

# 兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金

2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人:兴银基金管理有限责任公司

基金托管人:平安银行股份有限公司

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

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年8月30日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年1月26日起至6月30日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产(基金净值)变动表	15
6.4 报表附注	16
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>43</b>
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股票投资明细	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	67
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	67
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	67
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	67
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	68
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	68
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	68
7.12 投资组合报告附注	68

<b>§ 8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>69</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	69
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	69
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 .....	69
<b>§ 9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>70</b>
<b>§ 10 重大事件揭示</b> .....	<b>70</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	70
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 .....	70
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	70
10.4 基金投资策略的改变 .....	71
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	71
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 .....	71
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	71
10.8 其他重大事件 .....	71
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>72</b>
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 .....	73
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	73
<b>§ 12 备查文件目录</b> .....	<b>73</b>
12.1 备查文件目录 .....	73
12.2 存放地点 .....	73
12.3 查阅方式 .....	73

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	兴银中证 1000 指数增强	
基金主代码	014831	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 01 月 26 日	
基金管理人	兴银基金管理有限责任公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	238,487,629.08 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	兴银中证 1000 指数增强 A	兴银中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	014831	014832
报告期末下属分级基金的份额总额	155,074,805.01 份	83,412,824.07 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型指数基金，在力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年化跟踪误差不超过 7.75%的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力求实现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	本基金为指数增强型股票基金，采取定量方法进行组合管理，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.75%的基础上，追求获得超越业绩比较基准的回报。本基金主要投资于中证 1000 指数的成份股及备选成份股，为了获得超越业绩比较基准的投资回报，可以在被动跟踪指数的基础上进行一些优化调整，如在一定幅度内减少或增强成份股的权重、替换或者增加一些非成份股。	
业绩比较基准	中证 1000 指数(000852)*95%+人民币活期存款利率（税后）*5%	
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其预期风险、收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数类似的风险收益特征。	
下属分级基金的风险收益特征	风险收益特征同上	风险收益特征同上

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	兴银基金管理有限责任公司	平安银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	赵建兴	李帅帅
	联系电话	86-21-20296318	0755-25878287
	电子邮箱	zjx@hffunds.cn	LISHUAI SHUAI130@pingan.com.cn
客户服务电话		40000-96326	95511-3
传真		86-21-68630069	0755-82080387
注册地址		平潭综合实验区金井湾商务营运中心 6 号楼 11 层 03-3 房	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址		中国上海市浦东新区滨江大道 5129 号陆家嘴滨江中心 N1 幢三层、五层	广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座 26 楼
邮政编码		200120	518001
法定代表人		张贵云	谢永林

## 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	www.hffunds.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	兴银基金管理有限责任公司	上海市浦东新区滨江大道 5129 号陆家嘴滨江中心 N1 幢三层、五层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 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 26 日（基金合同生效日）-2022 年 06 月 30 日）	
	兴银中证 1000 指数增强 A	兴银中证 1000 指数增强 C
本期已实现收益	-7,556,077.05	-5,650,403.05
本期利润	2,182,757.52	-1,484,542.11
加权平均基金份额本期利润	0.0132	-0.0168
本期加权平均净值利润率	1.40%	-1.78%
本期基金份额净值增长率	2.77%	2.69%
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	-5,652,766.39	-3,109,144.50

期末可供分配基金份额利润	-0.0365	-0.0373
期末基金资产净值	159,377,464.62	85,654,488.36
期末基金份额净值	1.0277	1.0269
<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	2.77%	2.69%

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。期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额），即如果期末未分配利润（报表数，下同）的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

#### 兴银中证 1000 指数增强 A 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	12.48%	1.43%	9.59%	1.24%	2.89%	0.19%
过去三个月	8.68%	1.87%	3.20%	1.95%	5.48%	-0.08%
自基金合同生效起至今	2.77%	1.62%	-1.74%	1.81%	4.51%	-0.19%

#### 兴银中证 1000 指数增强 C 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	12.46%	1.43%	9.59%	1.24%	2.87%	0.19%
过去三个月	8.63%	1.87%	3.20%	1.95%	5.43%	-0.08%
自基金合同生效起至今	2.69%	1.62%	-1.74%	1.81%	4.43%	-0.19%

注：1、本基金成立于 2022 年 1 月 26 日；2、比较基准：中证 1000 指数收益率\*95%+银行活期存款利率(税后)\*5%。

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2022年01月26日-2022年06月30日)



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2022年01月26日-2022年06月30日)



注：1、本基金成立于 2022 年 1 月 26 日；2、比较基准：中证 1000 指数收益率\*95%+银行活期存款利率(税后)\*5%。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

兴银基金管理有限责任公司，注册地为福建省平潭综合实验区，公司主要办公场所位于上海市



浦东新区。公司经营范围包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。公司股东为华福证券有限责任公司与国脉科技股份有限公司。本公司经证监会证监许可（2013）1289 号文批准，于 2013 年 10 月 25 日成立。2016 年 9 月 23 日，公司股东同比例增资，公司注册资本由 10,000 万元变更为 14,300 万元。增资后股东出资比例维持不变，华福证券有限责任公司出资比例为 76%，国脉科技股份有限公司出资比例为 24%。2016 年 10 月 24 日，公司法定名称由“华福基金管理有限责任公司”变更为“兴银基金管理有限责任公司”。

截至报告期末，本公司管理 46 只开放式基金（兴银现金收益货币市场基金、兴银收益增强债券型证券投资基金、兴银现金添利货币市场基金、兴银长盈三个月定期开放债券型证券投资基金、兴银长益三个月定期开放债券型证券投资基金、兴银消费新趋势灵活配置混合型证券投资基金、兴银货币市场基金、兴银大健康灵活配置混合型证券投资基金、兴银朝阳债券型证券投资基金、兴银鼎新灵活配置混合型证券投资基金、兴银长乐半年定期开放债券型证券投资基金、兴银丰盈灵活配置混合型证券投资基金、兴银现金增利货币市场基金、兴银瑞益纯债债券型证券投资基金、兴银合盈债券型证券投资基金、兴银丰润灵活配置混合型证券投资基金、兴银中短债债券型证券投资基金、兴银汇福定期开放债券型发起式证券投资基金、兴银汇逸三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、兴银合丰政策性金融债债券型证券投资基金、兴银鑫日享短债债券型证券投资基金、兴银先锋成长混合型证券投资基金、兴银汇裕一年定期开放债券型发起式证券投资基金、兴银聚丰债券型证券投资基金、兴银合盛三年定期开放债券型证券投资基金、兴银汇悦一年定期开放债券型发起式证券投资基金、兴银汇智一年定期开放债券型发起式证券投资基金、兴银丰运稳益回报混合型证券投资基金、兴银研究精选股票型证券投资基金、兴银景气优选混合型证券投资基金、兴银策略智选混合型证券投资基金、兴银汇泽 87 个月定期开放债券型证券投资基金、兴银科技增长 1 个月滚动持有期混合型证券投资基金、兴银中证 500 指数增强型证券投资基金、兴银高端制造混合型证券投资基金、兴银稳安 60 天滚动持有债券型发起式证券投资基金、兴银中证科创创业 50 指数型证券投资基金、兴银国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金、兴银兴慧一年持有期混合型证券投资基金、兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金、兴银碳中和主题混合型证券投资基金、兴银汇泓一年定期开放债券型发起式证券投资基金、兴银稳益 30 天持有期债券型证券投资基金、兴银合鑫债券型证券投资基金、兴银中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、兴银竞争优势混合型证券投资基金），净值总规模超 700 亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李哲通	本基金的基金经理	2022-01-26	-	11 年	硕士研究生。曾任巴克莱资本利率衍生品分析师，深圳大岩资本量化投资副总裁，上海迈维资产执行总经理。2020 年 10 月加入兴银基金管理有限责

					任公司，现任兴银基金指数与量化投资部基金经理。
--	--	--	--	--	-------------------------

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告载明日期。

李哲通先生为本基金的首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从《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。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人按照法律法规关于公平交易的相关规定，严格执行公司公平交易管理制度，加强了对所管理的不同投资组合间向交易价差的分析，确保公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

通过多因子选股模型，因子主要涵盖行业、盈利、成长、规模、估值、风险、市场情绪、分析师预期等多维大类因子及其项下的各细分小类因子，同时根据市场状态的变化和因子研究的最新结论，对因子库和模型进行更新，以能够追踪市场的变动，持续跟踪稳健的优质因子，在兼顾股票本身流动性和风险分散度的基础上构建股票投资组合。资产组合整体结构稳定，仓位控制灵活，市场适应性强。产品策略研究建立在对历史数据的大规模分析及对未来的高精度预测上，并严格按照策略执行交易管理及风控，力争为投资者带来长期稳定的资本增值回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴银中证 1000 指数增强 A 基金份额净值为 1.0277 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 2.77%，同期业绩比较基准收益率为-1.74%；截至报告期末兴银中证 1000 指数增强 C 基金份额净值为 1.0269 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 2.69%，同期业绩比较基准收益率为-1.74%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济上，预期下半年内需板块将走弱。居民消费将受疫情、内需及投资动能不足扰动。出口将初现筑顶迹象。行业方面，我们看好新能源车产业链，当前全球及国内新能源汽车的渗透率均不足 10%，处于较低水平，行业发展空间巨大。伴随新能源车型加速推出，乘用车需求疫后恢复，未来 10-15 年将是新能源汽车行业发展的黄金期。整体来说，下半年政策向经济偏向预期很强，市场结构性机会依旧广泛存在。我们将继续关注宏观环境变换并反思自身策略。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

