

兴银中证 500 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:浙商银行股份有限公司

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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人浙商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1日起至6月30日止。

1.2 目录

| | |
|--|-----------|
| § 1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| § 2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况..... | 5 |
| 2.2 基金产品说明..... | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 5 |
| 2.4 信息披露方式..... | 6 |
| 2.5 其他相关资料..... | 6 |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 6 |
| 3.2 基金净值表现..... | 7 |
| 3.3 其他指标..... | 8 |
| § 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..... | 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..... | 11 |
| 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..... | 12 |
| 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 |
| § 5 托管人报告 | 12 |
| 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 |
| § 6 半年度财务会计报告(未经审计) | 13 |
| 6.1 资产负债表..... | 13 |
| 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..... | 17 |
| § 7 投资组合报告 | 43 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 43 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合..... | 44 |
| 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..... | 57 |
| 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..... | 64 |
| 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..... | 64 |
| 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..... | 64 |
| 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..... | 64 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策..... | 64 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 64 |

| | |
|---|-----------|
| 7.12 投资组合报告附注..... | 64 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 65 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 65 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 66 |
| 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..... | 66 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 66 |
| § 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..... | 67 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 67 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 67 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 67 |
| 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..... | 67 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 67 |
| 10.8 其他重大事件..... | 68 |
| § 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 | 兴银中证 500 指数增强型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 兴银中证 500 指数增强 | |
| 基金主代码 | 010253 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2021 年 03 月 01 日 | |
| 基金管理人 | 兴银基金管理有限责任公司 | |
| 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 | 139,977,317.90 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 500 指数增强 A | 兴银中证 500 指数增强 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 010253 | 011205 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 37,964,019.31 份 | 102,013,298.59 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，力求实现超越标的指数的投资收益，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，追求获得超越标的指数的回报。本基金主要投资于中证 500 指数的成份股及备选成份股，为了获得超越指数的投资回报，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 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5% | |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，理论上其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数类似的风险收益特征。 | |
| 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 | 浙商银行股份有限公司 |
| 信息披露负 | 姓名 | 赵建兴 | 朱巍 |

| | | | |
|--------|------|---------------------------------------|---------------------|
| 责人 | 联系电话 | 86-21-20296318 | 0571-87659806 |
| | 电子邮箱 | zjx@hffunds.cn | zhuwei@czbank.com |
| 客户服务电话 | | 40000-96326 | 95527 |
| 传真 | | 86-21-68630069 | 0571-88268688 |
| 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 | 浙江省杭州市萧山区鸿宁路 1788 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 | 浙江省杭州市延安路 368 号 |
| 邮政编码 | | 200120 | 310006 |
| 法定代表人 | | 张贵云 | 张荣森（代为履行法定代表人职责） |

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

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|-----------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 证券时报 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | 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 01 日-2022 年 06 月 30 日） | |
|---------------|--|-----------------|
| | 兴银中证 500 指数增强 A | 兴银中证 500 指数增强 C |
| 本期已实现收益 | -7,913,632.30 | -36,632,737.77 |
| 本期利润 | -6,071,329.39 | -31,954,304.49 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.1441 | -0.1974 |

| | | |
|----------------------|------------------------|----------------|
| 本期加权平均净值利润率 | -14.26% | -19.53% |
| 本期基金份额净值增长率 | -11.22% | -11.31% |
| 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 | -728,215.07 | -2,278,100.92 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0192 | -0.0223 |
| 期末基金资产净值 | 39,021,799.30 | 104,519,182.71 |
| 期末基金份额净值 | 1.0279 | 1.0246 |
| 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 | 2.79% | 2.46% |

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 500 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 | 8.00% | 1.04% | 6.74% | 1.05% | 1.26% | -0.01% |
| 过去三个月 | 2.66% | 1.64% | 1.99% | 1.66% | 0.67% | -0.02% |
| 过去六个月 | -11.22% | 1.54% | -11.65% | 1.55% | 0.43% | -0.01% |
| 过去一年 | -4.75% | 1.31% | -4.83% | 1.26% | 0.08% | 0.05% |
| 自基金合同生效起至今 | 2.79% | 1.23% | 1.48% | 1.17% | 1.31% | 0.06% |

