356.64	99.32%
合计	1,309	34,164.01	14,656,525.57	32.77%	30,064,164.46	67.23%

## 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	东兴兴晟混合A	9.21	0.00%
	东兴兴晟混合C	0.00	0.00%
	合计	9.21	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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	东兴兴晟混合A	0
	东兴兴晟混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	东兴兴晟混合A	0
	东兴兴晟混合C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	东兴兴晟混合A	东兴兴晟混合C
基金合同生效日(2020年08月05日)基金份额总额	281,613,922.92	103,380,254.95
本报告期期初基金份额总额	40,939,872.69	8,006,832.82
本报告期基金总申购份额	15,154,169.19	6,226,035.57
减：本报告期基金总赎回份额	18,744,969.59	6,861,250.65
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	37,349,072.29	7,371,617.74

## § 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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券股份有限公司	1	74,724,956.14	27.42%	54,646.91	27.90%	-
兴业证券股份有限公司	1	72,930,520.85	26.76%	52,381.14	26.75%	-
长江证券股份有限公司	2	124,882,851.77	45.82%	88,802.57	45.35%	-
东兴证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

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、本基金本报告期内新增租用2个交易单元，分别为兴业证券股份有限公司上海交易所交易单元和广发证券股份有限公司深圳交易所交易单元。

## 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
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	900,815.10	5.80%	143,800,000.00	85.59%	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	14,619,817.50	94.20%	24,217,000.00	14.41%	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东兴兴晟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	东兴兴晟混合型证券投资基金2021年年度报告	指定网站	2022-03-31
4	东兴兴晟混合型证券投资基金2022年第一季度报告	指定网站	2022-04-22
5	东兴兴晟混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	指定网站	2022-05-27
6	东兴兴晟混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2022年第1号）	指定网站	2022-05-27

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额

机构	1	2022年1月1日-2022年1月24日	12,999,000.00	-	12,999,000.00	0.00	0.00%
	2	2022年4月21日-2022年6月30日	-	14,606,096.02	-	14,606,096.02	32.66%
产品特有风险							
<p>1、本基金为混合型基金，基金资产主要投资于股票市场与债券市场，因此股市、债市的变化将影响到基金业绩表现。在调整资产配置比例时，不能完全抵御市场整体下跌风险，基金净值表现因此可能受到影响。本基金管理人将发挥专业研究优势，加强对市场、上市公司基本面和固定收益类产品的深入研究，持续优化组合配置，以控制特定风险。此外，由于本基金还可以投资其他品种，这些品种的价格也可能因市场中的各类变化而出现一定幅度的波动，产生特定的风险，并影响到整体基金的投资收益。</p> <p>2、本基金可投资股指期货，股指期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，指数微小的变动就可能使投资人权益遭受较大损失。股指期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来重大损失。</p> <p>3、本基金可投资于在全国银行间债券市场或证券交易所交易的资产支持证券，基金管理人将本着谨慎和控制风险的原则进行资产支持证券投资，但由于资产支持证券具有一定的信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿还风险等风险，可能导致包括基金净值波动在内的各项风险。</p>							

## 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兴晟混合型证券投资基金募集的文件
- 二、《东兴兴晟混合型证券投资基金基金合同》
- 三、《东兴兴晟混合型证券投资基金托管协议》
- 四、《东兴兴晟混合型证券投资基金招募说明书》
- 五、中国证监会颁发的经营证券期货业务许可证、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）查阅。

东兴基金管理有限公司  
二〇二二年八月三十一日