根据证监会的相关规定，本公司为建立健全有效的估值政策和程序，成立估值小组，明确参与估值流程各方的人员分工和职责。估值小组组长由分管基金事务部的公司领导担任，成员由基金事务部、合规与风险管理部、研究发展部、权益投资部/固定收益部（视会议议题内容选择相关投资方向部门）部门负责人组成。估值小组成员具备应有的经验、专业胜任能力和独立性，分工明确，在上市公司研究和估值、基金投资、投资品种所属行业的专业研究、估值政策、估值流程和程序、基金的风险控制与绩效评估、会计政策与基金核算以及相关事项的合法合规性审核和监督等各个方面具备专业能力。估值小组严格按照工作流程诚实守信、勤勉尽责地讨论和决策估值事项。日常估值项目由基金事务部严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定执行。当经济环境和证券市场发生重大变化时，针对特殊估值工作，按照以下工作流程进行：由公司估值小组依据行业协会提供的估值模型和行业做法选定与当时市场经济环境相适应的估值方法并征求托管行、会计师事务所的相关意见，由基金事务部做出提示，对其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响是否在 0.25% 以上进行测算，并对确认产生影响的品种根据前述估值模型、估值流程计算，提供相关投资品种的公允价值以进行估值处理，待清算人员复核后，将估值结果反馈基金经理，并提交公司估值小组。其他特殊情形，可由基金经理主动做出提示，并由研究员提供研究报告，交估值小组审议，同时按流程对外公布。

##### 2、基金经理参与或决定估值的程度

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

##### 3、本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

##### 4、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行利润分配，符合法律法规的规定及《基金合同》的约定。

本报告期本基金没有应分配但尚未分配的利润。

#### 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

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

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

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

### § 6 半年度财务会计报告(未经审计)

#### 6.1 资产负债表

会计主体：兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金

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
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	23,952,553.71
结算备付金		8,390,415.62
存出保证金		2,342,194.40
交易性金融资产	6.4.7.2	206,093,182.92
其中：股票投资		206,093,182.92

基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产		-
债权投资（若有）		-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资（若有）		-
其他权益工具投资（若有）		-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		7,365,030.56
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		248,143,377.21
<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>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		2,796,326.77
应付管理人报酬		149,973.03
应付托管费		37,493.25
应付销售服务费		12,181.32
应付投资顾问费		-
应交税费		15,262.67
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.4	100,187.19
负债合计		3,111,424.23
<b>净资产：</b>		
实收基金	6.4.7.5	238,487,629.08
其他综合收益（若有）		-
未分配利润	6.4.7.6	6,544,323.90
净资产合计		245,031,952.98
负债和净资产总计		248,143,377.21

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 238,487,629.08 份。其中兴银中证 1000 指数增

强 A 基金份额净值 1.0277 元，基金份额总额 155,074,805.01 份；兴银中证 1000 指数增强 C 基金份额净值 1.0269 元，基金份额总额 83,412,824.07 份。

## 6.2 利润表

会计主体：兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2022 年 01 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022 年 01 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 06 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		1,877,668.74
1. 利息收入		328,606.63
其中：存款利息收入	6.4.7.7	319,582.34
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		9,024.29
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-12,493,636.53
其中：股票投资收益	6.4.7.8	-13,497,027.36
基金投资收益		-
债券投资收益		-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.9	143,887.38
股利收益	6.4.7.10	859,503.45
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有）		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.11	13,904,695.51
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.12	138,003.13
<b>减：二、营业总支出</b>		1,179,453.33
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	814,226.58
2. 托管费	6.4.10.2.2	203,556.69
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	71,218.60
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失		-
7. 税金及附加		468.74

8. 其他费用	6.4.7.13	89,982.72
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		698,215.41
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		698,215.41
五、其他综合收益的税后净额		0
六、综合收益总额		698,215.41

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2022 年 01 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2022 年 01 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 06 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益 （若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	-	-	-	-
加：会计政策变更（若有）	-	-	-	-
前期差错更正（若有）	-	-	-	-
其他（若有）	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	268,420,575.82	-	-	268,420,575.82
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-29,932,946.74	-	6,544,323.90	-23,388,622.84
（一）、综合收益总额	-	-	698,215.41	698,215.41
（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）	-29,932,946.74	-	5,846,108.49	-24,086,838.25
其中：1. 基金申购款	66,753,649.02	-	-1,213,430.34	65,540,218.68
2. 基金赎回款	-96,686,595.76	-	7,059,538.83	-89,627,056.93
（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（若有）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	238,487,629.08	-	6,544,323.90	245,031,952.98

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：

赵建兴	刘钊	崔可
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会 2021 年 12 月 28 日证监许可（2021）4124 号变更注册募集。《兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金合同》于 2022 年 1 月 26 日正式生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，本基金首次募集规模为人民币 268,420,575.82 份基金份额。本基金的基金管理人为兴银基金管理有限责任公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》相关规定以及《兴银丰运稳益回报混合型证券投资基金合同》等法律文件约定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以标的指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、银行存款、债券（包括国债、中央银行票据、地方政府债、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债、企业债、公司债、超短期融资券、短期融资券、中期票据、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券）、债券回购、股指期货、股票期权、资产支持证券、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终，在扣除股指期货合约和股票期权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。本基金的业绩比较基准：中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明



本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日的财务状况、自 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日）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，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (a) 金融资产的分类

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

本基金持有的股票投资、基金投资及债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的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。在初始确认时，如果能够消除或显著减少会计错配，本基金可以将本应以摊余成本计量的金融资产不可撤销地指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

管理金融资产业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

#### (b) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

##### - 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

##### - 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

#### 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

##### (a) 金融工具的初始确认

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

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

(b) 金融工具的后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

- 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

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

- 所转移金融资产的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

#### (d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

#### 预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为企面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内（若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

对于应收账款，本基金始终按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备。

除应收账款外，本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或

- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

#### 预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

#### 核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据《企业会计准则》的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持

的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

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

#### 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。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

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

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认并计入投资收益。

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

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

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

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

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和【销售服务费】在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

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

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

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；A类基金份额和C类基金份额之间由于收取费用的不同，将导致在可供分配利润上有所不同；本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；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基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配的有关业务规则进行调整，并及时公告。法律法规或监管机

构另有规定的，基金管理人在履行适当程序后，将对上述基金收益分配政策进行调整。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

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

### 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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。



#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号）、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

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

自2018年1月1日起，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让2017年12月31日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价（2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

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

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，其股息红利所得暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。

(e) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

## 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	8,093,057.25
等于：本金	8,092,348.29
加：应计利息	708.96
减：坏账准备（若有）	-
定期存款	-

等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备（若有）	-
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	15,859,496.46
等于：本金	15,857,972.21
加：应计利息	1,524.25
减：坏账准备（若有）	-
合计	23,952,553.71

## 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	192,493,830.02	-	206,093,182.92	13,599,352.90
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	192,493,830.02	-	206,093,182.92	13,599,352.90

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 06 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	16,414,510.76	-	-	股指期货
合计	16,414,510.76	-	-	-

注：衍生金融资产项下的股指期货投资净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0，为便于投资者理解，在此注释中，对衍生金融资产项下股

指期货投资净额为 0 作相关披露和说明。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况（若有）

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2207	IC2207	13	16,729,960.00	315,449.24
合计				315,449.24
减：可抵销期货暂收款				315,449.24
净额				0.00

#### 6.4.7.4 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	3,951.67
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	88,782.72
红利提前到账应付款	7,452.80
合计	100,187.19

#### 6.4.7.5 实收基金

##### 兴银中证 1000 指数增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	170,524,346.65	170,524,346.65
本期申购	26,043,156.18	26,043,156.18
本期赎回（以“-”号填列）	-41,492,697.82	-41,492,697.82
本期末	155,074,805.01	155,074,805.01

##### 兴银中证 1000 指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	97,896,229.17	97,896,229.17
本期申购	40,710,492.84	40,710,492.84
本期赎回（以“-”号填列）	-55,193,897.94	-55,193,897.94
本期末	83,412,824.07	83,412,824.07

## 6.4.7.6 未分配利润

## 兴银中证 1000 指数增强 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	-7,556,077.05	9,738,834.57	2,182,757.52
本期基金份额交易产生的变动数	1,903,310.66	216,591.43	2,119,902.09
其中：基金申购款	-2,053,700.28	1,365,171.91	-688,528.37
基金赎回款	3,957,010.94	-1,148,580.48	2,808,430.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,652,766.39	9,955,426.00	4,302,659.61

## 兴银中证 1000 指数增强 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	-5,650,403.05	4,165,860.94	-1,484,542.11
本期基金份额交易产生的变动数	2,541,258.55	1,184,947.85	3,726,206.40
其中：基金申购款	-2,865,724.53	2,340,822.56	-524,901.97
基金赎回款	5,406,983.08	-1,155,874.71	4,251,108.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,109,144.50	5,350,808.79	2,241,664.29

## 6.4.7.7 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	12,303.65
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	268,586.10
其他	38,692.59
合计	319,582.34

## 6.4.7.8 股票投资收益

## 6.4.7.8.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	2,763,278,791.98
减：卖出股票成本总额	2,772,246,816.95
减：交易费用	4,529,002.39
买卖股票差价收入	-13,497,027.36

## 6.4.7.9 衍生工具收益

## 6.4.7.9.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2022 年 01 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 06 月 30 日
股指期货投资收益	160,930.76
减：其他衍生工具收益应缴纳增值税	4,687.30
减：交易费用	12,356.08
合计	143,887.38

## 6.4.7.10 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	859,503.45
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	859,503.45

## 6.4.7.11 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 01 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	13,599,352.90
——股票投资	13,599,352.90
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-

2. 衍生工具	315,449.24
——权证投资	-
——期货投资	315,449.24
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	10,106.63
合计	13,904,695.51

#### 6.4.7.12 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	137,360.01
转换费收入	643.12
合计	138,003.13

#### 6.4.7.13 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 06 月 30 日
审计费用	19,958.64
信息披露费	68,824.08
证券出借违约金	-
账户开户费	1,200.00
合计	89,982.72

#### 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

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
兴银基金管理有限责任公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
平安银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
华福证券有限责任公司	基金管理人的股东、基金销售机构
国脉科技股份有限公司	基金管理人的股东
上海兴瀚资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

兴银成长资本管理有限公司	基金管理人的股东华福证券全资子公司
兴银投资有限公司	基金管理人的股东华福证券全资子公司

注：本基金与关联方的所有交易均是在正常业务中按照一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 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 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华福证券	5,722,859,317.05	100.00%

###### 6.4.10.1.2 权证交易

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 01 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
华福证券	120,000,000.00	100.00%

###### 6.4.10.1.4 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 26 日（基金合同生效日）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
华福证券	1,717,158.42	100.00%	0.00	0.00%

##### 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 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	814,226.58
其中：支付销售机构的客户维护费	389,256.87

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

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。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	203,556.69