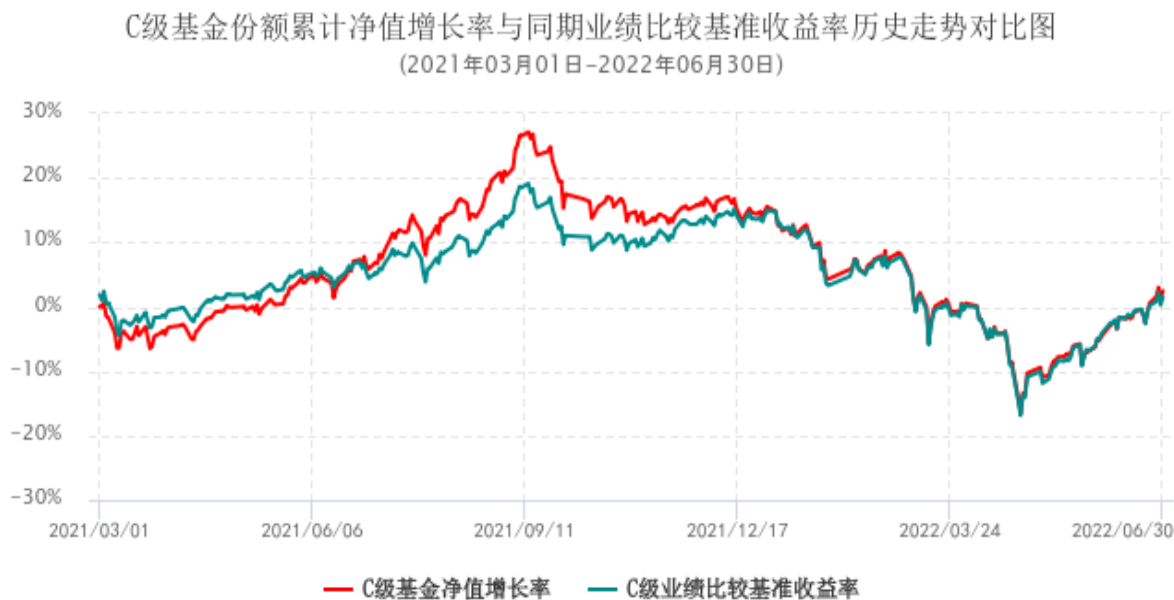
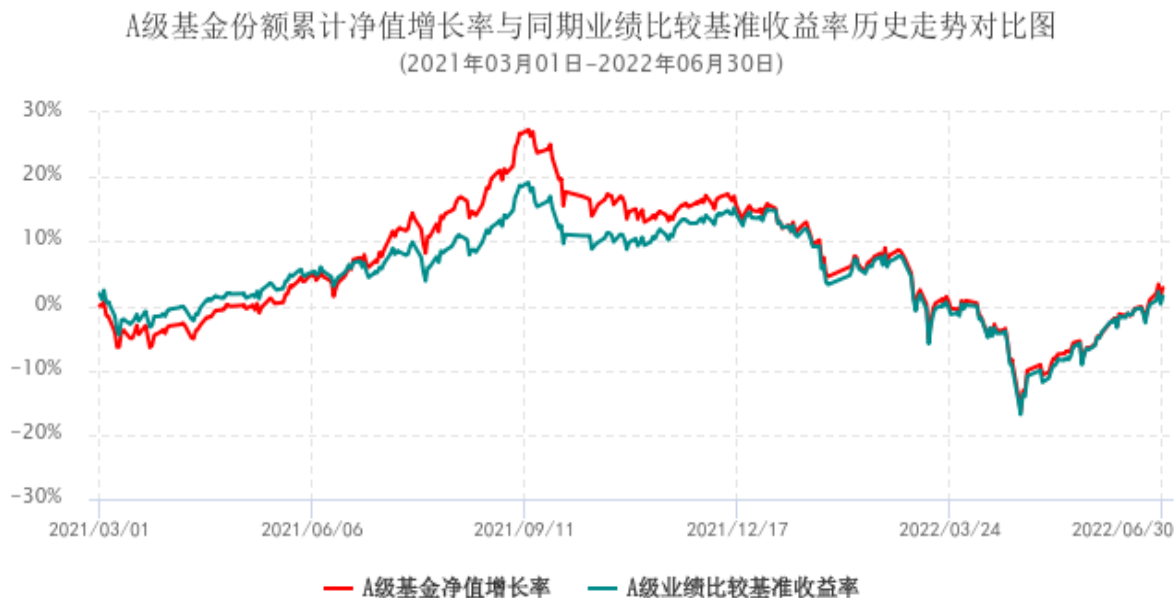
兴银中证 500 指数增强 C 净值表现

| 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 | 7.98% | 1.04% | 6.74% | 1.05% | 1.24% | -0.01% |
| 过去三个月 | 2.59% | 1.64% | 1.99% | 1.66% | 0.60% | -0.02% |
| 过去六个月 | -11.31% | 1.54% | -11.65% | 1.55% | 0.34% | -0.01% |
| 过去一年 | -4.94% | 1.31% | -4.83% | 1.26% | -0.11% | 0.05% |
| 自基金合同生效起至今 | 2.46% | 1.23% | 1.48% | 1.17% | 0.98% | 0.06% |

注：1、本基金成立于 2021 年 3 月 1 日；2、比较基准：中证 500 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



注：1、本基金成立于 2021 年 3 月 1 日；2、比较基准：中证 500 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。

3.3 其他指标

注：无。

§ 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 | 说明 |
|----|----|-------------|------|----|
|----|----|-------------|------|----|

| | | 任职日期 | 离任日期 | 年限 | |
|-----|----------|------------|------|------|---|
| 李哲通 | 本基金的基金经理 | 2021-03-01 | - | 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。 |
| 林学晨 | 本基金的基金经理 | 2021-07-16 | - | 7 年 | 硕士研究生，CFA 持证人，曾任湘财证券研究所金融工程分析师。2015 年 7 月加入兴银基金管理有限责任公司，历任兴银基金管理有限责任公司中央交易室衍生品交易员、衍生品业务部投资经理助理、投资经理；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；