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 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 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴银中证 1000 指数增强 A	兴银中证 1000 指数增强 C	合计
平安银行	-	16.48	16.48
华福证券	-	64,575.61	64,575.61
兴银基金	-	4,692.92	4,692.92
合计	-	69,285.01	69,285.01

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.20%，销售服务费计提的计算公式如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 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

注：本基金本报告期内未发生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

注：无。

## 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

注：无。

## 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自有资金投资本基金的情况

注：本基金的管理人在本报告期内未运用自有资金投资本基金。

## 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

注：除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末未持有本基金。

## 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 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
平安银行股份有限公司	8,093,057.25	12,303.65

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。

## 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

## 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

## 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

注：无。

## 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600938	中国海油	2022 年 04 月 14 日	6 个月	股票流通受限	10.80	15.86	84,004	907,243.20	1,332,303.44	-
3011	元道	2022 年	6 个月	新股	38.4	38.4	2,486	95,611	95,611	-

39	通信	06 月 30 日		流通受限	6	6		.56	.56	
301239	普瑞眼科	2022 年 06 月 22 日	6 个月	新股流通受限	33.65	33.65	2,394	80,558.10	80,558.10	-
688325	赛微微电	2022 年 04 月 15 日	6 个月	科创板新股锁定	74.55	53.89	1,408	104,966.40	75,877.12	-
301233	盛帮股份	2022 年 06 月 24 日	6 个月	新股流通受限	41.52	41.52	1,536	63,774.72	63,774.72	-
301238	瑞泰新材	2022 年 06 月 10 日	6 个月	创业板新股锁定	19.18	32.07	565	10,836.70	18,119.55	-
301120	新特电气	2022 年 04 月 11 日	6 个月	创业板新股锁定	13.73	15.49	1,032	14,169.36	15,985.68	-
301263	泰恩康	2022 年 03 月 22 日	6 个月	创业板新股锁定	19.93	31.38	440	8,769.20	13,807.20	-
301187	欧圣电气	2022 年 04 月 13 日	6 个月	创业板新股锁定	21.33	22.54	608	12,968.64	13,704.32	-
301298	东利机械	2022 年 05 月 27 日	6 个月	创业板新股锁定	12.68	20.83	634	8,039.12	13,206.22	-
301112	信邦智能	2022 年 06 月 20 日	6 个月	创业板新股锁定	27.53	45.04	293	8,066.29	13,196.72	-
301162	国能日新	2022 年 04 月 19 日	6 个月	创业板新股锁定	45.13	54.11	234	10,560.42	12,661.74	-
301259	艾布鲁	2022 年 04 月 18 日	6 个月	创业板新股锁定	18.39	24.94	483	8,882.37	12,046.02	-

301268	铭利达	2022年03月29日	6个月	创业板新股锁定	28.50	34.87	344	9,804.00	11,995.28	-
301286	侨源股份	2022年06月06日	6个月	创业板新股锁定	16.91	19.79	600	10,146.00	11,874.00	-
301220	亚香股份	2022年06月15日	6个月	创业板新股锁定	35.98	39.15	285	10,254.30	11,157.75	-
301212	联盛化学	2022年04月07日	6个月	创业板新股锁定	29.67	33.28	333	9,880.11	11,082.24	-
301097	天益医疗	2022年03月25日	6个月	创业板新股锁定	52.37	47.83	209	10,945.33	9,996.47	-
301302	华如科技	2022年06月16日	6个月	创业板新股锁定	52.03	56.42	175	9,105.25	9,873.50	-
301288	清研环境	2022年04月14日	6个月	创业板新股锁定	19.09	19.98	452	8,628.68	9,030.96	-
301125	腾亚精工	2022年05月27日	6个月	创业板新股锁定	22.49	27.42	327	7,354.23	8,966.34	-
301163	宏德股份	2022年04月11日	6个月	创业板新股锁定	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41	-
301248	杰创智能	2022年04月13日	6个月	创业板新股锁定	39.07	29.87	283	11,056.81	8,453.21	-
301216	万凯新材	2022年03月21日	6个月	创业板新股锁定	35.68	29.84	262	9,348.16	7,818.08	-

301109	军信股份	2022 年 04 月 06 日	6 个月	创业板新股锁定	34.81	16.14	469	10,895.53	7,569.66	该股票在流通受限期内, 获得股票红利和转增股, 期末估值已考虑分红除权情况。
301150	中一科技	2022 年 04 月 14 日	6 个月	创业板新股锁定	163.56	82.76	87	9,486.48	7,200.12	该股票在流通受限期内, 获得股票红利和转增股, 期末估值已考虑分红除权情况。
301148	嘉戎技术	2022 年 04 月 14 日	6 个月	创业板新股锁定	38.39	23.90	284	10,902.76	6,787.60	-
301151	冠龙节能	2022 年 03 月 30 日	6 个月	创业板新股锁定	30.82	21.46	305	9,400.10	6,545.30	-
301135	瑞德智能	2022 年 04 月 01 日	6 个月	创业板新股锁定	31.98	26.26	249	7,963.02	6,538.74	-
301279	金道科技	2022 年 04 月 06 日	6 个月	创业板新股锁定	31.20	22.81	280	8,736.00	6,386.80	-

## 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复牌 日期	复牌 开盘 单价	数量 (股)	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注
000881	中广核 技	2022- 06-28	重大 事项	9.02	2022- 07-01	9.56	28,80 0	251,7 25.02	259,7 76.00	-

#### 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

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：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

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

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

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，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等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

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

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末未持有需按短期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末未持有需按短期信用评级列示的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末未持有需按短期信用评级列示的同业存单。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末未持有需按长期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末未持有需按长期信用评级列示的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末未持有需按长期信用评级列示的同业存单。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短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制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 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，其余均能以合理价格适时变现。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期

日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持大部分证券为依法上市的股票、债券等资产，本报告期末本基金持有的资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 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。

本基金经营活动的现金流量与市场利率变化有一定的相关性，因此利率风险在一定程度上存在。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 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	23,952,553.71	-	-	-	-	-	23,952,553.71
结算备付金	8,390,415.62	-	-	-	-	-	8,390,415.62
存出保证金	2,342,194.40	-	-	-	-	-	2,342,194.40
交易性金融资产	-	-	-	-	-	206,093,182.92	206,093,182.92
应收申购款	-	-	-	-	-	7,365,030.56	7,365,030.56
资产总计	34,685,163.73	-	-	-	-	213,458,213.48	248,143,377.21
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,796,326.77	2,796,326.77



应付管理人报酬	-	-	-	-	-	149,973.03	149,973.03
应付托管费	-	-	-	-	-	37,493.25	37,493.25
应付销售服务费	-	-	-	-	-	12,181.32	12,181.32
应交税费	-	-	-	-	-	15,262.67	15,262.67
其他负债	-	-	-	-	-	100,187.19	100,187.19
负债总计	-	-	-	-	-	3,111,424.23	3,111,424.23
利率敏感度缺口	34,685,163.73	-	-	-	-	210,346,789.25	245,031,952.98

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除利率之外的其他市场变量保持不变；	
	该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券与可交换债券。	
分析	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
	市场利率上升 25 个基点	-
	市场利率下降 25 个基点	-

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

#### 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系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

#### 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	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	206,093,182.92	84.11
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	206,093,182.92	84.11

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除下述市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2022 年 06 月 30 日
	沪深 300 指数上涨 5%	10,189,422.20
	沪深 300 指数下跌 5%	-10,189,422.20

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

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

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

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 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

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-
第一层次	204,182,099.07	-
第二层次	1,911,083.85	-
第三层次	-	-

合计	206,093,182.92	-
----	----------------	---

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日,本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2021 年 12 月 31 日:无)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债,其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2022 年 6 月 30 日,本基金无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	206,093,182.92	83.05
	其中:股票	206,093,182.92	83.05
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	32,342,969.33	13.03
8	其他各项资产	9,707,224.96	3.91
9	合计	248,143,377.21	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末(指数投资)按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
----	------	---------	--------------

A	农、林、牧、渔业	459,550.00	0.19
B	采矿业	5,384,212.30	2.20
C	制造业	168,552,822.13	68.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,606,487.00	0.66
E	建筑业	1,705,385.35	0.70
F	批发和零售业	1,047,645.42	0.43
G	交通运输、仓储和邮政业	847,618.52	0.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,988,020.72	4.48
J	金融业	362,692.60	0.15
K	房地产业	77,510.00	0.03
L	租赁和商务服务业	710,758.00	0.29
M	科学研究和技术服务业	157,248.00	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	772,957.60	0.32
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	81,720.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	658,021.00	0.27
S	综合	-	-
	合计	193,412,648.64	78.93

### 7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,332,320.89	0.54
C	制造业	10,329,014.51	4.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	54,497.00	0.02
E	建筑业	6,078.00	0.00
F	批发和零售业	73,018.04	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	102,261.00	0.04
H	住宿和餐饮业	4,960.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	464,599.51	0.19
J	金融业	-	-
K	房地产业	53,403.00	0.02
L	租赁和商务服务业	9,245.20	0.00
M	科学研究和技术服务业	31,371.80	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	31,421.23	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	7,200.00	0.00
Q	卫生和社会工作	170,098.10	0.07
R	文化、体育和娱乐业	11,046.00	0.00

S	综合	-	-
	合计	12,680,534.28	5.18

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	002639	雪人股份	744,000	8,526,240.00	3.48
2	300568	星源材质	268,513	7,797,617.52	3.18
3	688388	嘉元科技	90,669	7,695,078.03	3.14
4	603489	八方股份	38,629	7,512,954.21	3.07
5	603169	兰石重装	1,090,500	7,230,015.00	2.95
6	002245	蔚蓝锂芯	305,918	7,100,356.78	2.90
7	002100	天康生物	511,100	4,967,892.00	2.03
8	688598	金博股份	15,901	4,686,024.70	1.91
9	600481	双良节能	276,400	4,657,340.00	1.90
10	300171	东富龙	126,600	4,293,006.00	1.75
11	002993	奥海科技	101,500	4,218,340.00	1.72
12	300616	尚品宅配	147,000	4,182,150.00	1.71
13	002436	兴森科技	360,100	4,058,327.00	1.66
14	300666	江丰电子	66,400	4,050,400.00	1.65
15	603566	普莱柯	151,175	4,040,907.75	1.65
16	600711	盛屯矿业	515,900	4,003,384.00	1.63
17	002215	诺普信	703,700	3,933,683.00	1.61
18	603313	梦百合	327,200	3,926,400.00	1.60
19	603187	海容冷链	107,400	3,925,470.00	1.60
20	600416	湘电股份	205,100	3,888,696.00	1.59
21	603337	杰克股份	175,345	3,766,410.60	1.54
22	002706	良信股份	226,000	3,735,780.00	1.52
23	300083	创世纪	321,100	3,692,650.00	1.51
24	300118	东方日升	125,704	3,686,898.32	1.50
25	605111	新洁能	28,849	3,629,492.69	1.48
26	688568	中科星图	51,896	3,516,472.96	1.44
27	688033	天宜上佳	164,535	3,494,723.40	1.43
28	600328	中盐化工	123,650	2,911,957.50	1.19
29	300674	宇信科技	162,200	2,543,296.00	1.04
30	300177	中海达	268,688	2,173,685.92	0.89
31	300671	富满微	26,700	1,924,002.00	0.79
32	300055	万邦达	142,300	1,331,928.00	0.54
33	600552	凯盛科技	108,300	1,227,039.00	0.50
34	002539	云图控股	64,700	1,034,553.00	0.42

35	603301	振德医疗	23,400	983,970.00	0.40
36	600305	恒顺醋业	69,700	899,130.00	0.37
37	300409	道氏技术	32,100	833,958.00	0.34
38	002214	大立科技	60,920	774,902.40	0.32
39	600063	皖维高新	92,200	698,876.00	0.29
40	603688	石英股份	5,000	663,050.00	0.27
41	300755	华致酒行	12,344	541,284.40	0.22
42	002182	云海金属	21,195	531,570.60	0.22
43	603979	金诚信	22,800	440,268.00	0.18
44	002312	川发龙蟒	23,719	409,389.94	0.17
45	603801	志邦家居	14,800	399,304.00	0.16
46	002738	中矿资源	3,940	364,883.40	0.15
47	002254	泰和新材	21,700	363,475.00	0.15
48	300307	慈星股份	59,500	362,355.00	0.15
49	002204	大连重工	79,300	346,541.00	0.14
50	300432	富临精工	15,650	344,300.00	0.14
51	300276	三丰智能	81,500	343,115.00	0.14
52	300188	美亚柏科	24,800	334,304.00	0.14
53	688050	爱博医疗	1,491	334,282.20	0.14
54	002850	科达利	2,100	333,900.00	0.14
55	002975	博杰股份	8,600	328,950.00	0.13
56	300457	赢合科技	11,500	326,715.00	0.13
57	600873	梅花生物	28,700	323,736.00	0.13
58	300627	华测导航	9,360	321,890.40	0.13
59	603008	喜临门	8,700	319,290.00	0.13
60	002487	大金重工	7,600	317,148.00	0.13
61	600456	宝钛股份	5,300	314,820.00	0.13
62	600596	新安股份	14,521	314,379.65	0.13
63	688066	航天宏图	3,984	313,939.20	0.13
64	600621	华鑫股份	21,600	313,632.00	0.13
65	688063	派能科技	1,000	312,200.00	0.13
66	300604	长川科技	6,850	309,277.50	0.13
67	000683	远兴能源	29,400	308,994.00	0.13
68	603338	浙江鼎力	6,000	304,200.00	0.12
69	002541	鸿路钢构	9,090	303,606.00	0.12
70	000155	川能动力	13,600	301,240.00	0.12
71	603305	旭升股份	9,820	296,760.40	0.12
72	603236	移远通信	2,210	295,388.60	0.12
73	300263	隆华科技	32,800	293,888.00	0.12
74	300373	扬杰科技	4,100	292,125.00	0.12
75	002126	银轮股份	25,500	291,975.00	0.12
76	002759	天际股份	10,700	290,826.00	0.12
77	300776	帝尔激光	1,680	290,304.00	0.12

78	688200	华峰测控	813	289,753.20	0.12
79	603565	中谷物流	18,196	288,770.52	0.12
80	603713	密尔克卫	2,100	287,070.00	0.12
81	600378	昊华科技	7,400	285,048.00	0.12
82	000591	太阳能	34,100	284,735.00	0.12
83	300224	正海磁材	18,600	284,580.00	0.12
84	603906	龙蟠科技	7,700	284,438.00	0.12
85	002741	光华科技	14,200	283,006.00	0.12
86	300523	辰安科技	10,100	281,689.00	0.11
87	603596	伯特利	3,500	280,630.00	0.11
88	000893	亚钾国际	8,100	278,721.00	0.11
89	601677	明泰铝业	11,658	277,460.40	0.11
90	002597	金禾实业	6,400	277,312.00	0.11
91	002516	旷达科技	53,900	275,968.00	0.11
92	002906	华阳集团	6,000	271,860.00	0.11
93	300638	广和通	10,200	270,198.00	0.11
94	600929	雪天盐业	28,900	268,192.00	0.11
95	688016	心脉医疗	1,365	265,915.65	0.11
96	002847	盐津铺子	3,000	263,820.00	0.11
97	300035	中科电气	9,400	262,730.00	0.11
98	000933	神火股份	19,900	260,292.00	0.11
99	300326	凯利泰	31,500	260,190.00	0.11
100	000881	中广核技	28,800	259,776.00	0.11
101	603505	金石资源	6,300	257,733.00	0.11
102	300725	药石科技	2,600	257,374.00	0.11
103	300487	蓝晓科技	4,200	256,200.00	0.10
104	688019	安集科技	1,200	255,504.00	0.10
105	603229	奥翔药业	6,700	255,002.00	0.10
106	300696	爱乐达	5,800	254,910.00	0.10
107	688301	奕瑞科技	538	254,495.52	0.10
108	002276	万马股份	32,500	254,150.00	0.10
109	603387	基蛋生物	17,780	253,542.80	0.10
110	300587	天铁股份	12,400	253,332.00	0.10
111	601666	平煤股份	18,600	252,774.00	0.10
112	002643	万润股份	12,100	252,406.00	0.10
113	002677	浙江美大	17,200	252,324.00	0.10
114	300133	华策影视	50,600	251,988.00	0.10
115	000935	四川双马	10,400	251,888.00	0.10
116	603599	广信股份	8,940	251,661.00	0.10
117	002859	洁美科技	9,100	250,432.00	0.10
118	300298	三诺生物	8,900	250,090.00	0.10
119	002163	海南发展	17,500	249,725.00	0.10
120	002891	中宠股份	9,800	249,116.00	0.10

121	300634	彩讯股份	19,600	248,920.00	0.10
122	002041	登海种业	11,800	248,862.00	0.10
123	300398	飞凯材料	10,871	248,511.06	0.10
124	603508	思维列控	18,500	247,715.00	0.10
125	688083	中望软件	1,181	247,325.02	0.10
126	600285	羚锐制药	19,700	246,841.00	0.10
127	002895	川恒股份	7,295	246,643.95	0.10
128	002697	红旗连锁	48,600	245,430.00	0.10
129	002291	星期六	12,400	245,024.00	0.10
130	002324	普利特	16,900	244,712.00	0.10
131	300662	科锐国际	4,700	243,883.00	0.10
132	300394	天孚通信	9,000	243,630.00	0.10
133	002063	远光软件	34,600	243,238.00	0.10
134	688100	威胜信息	11,584	243,148.16	0.10
135	600158	中体产业	29,500	242,785.00	0.10
136	601330	绿色动力	30,900	241,947.00	0.10
137	002258	利尔化学	10,243	241,939.66	0.10
138	601208	东材科技	18,700	241,604.00	0.10
139	002344	海宁皮城	51,600	240,972.00	0.10
140	600963	岳阳林纸	39,900	240,597.00	0.10
141	002929	润建股份	6,700	240,530.00	0.10
142	300762	上海瀚讯	21,600	240,408.00	0.10
143	002402	和而泰	12,600	240,156.00	0.10
144	300639	凯普生物	11,228	240,054.64	0.10
145	605090	九丰能源	11,800	239,186.00	0.10
146	603129	春风动力	2,100	238,812.00	0.10
147	600876	洛阳玻璃	9,500	237,690.00	0.10
148	600103	青山纸业	94,500	237,195.00	0.10
149	603583	捷昌驱动	7,100	237,069.00	0.10
150	688266	泽璟制药	6,600	236,874.00	0.10
151	600496	精工钢构	51,100	236,082.00	0.10
152	603766	隆鑫通用	51,200	236,032.00	0.10
153	002216	三全食品	12,044	235,941.96	0.10
154	002206	海利得	37,200	235,104.00	0.10
155	002567	唐人神	27,500	234,025.00	0.10
156	600273	嘉化能源	21,530	233,815.80	0.10
157	002318	久立特材	14,600	233,454.00	0.10
158	603212	赛伍技术	8,700	231,507.00	0.09
159	002091	江苏国泰	21,478	230,888.50	0.09
160	300355	蒙草生态	58,600	230,884.00	0.09
161	300395	菲利华	5,100	229,500.00	0.09
162	002832	比音勒芬	9,100	229,320.00	0.09
163	002545	东方铁塔	20,100	228,738.00	0.09