林学晨先生为本基金的基金经理，任职日期为 2021 年 7 月 16 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

产品主要采用多因子选股策略。其中因子涵盖行业、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。团队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。在上述基础上，兼顾股票本身流动性和风险分散度的同时构建股票投资组合。策略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，同时严格按照策略执行交易管理及风控。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴银中证 500 指数增强 A 基金份额净值为 1.0279 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-11.22%，同期业绩比较基准收益率为-11.65%；截至报告期末兴银中证 500 指数增强 C 基金份额净值为 1.0246 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-11.31%，同期业绩比较基准收益率为-11.65%。

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

无。

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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 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 500 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 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------|-----------------------------|------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 14,998,117.51 | 28,649,673.67 |
| 结算备付金 | | 5,975,643.56 | 8,940,098.45 |
| 存出保证金 | | 2,034,778.61 | 3,385,843.18 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 121,587,039.28 | 238,703,091.57 |
| 其中：股票投资 | | 121,587,039.28 | 238,703,091.57 |
| 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 | 6.4.7.4 | - | - |
| 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 | | 840,480.62 | 8,123,896.32 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 288,438.68 | 1,268,601.53 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | - | 5,342.63 |
| 资产总计 | | 145,724,498.26 | 289,076,547.35 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2022 年 06 月 30 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |

| | | | |
|-------------|---------|----------------|----------------|
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付清算款 | | 1,015,552.97 | 8,034,350.09 |
| 应付赎回款 | | 439,384.30 | 1,051,697.57 |
| 应付管理人报酬 | | 92,876.35 | 188,032.07 |
| 应付托管费 | | 23,219.09 | 47,008.02 |
| 应付销售服务费 | | 16,852.76 | 37,884.84 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | - | 7,090.97 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 595,630.78 | 1,017,226.91 |
| 负债合计 | | 2,183,516.25 | 10,383,290.47 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 139,977,317.90 | 241,135,840.82 |
| 其他综合收益（若有） | | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | 3,563,664.11 | 37,557,416.06 |
| 净资产合计 | | 143,540,982.01 | 278,693,256.88 |
| 负债和净资产总计 | | 145,724,498.26 | 289,076,547.35 |

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 139,977,317.90 份。其中兴银中证 500 指数增强 A 基金份额净值 1.0279 元，基金份额总额 37,964,019.31 份；兴银中证 500 指数增强 C 基金份额净值 1.0246 元，基金份额总额 102,013,298.59 份。

6.2 利润表

会计主体：兴银中证 500 指数增强型证券投资基金

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 03 月 01 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日 |
|-----------------|---------|---------------------------------------|---|
| 一、营业总收入 | | -36,649,217.26 | 21,047,296.88 |
| 1. 利息收入 | | 73,246.17 | 48,147.39 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 72,426.99 | 45,277.57 |
| 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 | | 819.18 | 2,869.82 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填 | | -43,296,231.47 | 15,546,956.91 |

| | | | |
|----------------------------|------------|----------------|---------------|
| 列) | | | |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | -41,149,320.23 | 12,567,429.98 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 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 | -3,470,991.17 | 945,004.72 |
| 股利收益 | 6.4.7.15 | 1,324,079.93 | 2,034,522.21 |
| 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） | 6.4.7.16 | 6,520,736.19 | 5,313,605.86 |
| 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 | 53,031.85 | 138,586.72 |
| 减：二、营业总支出 | | 1,376,416.62 | 3,017,438.67 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 825,127.75 | 664,600.15 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 206,281.96 | 166,150.05 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 163,927.96 | 91,241.70 |
| 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 | | - | 3,402.03 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.18 | 181,078.95 | 2,092,044.74 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -38,025,633.88 | 18,029,858.21 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -38,025,633.88 | 18,029,858.21 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | 0 | 0 |
| 六、综合收益总额 | | -38,025,633.88 | 18,029,858.21 |

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：兴银中证 500 指数增强型证券投资基金

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 |
| | | | | |

| | | | | |
|--|---|------------|----------------|-----------------|
| | | (若有) | | |
| 一、上期期末净资产(基金净值) | 241,135,840.82 | - | 37,557,416.06 | 278,693,256.88 |
| 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) | 241,135,840.82 | - | 37,557,416.06 | 278,693,256.88 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -101,158,522.92 | - | -33,993,751.95 | -135,152,274.87 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | -38,025,633.88 | -38,025,633.88 |
| (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) | -101,158,522.92 | - | 4,031,881.93 | -97,126,640.99 |
| 其中: 1. 基金申购款 | 32,433,292.91 | - | 607,941.23 | 33,041,234.14 |
| 2. 基金赎回款 | -133,591,815.83 | - | 3,423,940.70 | -130,167,875.13 |
| (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) | 139,977,317.90 | - | 3,563,664.11 | 143,540,982.01 |
| 项 目 | 上年度可比期间 2021 年 03 月 01 日(基金合同生效日)至 2021 年 06 月 30 日 | | | |
| | 实收基金 | 其他综合收益(若有) | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产(基金净值) | 264,037,562.28 | - | - | 264,037,562.28 |
| 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) | 264,037,562.28 | - | - | 264,037,562.28 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -80,319,926.94 | - | 14,399,308.02 | -65,920,618.92 |