164	300596	利安隆	5,175	228,269.25	0.09
165	600395	盘江股份	25,900	227,143.00	0.09
166	600874	创业环保	33,700	226,801.00	0.09
167	600057	厦门象屿	25,700	225,903.00	0.09
168	600428	中远海特	47,400	225,624.00	0.09
169	603348	文灿股份	4,200	225,120.00	0.09
170	603588	高能环境	19,220	221,606.60	0.09
171	002267	陕天然气	31,500	220,185.00	0.09
172	300327	中颖电子	4,400	219,164.00	0.09
173	300087	荃银高科	12,800	210,688.00	0.09
174	688333	铂力特	1,100	201,003.00	0.08
175	301090	华润材料	9,600	104,736.00	0.04
176	603208	江山欧派	1,400	101,122.00	0.04
177	002977	天箭科技	1,920	90,873.60	0.04
178	300791	仙乐健康	2,900	90,538.00	0.04
179	002991	甘源食品	1,300	89,687.00	0.04
180	603416	信捷电气	2,100	86,394.00	0.04
181	002918	蒙娜丽莎	4,600	86,112.00	0.04
182	300590	移为通信	6,300	85,491.00	0.03
183	002733	雄韬股份	4,900	85,309.00	0.03
184	002376	新北洋	10,900	84,257.00	0.03
185	603180	金牌厨柜	2,684	83,096.64	0.03
186	600715	文投控股	32,900	82,908.00	0.03
187	603396	金辰股份	900	81,927.00	0.03
188	002970	锐明技术	2,900	81,925.00	0.03
189	300143	盈康生命	7,200	81,720.00	0.03
190	603936	博敏电子	6,000	81,720.00	0.03
191	002912	中新赛克	3,300	81,378.00	0.03
192	603378	亚士创能	6,955	81,095.30	0.03
193	300132	青松股份	11,500	80,500.00	0.03
194	300788	中信出版	3,900	80,340.00	0.03
195	000710	贝瑞基因	5,600	80,304.00	0.03
196	300900	广联航空	3,000	80,100.00	0.03
197	300624	万兴科技	2,500	79,975.00	0.03
198	603068	博通集成	2,000	79,940.00	0.03
199	002301	齐心集团	12,000	79,200.00	0.03
200	300510	金冠股份	16,000	79,200.00	0.03
201	300423	昇辉科技	7,300	78,986.00	0.03
202	300439	美康生物	6,500	78,910.00	0.03
203	300659	中孚信息	3,700	78,699.00	0.03
204	603359	东珠生态	6,500	78,520.00	0.03
205	300548	博创科技	4,400	78,408.00	0.03
206	300368	汇金股份	10,700	78,003.00	0.03

207	688085	三友医疗	3,600	77,940.00	0.03
208	300857	协创数据	3,800	77,862.00	0.03
209	300657	弘信电子	6,700	77,854.00	0.03
210	300429	强力新材	8,200	77,818.00	0.03
211	000918	嘉凯城	33,700	77,510.00	0.03
212	300842	帝科股份	1,300	77,480.00	0.03
213	300378	鼎捷软件	4,700	77,409.00	0.03
214	002035	华帝股份	13,300	77,406.00	0.03
215	300078	思创医惠	15,100	77,161.00	0.03
216	300785	值得买	2,950	77,113.00	0.03
217	603610	麒盛科技	5,700	77,007.00	0.03
218	300215	电科院	11,200	76,944.00	0.03
219	601886	江河集团	9,100	76,895.00	0.03
220	688788	科思科技	1,700	76,857.00	0.03
221	300552	万集科技	2,500	76,850.00	0.03
222	002298	中电兴发	11,700	76,752.00	0.03
223	300109	新开源	4,700	76,704.00	0.03
224	300386	飞天诚信	6,800	76,636.00	0.03
225	603626	科森科技	10,300	76,529.00	0.03
226	688365	光云科技	8,222	76,464.60	0.03
227	300006	莱美药业	18,400	76,360.00	0.03
228	300365	恒华科技	10,900	76,300.00	0.03
229	000936	华西股份	14,100	76,281.00	0.03
230	002522	浙江众成	13,400	76,112.00	0.03
231	603105	芯能科技	6,800	76,024.00	0.03
232	300607	拓斯达	5,750	76,015.00	0.03
233	300045	华力创通	9,900	75,933.00	0.03
234	002609	捷顺科技	9,800	75,754.00	0.03
235	002664	长鹰信质	4,400	75,592.00	0.03
236	300007	汉威科技	4,200	75,558.00	0.03
237	300602	飞荣达	4,600	75,440.00	0.03
238	603686	福龙马	7,600	75,392.00	0.03
239	300684	中石科技	5,400	75,330.00	0.03
240	300222	科大智能	9,200	74,152.00	0.03
241	688020	方邦股份	1,900	74,081.00	0.03
242	300441	鲍斯股份	10,900	73,575.00	0.03
243	688116	天奈科技	433	73,384.84	0.03
244	601700	风范股份	14,300	73,073.00	0.03
245	300443	金雷股份	1,600	72,928.00	0.03
246	002662	京威股份	20,000	72,600.00	0.03
247	600114	东睦股份	9,092	72,554.16	0.03
248	603728	鸣志电器	3,400	72,182.00	0.03
249	603960	克来机电	3,500	71,925.00	0.03

250	300322	硕贝德	8,200	71,832.00	0.03
251	002979	雷赛智能	3,400	69,428.00	0.03
252	002838	道恩股份	2,600	63,856.00	0.03
253	603530	神马电力	3,600	61,884.00	0.03
254	688095	福昕软件	840	59,640.00	0.02
255	300861	美畅股份	600	55,614.00	0.02
256	002192	融捷股份	359	55,178.30	0.02
257	603606	东方电缆	700	53,620.00	0.02
258	603826	坤彩科技	900	52,974.00	0.02
259	600872	中炬高新	1,500	51,915.00	0.02
260	000423	东阿阿胶	1,400	51,730.00	0.02
261	601001	晋控煤业	2,900	51,475.00	0.02
262	002015	协鑫能科	2,900	51,446.00	0.02
263	603529	爱玛科技	980	51,332.40	0.02
264	600032	浙江新能	3,500	51,275.00	0.02
265	002472	双环传动	1,600	50,944.00	0.02
266	000762	西藏矿业	900	50,337.00	0.02
267	600483	福能股份	3,500	49,245.00	0.02
268	300438	鹏辉能源	800	49,160.00	0.02
269	300726	宏达电子	800	48,936.00	0.02
270	601231	环旭电子	3,400	48,824.00	0.02
271	600559	老白干酒	1,700	48,773.00	0.02
272	002405	四维图新	3,200	48,224.00	0.02
273	300777	中简科技	1,000	48,200.00	0.02
274	300775	三角防务	1,000	48,150.00	0.02
275	002432	九安医疗	800	48,048.00	0.02
276	600295	鄂尔多斯	2,660	48,013.00	0.02
277	300748	金力永磁	1,300	47,840.00	0.02
278	601158	重庆水务	8,900	47,615.00	0.02
279	000818	航锦科技	1,400	47,460.00	0.02
280	000902	新洋丰	2,800	47,292.00	0.02
281	002463	沪电股份	3,200	47,232.00	0.02
282	002761	浙江建投	1,500	46,305.00	0.02
283	001213	中铁特货	9,400	46,154.00	0.02
284	600688	上海石化	14,500	46,110.00	0.02
285	600338	西藏珠峰	1,600	45,920.00	0.02
286	000539	粤电力 A	10,800	45,360.00	0.02
287	002176	江特电机	1,800	45,072.00	0.02
288	600578	京能电力	14,400	45,072.00	0.02
289	000958	电投产融	9,900	44,946.00	0.02
290	002145	中核钛白	6,281	44,783.53	0.02
291	300682	朗新科技	1,756	44,233.64	0.02
292	601952	苏垦农发	3,160	44,208.40	0.02

293	600098	广州发展	7,000	43,820.00	0.02
294	688139	海尔生物	600	43,698.00	0.02
295	002531	天顺风能	2,600	42,874.00	0.02
296	002025	航天电器	600	41,892.00	0.02
297	300850	新强联	470	41,844.10	0.02
298	688520	神州细胞	800	41,384.00	0.02
299	301029	怡合达	500	40,750.00	0.02
300	301177	迪阿股份	400	29,680.00	0.01
301	300655	晶瑞电材	1,113	21,480.90	0.01
302	688366	昊海生科	147	15,549.66	0.01
303	688339	亿华通	92	9,050.96	0.00
304	688198	佰仁医疗	73	8,900.16	0.00
305	688268	华特气体	118	8,290.68	0.00
306	688318	财富趋势	69	6,900.00	0.00
307	300803	指南针	70	4,114.60	0.00
308	688007	光峰科技	124	3,013.20	0.00
309	603896	寿仙谷	60	2,326.80	0.00
310	688278	特宝生物	52	1,532.96	0.00
311	600742	一汽富维	76	705.28	0.00
312	000065	北方国际	63	532.35	0.00
313	600163	中闽能源	60	507.00	0.00
314	000851	高鸿股份	76	362.52	0.00
315	300366	创意信息	6	51.30	0.00

## 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	002407	多氟多	90,100	4,406,791.00	1.80
2	600938	中国海油	84,005	1,332,320.89	0.54
3	688390	固德威	3,700	1,158,137.00	0.47
4	300390	天华超净	4,000	349,600.00	0.14
5	002756	永兴材料	2,100	319,641.00	0.13
6	300073	当升科技	3,473	313,750.82	0.13
7	600499	科达制造	15,200	313,728.00	0.13
8	002240	盛新锂能	4,800	289,728.00	0.12
9	600096	云天化	8,600	270,728.00	0.11
10	002497	雅化集团	8,100	264,465.00	0.11
11	688122	西部超导	2,800	258,160.00	0.11
12	603976	正川股份	10,300	253,483.00	0.10
13	301112	信邦智能	2,921	156,370.16	0.06
14	301139	元道通信	2,486	95,611.56	0.04

15	300015	爱尔眼科	2,000	89,540.00	0.04
16	301239	普瑞眼科	2,394	80,558.10	0.03
17	688325	赛微微电	1,408	75,877.12	0.03
18	301233	盛帮股份	1,536	63,774.72	0.03
19	300412	迦南科技	8,500	57,715.00	0.02
20	002865	钧达股份	600	57,216.00	0.02
21	688536	思瑞浦	100	56,159.00	0.02
22	601100	恒立液压	900	55,548.00	0.02
23	300588	熙菱信息	5,200	55,224.00	0.02
24	601155	新城控股	2,100	53,403.00	0.02
25	603138	海量数据	3,800	52,326.00	0.02
26	603737	三棵树	400	51,772.00	0.02
27	600703	三安光电	2,100	51,618.00	0.02
28	002812	恩捷股份	200	50,090.00	0.02
29	300095	华伍股份	3,500	45,920.00	0.02
30	300491	通合科技	3,100	45,477.00	0.02
31	002227	奥特迅	3,000	43,290.00	0.02
32	300464	星徽股份	5,900	40,946.00	0.02
33	603333	尚纬股份	6,600	40,458.00	0.02
34	002916	深南电路	400	37,484.00	0.02
35	002805	丰元股份	600	37,140.00	0.02
36	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.02
37	300681	英搏尔	590	34,084.30	0.01
38	000702	正虹科技	6,100	33,062.00	0.01
39	688560	明冠新材	900	30,816.00	0.01
40	688188	柏楚电子	140	30,805.60	0.01
41	300566	激智科技	1,700	30,770.00	0.01
42	300887	谱尼测试	700	29,897.00	0.01
43	603507	振江股份	900	29,646.00	0.01
44	601021	春秋航空	500	29,175.00	0.01
45	603517	绝味食品	500	28,910.00	0.01
46	603885	吉祥航空	1,600	28,784.00	0.01
47	603817	海峡环保	3,900	28,470.00	0.01
48	688567	孚能科技	1,000	28,410.00	0.01
49	688135	利扬芯片	900	28,332.00	0.01
50	002353	杰瑞股份	700	28,210.00	0.01
51	002156	通富微电	1,800	27,720.00	0.01
52	000807	云铝股份	2,800	27,664.00	0.01
53	300316	晶盛机电	400	27,036.00	0.01
54	002815	崇达技术	2,100	26,901.00	0.01
55	600196	复星医药	600	26,454.00	0.01
56	600995	文山电力	1,700	26,027.00	0.01
57	603633	徕木股份	1,779	25,937.82	0.01