| | | | | |
|--|----------------|---|---------------|----------------|
| (一)、综合收益总额 | - | - | 18,029,858.21 | 18,029,858.21 |
| (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) | 80,319,926.94 | - | 3,630,550.19 | 83,950,477.13 |
| 其中: 1. 基金申购款 | 10,304,397.06 | - | 475,919.66 | 10,780,316.72 |
| 2. 基金赎回款 | 90,624,324.00 | - | 4,106,469.85 | 94,730,793.85 |
| (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) | 183,717,635.34 | - | 14,399,308.02 | 198,116,943.36 |

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 500 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证监许可(2020)3444 号注册募集。《兴银中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2021 年 3 月 1 日生效。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集规模为 264,037,562.28 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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》相关规定以及《兴银中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》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,含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、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）。本基金管理人根据相关法律法规可以参与融资及转融通证券出借业务。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。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率 \times 95%+银行活期存款利率（税后） \times 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要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日的财务状况、2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间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

除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

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

本基金自 2022 年度起执行了财政部发布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量（修订）》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移（修订）》、《企业会计准则第 24 号——套期会计（修订）》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报（修订）》（统称“新金融工具准则”）和 2022 年中国证监会发布的修订的《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〉》。

(a) 新金融工具准则

根据财政部发布的新金融工具准则相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，本基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

新金融工具准则修订了财政部于 2006 年颁布的《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》和《企业会计准则第 24 号——套期保值》以及财政部于 2014 年修订的《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“原金融工具准则”）。

新金价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产；及（3）以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在新金融工具准则下，金融资产的分类是基于本基金管理金融资产业务模式及该资产的融工具准则将金融资产划分为三个基本分类：（1）以摊余成本计量的金融资产；（2）以公允合同现金流量特征而确定。新金融工具准则取消了原金融工具准则中规定的持有至到期投资、贷款和应收款项及可供出售金融资产三个分类类别。根据新金融工具准则，嵌入衍生工具不再从金融资产的主合同中分拆出来，而是将混合金融工具整体适用关于金融资产分类的相关规定。

新金融工具准则以“预期信用损失”模型替代了原金融工具准则中的“已发生损失”模型。“预期信用损失”模型要求持续评估金融资产的信用风险，因此在新金融工具准则下，本基金信用损失的确认时点早于原金融工具准则。

本基金按照新金融工具准则的衔接规定，对新金融工具准则施行日（即 2022 年 1 月 1 日）未终止确认的金融工具的分类和计量（含减值）进行追溯调整。本基金未调整比较财务报表数据，将金融工具的原账面价值和在新金融工具准则施行日的新账面价值之间的差额计入 2022 年年初留存收益或其他综合收益。

执行新金融工具准则对 2022 年 1 月 1 日本基金资产负债表各项目的影影响汇总如下：

（i）金融工具的分类影响

以摊余成本计量的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息，对应的账面价值分别为人民币 28,649,673.67 元、8,940,098.45 元、3,385,843.18 元、5,342.63 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金，对应的账面价值分别为人民币 28,652,611.92 元、8,942,360.71 元、3,385,985.30 元。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币 238,703,091.57 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融

资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币 238,703,091.57 元。

以摊余成本计量的金融负债

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为应付交易费用、其他负债，对应的账面价值分别为人民币 658,179.46 元、359,047.45 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为其他负债，对应的账面价值分别为人民币 1,017,226.91 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等对应的应计利息余额均列示在应收利息或应付利息科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则，将上述应计利息分别转入银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订的《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>》

本基金根据修订的《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>》编制财务报表时，调整了部分财务报表科目的列报和披露，未对财务报表列报和披露产生重大影响。

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 | 14,998,117.51 |
| 等于：本金 | 14,996,653.08 |
| 加：应计利息 | 1,464.43 |
| 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 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备（若有） | - |
| 合计 | 14,998,117.51 |

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 | 113,533,138.13 | - | 121,587,039.28 | 8,053,901.15 |
| 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 | 113,533,138.13 | - | 121,587,039.28 | 8,053,901.15 |

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 | 12,543,360 | 0 | 0 | 股指期货 |
| 合计 | 12,543,360 | 0 | 0 | - |

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 | 10 | 12,869,200.00 | 325,840.00 |
| 合计 | | | | 325,840.00 |
| 减：可抵销期货暂收款 | | | | 325,840.00 |
| 净额 | | | | 0.00 |

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**

注：本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

注：无。

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 | 102.82 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 414,449.01 |
| 其中：交易所市场 | 414,449.01 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 81,078.95 |
| 指数使用费 | 100,000.00 |
| 合计 | 595,630.78 |

6.4.7.7 实收基金**兴银中证 500 指数增强 A**

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 47,028,780.71 | 47,028,780.71 |
| 本期申购 | 4,559,943.05 | 4,559,943.05 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -13,624,704.45 | -13,624,704.45 |
| 本期末 | 37,964,019.31 | 37,964,019.31 |