58	688005	容百科技	200	25,888.00	0.01
59	605333	沪光股份	1,100	25,410.00	0.01
60	002849	威星智能	2,100	25,053.00	0.01
61	601339	百隆东方	4,900	24,892.00	0.01
62	300421	力星股份	2,000	24,080.00	0.01
63	002881	美格智能	750	24,045.00	0.01
64	600597	光明乳业	1,900	23,997.00	0.01
65	002439	启明星辰	1,200	23,916.00	0.01
66	300210	森远股份	6,800	23,732.00	0.01
67	000301	东方盛虹	1,400	23,674.00	0.01
68	300680	隆盛科技	900	23,328.00	0.01
69	601865	福莱特	600	22,860.00	0.01
70	603982	泉峰汽车	900	21,951.00	0.01
71	688012	中微公司	186	21,715.50	0.01
72	301238	瑞泰新材	648	21,242.84	0.01
73	688308	欧科亿	298	19,834.88	0.01
74	301162	国能日新	331	18,602.02	0.01
75	300903	科翔股份	1,280	18,060.80	0.01
76	688661	和林微纳	300	17,988.00	0.01
77	300246	宝莱特	1,100	17,325.00	0.01
78	300796	贝斯美	1,100	16,698.00	0.01
79	603518	锦泓集团	2,000	16,040.00	0.01
80	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.01
81	301263	泰恩康	499	15,858.04	0.01
82	600859	王府井	600	15,588.00	0.01
83	603011	合锻智能	2,300	15,502.00	0.01
84	300546	雄帝科技	600	15,432.00	0.01
85	301187	欧圣电气	673	15,424.22	0.01
86	301268	铭利达	432	15,374.48	0.01
87	300062	中能电气	2,200	15,334.00	0.01
88	000959	首钢股份	3,100	14,756.00	0.01
89	301302	华如科技	244	14,105.96	0.01
90	301220	亚香股份	349	13,905.27	0.01
91	688303	大全能源	200	13,664.00	0.01
92	301259	艾布鲁	528	13,369.02	0.01
93	002825	纳尔股份	1,200	13,308.00	0.01
94	301298	东利机械	634	13,206.22	0.01
95	603613	国联股份	145	12,847.00	0.01
96	605050	福然德	900	12,627.00	0.01
97	301163	宏德股份	364	12,210.08	0.00
98	301286	侨源股份	600	11,874.00	0.00
99	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
100	301212	联盛化学	333	11,082.24	0.00

101	300426	唐德影视	1,400	11,046.00	0.00
102	688068	热景生物	148	11,008.24	0.00
103	000920	沃顿科技	1,200	10,692.00	0.00
104	300275	梅安森	800	10,616.00	0.00
105	301288	清研环境	516	10,587.44	0.00
106	301097	天益医疗	209	9,996.47	0.00
107	301248	杰创智能	329	9,959.25	0.00
108	688003	天准科技	300	9,900.00	0.00
109	301216	万凯新材	312	9,395.58	0.00
110	603300	华铁应急	1,160	9,245.20	0.00
111	002109	兴化股份	1,600	9,152.00	0.00
112	000878	云南铜业	800	9,112.00	0.00
113	300408	三环集团	300	9,030.00	0.00
114	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
115	300562	乐心医疗	900	8,703.00	0.00
116	603871	嘉友国际	500	8,450.00	0.00
117	301148	嘉戎技术	334	8,092.60	0.00
118	301109	军信股份	484	7,826.61	0.00
119	601866	中远海发	2,600	7,800.00	0.00
120	688196	卓越新能	100	7,700.00	0.00
121	601008	连云港	1,800	7,578.00	0.00
122	301151	冠龙节能	344	7,450.88	0.00
123	688357	建龙微纳	66	7,421.04	0.00
124	300037	新宙邦	140	7,358.40	0.00
125	301150	中一科技	87	7,200.12	0.00
126	603377	东方时尚	1,200	7,200.00	0.00
127	600353	旭光电子	800	7,112.00	0.00
128	688668	鼎通科技	100	7,034.00	0.00
129	301279	金道科技	299	6,866.17	0.00
130	301135	瑞德智能	249	6,538.74	0.00
131	601608	中信重工	1,700	6,443.00	0.00
132	000876	新希望	400	6,120.00	0.00
133	002140	东华科技	600	6,078.00	0.00
134	600029	南方航空	700	5,117.00	0.00
135	002180	纳思达	100	5,062.00	0.00
136	600258	首旅酒店	200	4,960.00	0.00
137	002302	西部建设	600	4,656.00	0.00
138	688589	力合微	100	4,482.00	0.00
139	300710	万隆光电	100	4,079.00	0.00
140	001323	慕思股份	73	3,581.38	0.00
141	688028	沃尔德	100	3,370.00	0.00
142	688088	虹软科技	100	3,159.00	0.00
143	601018	宁波港	700	2,730.00	0.00

144	688126	沪硅产业	100	2,298.00	0.00
145	688156	路德环境	100	2,133.00	0.00
146	688081	兴图新科	100	2,075.00	0.00
147	600765	中航重机	60	1,930.80	0.00
148	603773	沃格光电	100	1,600.00	0.00
149	688221	前沿生物	100	1,483.00	0.00
150	300416	苏试试验	60	1,474.80	0.00
151	000970	中科三环	75	1,408.50	0.00
152	688165	埃夫特	100	1,000.00	0.00
153	688585	上纬新材	100	966.00	0.00
154	300669	沪宁股份	100	944.00	0.00
155	688418	震有科技	100	940.00	0.00
156	688099	晶晨股份	9	909.00	0.00
157	688086	*ST 紫晶	109	768.45	0.00
158	603233	大参林	20	626.00	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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入 金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	688388	嘉元科技	30,967,512.13	12.64
2	002182	云海金属	26,255,797.45	10.72
3	300568	星源材质	25,513,983.16	10.41
4	688598	金博股份	22,668,251.97	9.25
5	002717	岭南股份	18,579,988.59	7.58
6	002539	云图控股	18,517,652.00	7.56
7	688037	芯源微	18,449,288.17	7.53
8	300073	当升科技	18,381,883.12	7.50
9	002291	星期六	18,248,897.00	7.45
10	605111	新洁能	17,913,809.21	7.31
11	603187	海容冷链	17,701,062.6	7.22



			0	
12	600481	双良节能	17,389,923.0	7.10
			0	
13	600596	新安股份	17,346,493.6	7.08
			4	
14	002042	华孚时尚	16,872,744.8	6.89
			8	
15	002245	蔚蓝锂芯	16,751,697.0	6.84
			4	
16	002436	兴森科技	16,621,313.2	6.78
			0	
17	600711	盛屯矿业	16,521,004.5	6.74
			3	
18	300769	德方纳米	16,302,670.4	6.65
			0	
19	603337	杰克股份	15,959,986.0	6.51
			5	
20	300803	指南针	15,948,891.8	6.51
			4	
21	002573	清新环境	15,125,017.3	6.17
			1	
22	688023	安恒信息	15,079,177.2	6.15
			5	
23	300590	移为通信	14,476,109.8	5.91
			2	
24	600499	科达制造	14,464,619.0	5.90
			0	
25	300616	尚品宅配	14,382,763.2	5.87
			5	
26	688033	天宜上佳	14,293,318.8	5.83
			2	
27	000683	远兴能源	14,281,799.0	5.83
			4	
28	603313	梦百合	14,267,564.2	5.82
			3	
29	002706	良信股份	14,034,319.2	5.73
			0	
30	603906	龙蟠科技	13,949,078.2	5.69
			0	
31	603489	八方股份	13,945,165.4	5.69
			0	
32	002597	金禾实业	13,842,614.0	5.65
			6	

33	300674	宇信科技	13,644,022.2 0	5.57
34	002850	科达利	13,320,960.0 0	5.44
35	300596	利安隆	13,296,975.3 2	5.43
36	300604	长川科技	13,083,404.9 0	5.34
37	600366	宁波韵升	12,990,136.0 0	5.30
38	300222	科大智能	12,935,573.5 8	5.28
39	002738	中矿资源	12,895,584.4 0	5.26
40	002218	拓日新能	12,706,572.0 0	5.19
41	300119	瑞普生物	12,618,077.0 0	5.15
42	600063	皖维高新	12,426,454.6 4	5.07
43	300639	凯普生物	12,213,048.4 8	4.98
44	601666	平煤股份	12,210,507.0 0	4.98
45	002389	航天彩虹	11,901,730.0 0	4.86
46	002407	多氟多	11,880,009.0 0	4.85
47	600328	中盐化工	11,879,443.0 0	4.85
48	688050	爱博医疗	11,745,898.3 0	4.79
49	600057	厦门象屿	11,477,737.3 2	4.68
50	600123	兰花科创	11,307,782.0 0	4.61
51	300083	创世纪	11,287,544.0 0	4.61
52	688508	芯朋微	11,239,244.7 8	4.59
53	300366	创意信息	11,201,268.6 2	4.57
54	601515	东风股份	11,141,278.2 0	4.55

55	300171	东富龙	11,088,656.00	4.53
56	688202	美迪西	11,036,242.72	4.50
57	600873	梅花生物	10,826,557.00	4.42
58	300409	道氏技术	10,623,674.83	4.34
59	002258	利尔化学	10,610,912.92	4.33
60	300055	万邦达	10,558,810.90	4.31
61	603565	中谷物流	10,454,779.23	4.27
62	002041	登海种业	10,437,536.00	4.26
63	688368	晶丰明源	10,378,172.38	4.24
64	002756	永兴材料	10,284,892.18	4.20
65	002025	航天电器	10,211,407.00	4.17
66	002254	泰和新材	10,096,337.61	4.12
67	603169	兰石重装	10,067,408.62	4.11
68	300768	迪普科技	9,989,304.06	4.08
69	300726	宏达电子	9,970,907.10	4.07
70	300224	正海磁材	9,884,041.01	4.03
71	002240	盛新锂能	9,859,955.00	4.02
72	002292	奥飞娱乐	9,803,283.00	4.00
73	300035	中科电气	9,780,270.00	3.99
74	300177	中海达	9,623,482.48	3.93
75	300390	天华超净	9,581,547.00	3.91
76	688106	金宏气体	9,480,579.78	3.87
77	600742	一汽富维	9,412,809.00	3.84
78	603595	东尼电子	9,394,797.00	3.83
79	688133	泰坦科技	9,337,732.67	3.81
80	688018	乐鑫科技	9,248,972.47	3.77
81	002837	英维克	9,232,360.50	3.77
82	002639	雪人股份	9,192,540.00	3.75
83	600295	鄂尔多斯	9,013,124.00	3.68
84	300476	胜宏科技	8,832,415.00	3.60

85	603129	春风动力	8,687,264.68	3.55
86	688122	西部超导	8,661,385.99	3.53
87	300432	富临精工	8,595,241.00	3.51
88	002859	洁美科技	8,421,446.00	3.44
89	300373	扬杰科技	8,305,315.00	3.39
90	002497	雅化集团	8,300,538.29	3.39
91	300428	立中集团	8,283,197.00	3.38
92	300775	三角防务	8,208,061.00	3.35
93	000032	深桑达 A	8,162,310.40	3.33
94	603896	寿仙谷	8,133,647.83	3.32
95	300767	震安科技	8,066,237.80	3.29
96	600456	宝钛股份	7,969,680.00	3.25
97	600305	恒顺醋业	7,895,614.00	3.22
98	603566	普莱柯	7,873,015.13	3.21
99	688301	奕瑞科技	7,791,080.26	3.18
100	688116	天奈科技	7,727,993.65	3.15
101	601908	京运通	7,627,411.00	3.11
102	000567	海德股份	7,561,813.64	3.09
103	300118	东方日升	7,516,905.53	3.07
104	600876	洛阳玻璃	7,511,604.30	3.07
105	002261	拓维信息	7,480,755.66	3.05
106	300102	乾照光电	7,465,401.00	3.05
107	300397	天和防务	7,406,463.00	3.02
108	000597	东北制药	7,381,665.98	3.01
109	300755	华致酒行	7,371,604.64	3.01
110	002267	陕天然气	7,325,666.00	2.99
111	600552	凯盛科技	7,294,986.00	2.98
112	300123	亚光科技	7,243,111.00	2.96
113	000762	西藏矿业	7,200,079.00	2.94
114	300401	花园生物	7,189,141.00	2.93
115	002635	安洁科技	7,173,109.00	2.93
116	000423	东阿阿胶	7,142,880.00	2.92
117	002993	奥海科技	7,121,080.80	2.91
118	300627	华测导航	7,049,981.37	2.88
119	600449	宁夏建材	6,987,718.77	2.85
120	000933	神火股份	6,929,735.00	2.83
121	688339	亿华通	6,823,685.12	2.78
122	300393	中来股份	6,823,312.00	2.78
123	002344	海宁皮城	6,811,354.00	2.78
124	300327	中颖电子	6,769,071.70	2.76
125	600395	盘江股份	6,575,506.00	2.68
126	002100	天康生物	6,545,048.75	2.67
127	600096	云天化	6,499,567.00	2.65

128	002895	川恒股份	6,493,086.53	2.65
129	600850	电科数字	6,485,094.49	2.65
130	000893	亚钾国际	6,477,606.00	2.64
131	603212	赛伍技术	6,428,440.00	2.62
132	600416	湘电股份	6,405,495.00	2.61
133	002847	盐津铺子	6,380,747.84	2.60
134	002792	通宇通讯	6,366,499.00	2.60
135	002312	川发龙蟒	6,321,072.65	2.58
136	600618	氯碱化工	6,300,232.00	2.57
137	002139	拓邦股份	6,224,988.88	2.54
138	688568	中科星图	6,209,377.94	2.53
139	600929	雪天盐业	6,152,881.00	2.51
140	603236	移远通信	6,137,876.00	2.50
141	000913	钱江摩托	6,091,606.50	2.49
142	601528	瑞丰银行	6,011,261.01	2.45
143	002043	兔宝宝	5,996,411.01	2.45
144	300485	赛升药业	5,977,312.00	2.44
145	603026	石大胜华	5,946,547.00	2.43
146	688516	奥特维	5,944,964.51	2.43
147	688016	心脉医疗	5,834,772.99	2.38
148	300666	江丰电子	5,829,991.53	2.38
149	603301	振德医疗	5,793,094.96	2.36
150	000025	特力 A	5,788,052.00	2.36
151	300857	协创数据	5,780,940.00	2.36
152	002838	道恩股份	5,736,205.00	2.34
153	600583	海油工程	5,733,933.00	2.34
154	300456	赛微电子	5,687,401.00	2.32
155	300458	全志科技	5,643,762.00	2.30
156	688520	神州细胞	5,539,908.91	2.26
157	002807	江阴银行	5,536,659.60	2.26
158	688200	华峰测控	5,520,178.69	2.25
159	002214	大立科技	5,460,926.20	2.23
160	605117	德业股份	5,413,008.00	2.21
161	002145	中核钛白	5,408,655.00	2.21
162	000560	我爱我家	5,369,029.00	2.19
163	688277	天智航	5,328,023.35	2.17
164	002421	达实智能	5,321,510.00	2.17
165	002585	双星新材	5,306,968.00	2.17
166	601677	明泰铝业	5,239,592.64	2.14
167	603222	济民医疗	5,220,977.00	2.13
168	603529	爱玛科技	5,165,267.00	2.11
169	300158	振东制药	5,147,727.00	2.10
170	600810	神马股份	5,132,155.00	2.09

171	002135	东南网架	5,110,118.72	2.09
172	002324	普利特	5,049,890.28	2.06
173	002262	恩华药业	5,037,096.86	2.06
174	300346	南大光电	5,031,854.48	2.05
175	600330	天通股份	4,951,756.20	2.02
176	002664	长鹰信质	4,946,187.00	2.02
177	605168	三人行	4,910,105.00	2.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出 金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002182	云海金属	24,066,152.0 2	9.82
2	688388	嘉元科技	23,206,164.7 9	9.47
3	300568	星源材质	20,637,005.2 8	8.42
4	688037	芯源微	19,697,803.3 6	8.04
5	300073	当升科技	18,847,875.0 0	7.69
6	002717	岭南股份	18,766,682.1 0	7.66
7	688598	金博股份	18,573,244.7 7	7.58
8	600596	新安股份	17,681,216.0 0	7.22
9	002291	星期六	17,674,367.1 6	7.21
10	002539	云图控股	17,558,002.2 2	7.17
11	300769	德方纳米	16,898,093.8 0	6.90
12	002042	华孚时尚	16,376,702.3 6	6.68
13	605111	新洁能	15,686,780.8 0	6.40
14	300803	指南针	15,598,621.3 9	6.37
15	002573	清新环境	14,823,927.1 3	6.05
16	688023	安恒信息	14,574,252.3	5.95

			5	
17	600481	双良节能	14,462,264.00	5.90
18	603187	海容冷链	14,396,535.18	5.88
19	600499	科达制造	14,338,695.04	5.85
20	000683	远兴能源	14,226,624.00	5.81
21	603906	龙蟠科技	14,021,189.40	5.72
22	002850	科达利	13,895,725.00	5.67
23	002292	奥飞娱乐	13,760,192.00	5.62
24	002597	金禾实业	13,628,906.00	5.56
25	300590	移为通信	13,318,300.64	5.44
26	002436	兴森科技	13,312,350.18	5.43
27	002738	中矿资源	13,238,577.00	5.40
28	300596	利安隆	13,114,453.77	5.35
29	300222	科大智能	12,558,826.38	5.13
30	300119	瑞普生物	12,505,396.07	5.10
31	600366	宁波韵升	12,415,623.00	5.07
32	002218	拓日新能	12,050,770.00	4.92
33	600063	皖维高新	12,028,817.79	4.91
34	300604	长川科技	12,015,313.16	4.90
35	002389	航天彩虹	11,952,876.18	4.88
36	601666	平煤股份	11,827,059.02	4.83
37	600711	盛屯矿业	11,826,196.00	4.83

38	300639	凯普生物	11,811,662.5 2	4.82
39	300366	创意信息	11,798,928.8 4	4.82
40	002706	良信股份	11,731,345.7 0	4.79
41	603337	杰克股份	11,651,096.0 0	4.75
42	688050	爱博医疗	11,600,064.4 4	4.73
43	002245	蔚蓝锂芯	11,539,991.0 0	4.71
44	600057	厦门象屿	11,184,907.0 0	4.56
45	300674	宇信科技	11,138,446.6 0	4.55
46	688202	美迪西	11,053,564.3 6	4.51
47	600123	兰花科创	11,050,684.0 0	4.51
48	601515	东风股份	10,864,460.8 2	4.43
49	688508	芯朋微	10,777,783.1 6	4.40
50	600873	梅花生物	10,744,440.0 0	4.38
51	002756	永兴材料	10,531,758.0 0	4.30
52	002258	利尔化学	10,507,467.0 1	4.29
53	603313	梦百合	10,413,631.3 8	4.25
54	688368	晶丰明源	10,322,687.7 3	4.21
55	300432	富临精工	10,294,559.0 0	4.20
56	002025	航天电器	10,190,864.0 0	4.16
57	603565	中谷物流	10,166,905.2 6	4.15
58	002041	登海种业	9,992,634.00	4.08
59	300616	尚品宅配	9,930,326.00	4.05
60	603595	东尼电子	9,840,431.00	4.02