兴银中证 500 指数增强 C

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日 | |
|------|---------------------------------------|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 194,107,060.11 | 194,107,060.11 |

| | | |
|---------------|-----------------|-----------------|
| 本期申购 | 27,873,349.86 | 27,873,349.86 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -119,967,111.38 | -119,967,111.38 |
| 本期末 | 102,013,298.59 | 102,013,298.59 |

6.4.7.8 未分配利润

兴银中证 500 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 | 7,658,755.33 | -238,544.04 | 7,420,211.29 |
| 本期利润 | -7,913,632.30 | 1,842,302.91 | -6,071,329.39 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -473,338.10 | 182,236.19 | -291,101.91 |
| 其中：基金申购款 | 295,884.12 | -125,405.63 | 170,478.49 |
| 基金赎回款 | -769,222.22 | 307,641.82 | -461,580.40 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -728,215.07 | 1,785,995.06 | 1,057,779.99 |

兴银中证 500 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 | 31,114,879.14 | -977,674.37 | 30,137,204.77 |
| 本期利润 | -36,632,737.77 | 4,678,433.28 | -31,954,304.49 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 3,239,757.71 | 1,083,226.13 | 4,322,983.84 |
| 其中：基金申购款 | 1,202,907.32 | -765,444.58 | 437,462.74 |
| 基金赎回款 | 2,036,850.39 | 1,848,670.71 | 3,885,521.10 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -2,278,100.92 | 4,783,985.04 | 2,505,884.12 |

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 | 38,770.35 |
| 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 | 31,428.97 |
| 其他 | 2,227.67 |
| 合计 | 72,426.99 |

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 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 01 日至 2022 年 06 月 30 日 |
|----------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 2,279,662,095.65 |

| | |
|------------|------------------|
| 减：卖出股票成本总额 | 2,317,101,608.29 |
| 减：交易费用 | 3,709,807.59 |
| 买卖股票差价收入 | -41,149,320.23 |

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

注：无。

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.13 贵金属投资收益

6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.14.2 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 01 日至 2022 年 06 月 30 日 |
|----------|---|
| 股指期货投资收益 | -3,455,960.00 |
| 减：交易费用 | 15,031.17 |
| 合计 | -3,470,991.17 |

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 | 1,324,079.93 |
| 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 | 1,324,079.93 |

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 | 6,317,169.05 |
| ——股票投资 | 6,317,169.05 |
| ——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 | 199,520.00 |
| ——权证投资 | - |
| ——期货投资 | 199,520.00 |
| 3. 其他 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -4,047.14 |
| 合计 | 6,520,736.19 |

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 | 52,811.47 |
| 转换费收入 | 220.38 |
| 合计 | 53,031.85 |

6.4.7.18 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 | 21,571.58 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 指数使用费 | 100,000.00 |
| 合计 | 181,078.95 |

6.4.7.19 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。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

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

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

本报告期末不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

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 |
|--------------|-----------------------|
| 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 |
| 浙商银行股份有限公司 | 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 01 日至 2022 年 06 月 30 日 | | 上年度可比期间 2021 年 03 月 01 日（基金合同生效日）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 |
| 华福证券 | 1,773,414,134.07 | 39.71% | - | - |

6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

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 03 月 01 日（基金合同生效日）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 |
| 华福证券 | 10,000,000.00 | 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 |
| 华福证券 | 410,212.91 | 39.71% | 0.00 | 0.00% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2021 年 03 月 01 日（基金合同生效日）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 |
| 华福证券 | 0 | 0% | 0 | 0% |

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。权证交易不计佣金。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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 03 月 01 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日 |
|-----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 825,127.75 | 664,600.15 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 244,854.41 | 297,626.04 |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.8% 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 01 日至 2022 年 06 月 30 日 | 上年度可比期间 2021 年 03 月 01 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日 |
|----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 206,281.96 | 166,150.05 |

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 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 | | |
| | 兴银中证 500 指数增强 A | 兴银中证 500 指数增强 C | 合计 |
| 华福证券 | - | 1,761.59 | 1,761.59 |
| 兴银基金 | - | 60,911.75 | 60,911.75 |
| 浙商银行 | - | 3,689.95 | 3,689.95 |

| | | | |
|----------------|---|-----------------|-----------|
| 合计 | - | 66,363.29 | 66,363.29 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2021 年 03 月 01 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 兴银中证 500 指数增强 A | 兴银中证 500 指数增强 C | 合计 |
| 华福证券 | - | 3,617.33 | 3,617.33 |
| 兴银基金 | - | 744.47 | 744.47 |
| 浙商银行 | - | 8,493.80 | 8,493.80 |
| 合计 | - | 12,855.60 | 12,855.60 |

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与上年度可比期间均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及上年度末均未持有本基金。

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 01 日至 2022 年 06 月 30 日 | | 上年度可比期间 2021 年 03 月 01 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日 | |
|------------|--|-----------|---|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 浙商银行股份有限公司 | 14,998,117.51 | 38,770.35 | 23,876,938.35 | 32,686.70 |

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：本基金本报告期末未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无其他需要说明的关联交易事项。