61	688033	天宜上佳	9,779,605.64	3.99
62	300726	宏达电子	9,748,574.00	3.98
63	300409	道氏技术	9,691,599.00	3.96
64	300768	迪普科技	9,614,862.00	3.92
65	300035	中科电气	9,612,093.00	3.92
66	600742	一汽富维	9,514,485.48	3.88
67	002254	泰和新材	9,506,317.72	3.88
68	300224	正海磁材	9,495,135.00	3.88
69	600295	鄂尔多斯	9,477,140.00	3.87
70	002837	英维克	9,356,279.50	3.82
71	600328	中盐化工	9,306,612.12	3.80
72	002240	盛新锂能	9,292,376.00	3.79
73	688106	金宏气体	9,284,996.28	3.79
74	300476	胜宏科技	9,168,330.08	3.74
75	688133	泰坦科技	9,159,612.62	3.74
76	300390	天华超净	9,059,635.00	3.70
77	300055	万邦达	9,039,847.00	3.69
78	688018	乐鑫科技	8,884,638.66	3.63
79	002407	多氟多	8,837,851.00	3.61
80	300083	创世纪	8,593,369.00	3.51
81	688122	西部超导	8,392,271.73	3.42
82	603129	春风动力	8,268,056.36	3.37
83	603896	寿仙谷	8,134,969.68	3.32
84	002859	洁美科技	8,091,383.20	3.30
85	000032	深桑达 A	8,084,532.48	3.30
86	300775	三角防务	8,003,116.00	3.27
87	300767	震安科技	7,948,061.69	3.24
88	300373	扬杰科技	7,937,318.50	3.24
89	300102	乾照光电	7,844,007.70	3.20
90	002497	雅化集团	7,764,021.00	3.17
91	300428	立中集团	7,693,714.21	3.14
92	300177	中海达	7,612,132.00	3.11
93	688116	天奈科技	7,603,155.44	3.10
94	000597	东北制药	7,515,563.84	3.07
95	600456	宝钛股份	7,472,400.00	3.05
96	300123	亚光科技	7,430,274.00	3.03
97	000762	西藏矿业	7,388,564.99	3.02
98	601908	京运通	7,387,968.00	3.02
99	688301	奕瑞科技	7,281,076.38	2.97
100	300401	花园生物	7,253,014.17	2.96
101	002261	拓维信息	7,243,601.64	2.96
102	600449	宁夏建材	7,229,149.47	2.95
103	000567	海德股份	7,141,381.73	2.91

104	300397	天和防务	7,130,506.00	2.91
105	600305	恒顺醋业	7,095,715.90	2.90
106	002635	安洁科技	7,056,399.94	2.88
107	000423	东阿阿胶	7,035,815.00	2.87
108	300171	东富龙	7,022,530.00	2.87
109	600876	洛阳玻璃	6,988,691.45	2.85
110	300393	中来股份	6,947,371.00	2.84
111	600850	电科数字	6,910,974.66	2.82
112	002267	陕天然气	6,910,227.00	2.82
113	688339	亿华通	6,855,221.49	2.80
114	300755	华致酒行	6,747,079.00	2.75
115	600395	盘江股份	6,669,460.00	2.72
116	000933	神火股份	6,657,662.00	2.72
117	300627	华测导航	6,618,949.00	2.70
118	002344	海宁皮城	6,540,446.00	2.67
119	300327	中颖电子	6,537,433.00	2.67
120	600096	云天化	6,528,273.00	2.66
121	300485	赛升药业	6,520,709.42	2.66
122	002792	通宇通讯	6,342,784.00	2.59
123	000893	亚钾国际	6,305,676.49	2.57
124	600552	凯盛科技	6,246,515.73	2.55
125	603489	八方股份	6,243,541.00	2.55
126	002139	拓邦股份	6,230,645.00	2.54
127	002847	盐津铺子	6,134,690.50	2.50
128	000913	钱江摩托	6,117,550.00	2.50
129	002895	川恒股份	6,070,447.18	2.48
130	603212	赛伍技术	6,041,157.24	2.47
131	002312	川发龙蟒	6,022,542.03	2.46
132	601528	瑞丰银行	5,947,130.86	2.43
133	300458	全志科技	5,897,081.00	2.41
134	600618	氯碱化工	5,842,369.00	2.38
135	688516	奥特维	5,828,333.06	2.38
136	603236	移远通信	5,824,663.00	2.38
137	002043	兔宝宝	5,778,848.00	2.36
138	300857	协创数据	5,773,630.00	2.36
139	600929	雪天盐业	5,741,718.00	2.34
140	300158	振东制药	5,725,282.00	2.34
141	000025	特力 A	5,724,989.00	2.34
142	002838	道恩股份	5,708,272.00	2.33
143	600583	海油工程	5,707,146.00	2.33
144	603026	石大胜华	5,701,582.00	2.33
145	300456	赛微电子	5,603,182.00	2.29
146	002807	江阴银行	5,512,508.00	2.25

147	605117	德业股份	5,468,351.00	2.23
148	688200	华峰测控	5,426,226.48	2.21
149	002585	双星新材	5,410,263.00	2.21
150	688016	心脉医疗	5,382,596.68	2.20
151	688520	神州细胞	5,277,887.14	2.15
152	002421	达实智能	5,224,483.00	2.13
153	600810	神马股份	5,210,862.00	2.13
154	000560	我爱我家	5,169,286.00	2.11
155	688277	天智航	5,163,237.77	2.11
156	603529	爱玛科技	5,103,577.00	2.08
157	002135	东南网架	5,086,606.00	2.08
158	600330	天通股份	5,079,079.00	2.07
159	600480	凌云股份	5,073,065.56	2.07
160	002145	中核钛白	5,047,211.92	2.06
161	300346	南大光电	4,994,917.00	2.04
162	002324	普利特	4,969,932.00	2.03
163	300229	拓尔思	4,968,253.50	2.03
164	002262	恩华药业	4,952,138.81	2.02
165	601677	明泰铝业	4,914,371.74	2.01
166	002664	长鹰信质	4,914,002.54	2.01

#### 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	2,964,740,646.97
卖出股票收入（成交）总额	2,763,278,791.98

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

注：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

注：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

注：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

运用股指期货通过期现套利、跨期套利和跨品种套利等择机进行现货替代以及增厚收益，同时灵活调整组合敞口，控制回撤。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包含国债期货，无相关投资政策。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

无。

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

无。

### 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	2,342,194.40
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	7,365,030.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,707,224.96

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

#### 7.12.6 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.7 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600938	中国海油	1,332,303.44	0.54	流通受限股票

## § 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
兴银中证 1000 指数增强 A	2,813	55,127.91	8,196,563.03	5.2856%	146,878,241.98	94.7144%
兴银中证 1000 指数增强 C	2,452	34,018.28	334,334.26	0.4008%	83,078,489.81	99.5992%
合计	5,265	45,296.80	8,530,897.29	3.5771%	229,956,731.79	96.4229%

### 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	兴银中证 1000 指数增强 A	11,533.29	0.0074%
	兴银中证 1000 指数增强 C	311.25	0.0004%
	合计	11,844.54	0.0050%

### 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	兴银中证 1000 指数增强 A	0
	兴银中证 1000 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式 基金	兴银中证 1000 指数增强 A	0
	兴银中证 1000 指数增强 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	兴银中证 1000 指数增强 A	兴银中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日（2022 年 01 月 26 日） 基金份额总额	170,524,346.65	97,896,229.17
基金合同生效日起至报告期期末基金总 申购份额	26,043,156.18	40,710,492.84
减：基金合同生效日起至报告期期末基 金总赎回份额	41,492,697.82	55,193,897.94
基金合同生效日起至报告期期末基金拆 分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	155,074,805.01	83,412,824.07

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 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

(1) 2022 年 1 月 28 日，吴真子女士担任基金管理人督察长，余富材先生不再担任基金管理人督察长。

(2) 2022 年 2 月 28 日，沈阳女士担任基金管理人副总经理。

(3) 2022 年 8 月 25 日，吴真子女士不再担任基金管理人督察长，总经理赵建兴先生代为履行督察长职务。

(4) 报告期内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

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

#### 10.4 基金投资策略的改变

无。

#### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本年度由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金进行审计。

#### 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

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

#### 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	
华福证券	2	5,722,859.317.05	100.00%	1,717,158.42	100.00%	-

##### 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
华福证券	-	-	120,000.00	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	兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金基金份额发售公告、兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	证券时报	2022-01-07
2	兴银中证 1000 指数增强型证	指定网站	2022-01-07

	券投资基金基金合同、兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金托管协议、兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书、兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金基金份额发售公告、兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金基金产品资料概要		
3	关于《兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金基金份额发售公告》的更正公告	证券时报	2022-01-08
4	兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	证券时报、指定网站	2022-01-27
5	兴银基金管理有限责任公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、指定网站	2022-01-29
6	关于旗下基金参与中信建投费率优惠活动并开通定期定额投资的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、指定网站	2022-02-15
7	兴银基金管理有限责任公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、指定网站	2022-03-01
8	关于旗下基金在部分代销渠道开通转换、定期定额投资并参与费率优惠活动的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、指定网站	2022-03-31
9	兴银基金管理有限责任公司关于旗下全资子公司自有资金申购公司旗下基金的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报	2022-04-06
10	兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	证券时报、指定网站	2022-04-20
11	关于旗下部分基金在华福证券开通基金转换业务的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、指定网站	2022-04-22
12	兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	指定网站	2022-04-22
13	兴银基金管理有限责任公司旗下部分基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报	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

注：本基金本报告期内单一投资者持有基金份额比例未出现超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金变更注册的文件
2. 《兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》
3. 《兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金托管协议》
4. 《兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书》
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照
6. 报告期内在指定信息披露媒体上公开披露的各项公告

### 12.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处。

### 12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站（[www.hffunds.cn](http://www.hffunds.cn)）查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。投资者对本报告书如有疑问，可拨打客户服务中心电话（40000-96326）咨询本基金管理人。

兴银基金管理有限责任公司

二〇二二年八月三十一日