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：本基金本报告期内未进行利润分配。

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

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 | - |
| 688046 | 药康生物 | 2022 年 04 月 14 日 | 6 个月 | 科创板新股锁定 | 22.53 | 26.24 | 5,538 | 124,771.14 | 145,317.12 | - |
| 688297 | 中无人机 | 2022 年 06 月 17 日 | 6 个月 | 科创板新股锁定 | 32.35 | 45.88 | 2,681 | 86,730.35 | 123,004.28 | - |
| 688295 | 中复神鹰 | 2022 年 03 月 28 日 | 6 个月 | 科创板新股锁定 | 29.33 | 34.42 | 3,350 | 98,255.50 | 115,307.00 | - |
| 688349 | 三一重能 | 2022 年 06 月 | 6 个月 | 科创板新 | 29.80 | 36.94 | 2,481 | 73,933.80 | 91,648.14 | - |

| | | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------------|------|---------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|--|
| | | 15 日 | | 股锁定 | | | | | | | |
| 301215 | 中汽股份 | 2022 年 02 月 28 日 | 6 个月 | 创业板新股锁定 | 3.80 | 6.39 | 2,698 | 10,252.40 | 17,240.22 | - | |
| 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 | 887 | 12,178.51 | 13,739.63 | - | |
| 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 | 417 | 7,998.06 | 13,373.19 | - | |
| 301263 | 泰恩康 | 2022 年 03 月 22 日 | 6 个月 | 创业板新股锁定 | 19.93 | 31.38 | 382 | 7,613.26 | 11,987.16 | - | |
| 301116 | 益客食品 | 2022 年 01 月 10 日 | 6 个月 | 创业板新股锁定 | 11.40 | 20.46 | 577 | 6,577.80 | 11,805.42 | - | |
| 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 | 520 | 11,091.60 | 11,720.80 | - | |
| 301122 | 采纳股份 | 2022 年 01 月 19 日 | 6 个月 | 创业板新股锁定 | 50.31 | 70.37 | 166 | 8,351.46 | 11,681.42 | - | |
| 301259 | 艾布鲁 | 2022 年 04 月 18 日 | 6 个月 | 创业板新股锁定 | 18.39 | 24.94 | 449 | 8,257.11 | 11,198.06 | - | |
| 301217 | 铜冠铜箔 | 2022 年 01 月 20 日 | 6 个月 | 创业板新股锁定 | 17.27 | 14.83 | 743 | 12,831.61 | 11,018.69 | - | |
| 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 | 200 | 9,026.00 | 10,822.00 | - | |
| 301117 | 佳缘科技 | 2022 年 01 月 | 6 个月 | 创业板新 | 46.80 | 54.44 | 191 | 8,938.80 | 10,398.04 | - | |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------------|------|---------|-------|-------|-----|----------|-----------|---|
| | | 07 日 | | 股锁定 | | | | | | |
| 301268 | 铭利达 | 2022 年 03 月 29 日 | 6 个月 | 创业板新股锁定 | 28.50 | 34.87 | 293 | 8,350.50 | 10,216.91 | - |
| 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 | 465 | 5,896.20 | 9,685.95 | - |
| 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 | 291 | 8,633.97 | 9,684.48 | - |
| 301256 | 华融化学 | 2022 年 03 月 14 日 | 6 个月 | 创业板新股锁定 | 8.05 | 10.08 | 936 | 7,534.80 | 9,434.88 | - |
| 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 | - |
| 301201 | 诚达药业 | 2022 年 01 月 12 日 | 6 个月 | 创业板新股锁定 | 72.69 | 71.54 | 126 | 9,158.94 | 9,014.04 | - |
| 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 | - |
| 301130 | 西点药业 | 2022 年 02 月 16 日 | 6 个月 | 创业板新股锁定 | 22.55 | 37.70 | 237 | 5,344.35 | 8,934.90 | - |
| 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 | 174 | 9,112.38 | 8,322.42 | - |
| 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 | 289 | 6,499.61 | 7,924.38 | - |
| 301286 | 侨源股份 | 2022 年 06 月 | 6 个月 | 创业板新 | 16.91 | 19.79 | 398 | 6,730.18 | 7,876.42 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------------|------|---------|--------|-------|-----|-----------|----------|---|
| | | 06 日 | | 股锁定 | | | | | | |
| 301158 | 德石股份 | 2022 年 01 月 07 日 | 6 个月 | 创业板新股锁定 | 15.64 | 20.38 | 379 | 5,927.56 | 7,724.02 | - |
| 301228 | 实朴检测 | 2022 年 01 月 21 日 | 6 个月 | 创业板新股锁定 | 20.08 | 20.34 | 373 | 7,489.84 | 7,586.82 | - |
| 301137 | 哈焊华通 | 2022 年 03 月 14 日 | 6 个月 | 创业板新股锁定 | 15.37 | 15.99 | 468 | 7,193.16 | 7,483.32 | - |
| 301236 | 软通动力 | 2022 年 03 月 08 日 | 6 个月 | 创业板新股锁定 | 48.69 | 31.38 | 238 | 11,587.92 | 7,468.44 | - |
| 301206 | 三元生物 | 2022 年 01 月 26 日 | 6 个月 | 创业板新股锁定 | 73.09 | 45.69 | 160 | 11,695.10 | 7,310.40 | - |
| 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 | 242 | 9,454.94 | 7,228.54 | - |
| 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 | 229 | 8,170.72 | 6,833.36 | - |
| 301103 | 何氏眼科 | 2022 年 03 月 14 日 | 6 个月 | 创业板新股锁定 | 32.64 | 32.02 | 207 | 6,757.50 | 6,628.14 | - |
| 301150 | 中一科技 | 2022 年 04 月 14 日 | 6 个月 | 创业板新股锁定 | 109.04 | 82.76 | 78 | 8,505.12 | 6,455.28 | - |
| 301109 | 军信股份 | 2022 年 04 月 06 日 | 6 个月 | 创业板新股锁定 | 23.21 | 16.14 | 396 | 9,189.84 | 6,391.44 | - |
| 301222 | 浙江恒威 | 2022 年 03 月 | 6 个月 | 创业板新 | 33.98 | 28.96 | 211 | 7,169.78 | 6,110.56 | - |

| | | | | | | | | | | |
|------------|----------|------------------------|------|---------------------|-----------|-----------|-----|--------------|--------------|---|
| | | 02 日 | | 股锁 定 | | | | | | |
| 3011 48 | 嘉戎 技术 | 2022 年 04 月 14 日 | 6 个月 | 创业 板新 股锁 定 | 38.3 9 | 23.9 0 | 245 | 9,405. 55 | 5,855. 50 | - |
| 3012 58 | 富士 莱 | 2022 年 03 月 21 日 | 6 个月 | 创业 板新 股锁 定 | 48.3 0 | 41.6 8 | 136 | 6,568. 80 | 5,668. 48 | - |
| 3011 51 | 冠龙 节能 | 2022 年 03 月 30 日 | 6 个月 | 创业 板新 股锁 定 | 30.8 2 | 21.4 6 | 263 | 8,105. 66 | 5,643. 98 | - |
| 3011 23 | 奕东 电子 | 2022 年 01 月 14 日 | 6 个月 | 创业 板新 股锁 定 | 37.2 3 | 25.3 9 | 219 | 8,153. 37 | 5,560. 41 | - |
| 3011 35 | 瑞德 智能 | 2022 年 04 月 01 日 | 6 个月 | 创业 板新 股锁 定 | 31.9 8 | 26.2 6 | 211 | 6,747. 78 | 5,540. 86 | - |
| 3012 79 | 金道 科技 | 2022 年 04 月 06 日 | 6 个月 | 创业 板新 股锁 定 | 31.2 0 | 22.8 1 | 241 | 7,519. 20 | 5,497. 21 | - |
| 3012 37 | 和顺 科技 | 2022 年 03 月 16 日 | 6 个月 | 创业 板新 股锁 定 | 56.6 9 | 41.8 6 | 131 | 7,426. 39 | 5,483. 66 | - |
| 3012 07 | 华兰 疫苗 | 2022 年 02 月 10 日 | 6 个月 | 创业 板新 股锁 定 | 56.8 8 | 56.4 2 | 97 | 5,517. 36 | 5,472. 74 | - |
| 3011 81 | 标榜 股份 | 2022 年 02 月 11 日 | 6 个月 | 创业 板新 股锁 定 | 40.2 5 | 30.5 9 | 176 | 7,084. 00 | 5,383. 84 | - |
| 3012 19 | 腾远 钴业 | 2022 年 03 月 10 日 | 6 个月 | 创业 板新 股锁 定 | 95.9 9 | 87.8 2 | 58 | 5,567. 36 | 5,093. 56 | - |
| 3008 34 | 星辉 环材 | 2022 年 01 月 | 6 个月 | 创业 板新 | 55.5 7 | 30.0 3 | 149 | 8,279. 93 | 4,474. 47 | - |

| | | | | | | | | | | |
|------------|----------|------------------------|------|---------------------|-----------|-----------|-----|--------------|--------------|---|
| | | 06 日 | | 股锁 定 | | | | | | |
| 3011 10 | 青木 股份 | 2022 年 03 月 04 日 | 6 个月 | 创业 板新 股锁 定 | 63.1 0 | 39.8 5 | 107 | 6,751. 70 | 4,263. 95 | - |
| 3011 96 | 唯科 科技 | 2022 年 01 月 04 日 | 6 个月 | 创业 板新 股锁 定 | 64.0 8 | 37.5 2 | 82 | 5,254. 56 | 3,076. 64 | - |

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

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

注：截至本报告期末，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

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：本基金于本报告期末和上年度末未持有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：本基金本报告期末和上年度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：本基金本报告期末和上年度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：本基金于本报告期末和上年度末未持有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：本基金本报告期末和上年度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：本基金本报告期末和上年度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有金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

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 | 14,998,117.51 | - | - | - | - | - | 14,998,117.51 |
| 结算备付金 | 5,975,643.56 | - | - | - | - | - | 5,975,643.56 |

| | | | | | | | |
|-----------------------|---------------|--------|----------|-------|-------|----------------|----------------|
| 存出保证金 | 2,034,778.61 | - | - | - | - | - | 2,034,778.61 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | 121,587,039.28 | 121,587,039.28 |
| 应收清算款 | - | - | - | - | - | 840,480.62 | 840,480.62 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 288,438.68 | 288,438.68 |
| 资产总计 | 23,008,539.68 | - | - | - | - | 122,715,958.58 | 145,724,498.26 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付清算款 | - | - | - | - | - | 1,015,552.97 | 1,015,552.97 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 439,384.30 | 439,384.30 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 92,876.35 | 92,876.35 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 23,219.09 | 23,219.09 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 16,852.76 | 16,852.76 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 595,630.78 | 595,630.78 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 2,183,516.25 | 2,183,516.25 |
| 利率敏感度缺口 | 23,008,539.68 | - | - | - | - | 120,532,442.33 | 143,540,982.01 |
| 上年度末 2021 年 12 月 31 日 | 1 个月以内 | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 28,649,673.67 | - | - | - | - | - | 28,649,673.67 |
| 结算备付金 | 8,940,098.45 | - | - | - | - | - | 8,940,098.45 |
| 存出保证金 | 3,385,843.18 | - | - | - | - | - | 3,385,843.18 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | 238,703,091.57 | 238,703,091.57 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 8,123,896.32 | 8,123,896.32 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 5,342.63 | 5,342.63 |

| | | | | | | | |
|---------|---------------|---|---|---|---|----------------|----------------|
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 1,268,601.53 | 1,268,601.53 |
| 资产总计 | 40,975,615.30 | - | - | - | - | 248,100,932.05 | 289,076,547.35 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | 8,034,350.09 | 8,034,350.09 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 1,051,697.57 | 1,051,697.57 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 188,032.07 | 188,032.07 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 47,008.02 | 47,008.02 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 37,884.84 | 37,884.84 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 7,090.97 | 7,090.97 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 1,017,226.91 | 1,017,226.91 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 10,383,290.47 | 10,383,290.47 |
| 利率敏感度缺口 | 40,975,615.30 | - | - | - | - | 237,717,641.58 | 278,693,256.88 |

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 | 上年度末 2021 年 12 月 31 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。

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。

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 | 121,587,039.28 | 84.71 | 238,703,091.57 | 85.65 |
| 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 | 121,587,039.28 | 84.71 | 238,703,091.57 | 85.65 |

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 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
| | 沪深 300 指数上涨 5% | 5,468,783.49 | 7,286,949.76 |
| | 沪深 300 指数下跌 5% | -5,468,783.49 | -7,286,949.76 |

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 2021 年 12 月 31 日 |
|---------------|----------------------|-----------------------|
| 第一层次 | 119,401,158.30 | 237,450,252.16 |
| 第二层次 | 2,185,880.98 | 1,252,839.41 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 121,587,039.28 | 238,703,091.57 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

无。

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 | 121,587,039.28 | 83.44 |
| | 其中：股票 | 121,587,039.28 | 83.44 |
| 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 | 20,973,761.07 | 14.39 |
| 8 | 其他各项资产 | 3,163,697.91 | 2.17 |
| 9 | 合计 | 145,724,498.26 | 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 | 783,314.00 | 0.55 |
| B | 采矿业 | 6,245,502.40 | 4.35 |
| C | 制造业 | 57,577,006.34 | 40.11 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,660,659.00 | 1.85 |
| E | 建筑业 | 3,128,373.83 | 2.18 |
| F | 批发和零售业 | 2,226,682.07 | 1.55 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 4,912,058.00 | 3.42 |
| H | 住宿和餐饮业 | 419,120.00 | 0.29 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 9,356,924.75 | 6.52 |
| J | 金融业 | 2,987,395.29 | 2.08 |
| K | 房地产业 | 2,421,898.77 | 1.69 |
| L | 租赁和商务服务业 | 688,630.00 | 0.48 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 352,780.00 | 0.25 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 196,039.30 | 0.14 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 1,492,800.00 | 1.04 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 1,263,357.15 | 0.88 |
| S | 综合 | 1,330,520.00 | 0.93 |
| | 合计 | 98,043,060.90 | 68.30 |

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 | 60,168.00 | 0.04 |
| B | 采矿业 | 2,135,068.06 | 1.49 |
| C | 制造业 | 16,817,828.76 | 11.72 |

| | | | |
|---|------------------|---------------|-------|
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 412,521.00 | 0.29 |
| E | 建筑业 | 69,737.02 | 0.05 |
| F | 批发和零售业 | 73,866.55 | 0.05 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 371,525.53 | 0.26 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 915,820.45 | 0.64 |
| J | 金融业 | 1,156,495.71 | 0.81 |
| K | 房地产业 | 390,574.00 | 0.27 |
| L | 租赁和商务服务业 | 47,770.20 | 0.03 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 381,953.96 | 0.27 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 23,445.00 | 0.02 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | 44,400.00 | 0.03 |
| Q | 卫生和社会工作 | 579,684.14 | 0.40 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 63,120.00 | 0.04 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 23,543,978.38 | 16.40 |

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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 | 300037 | 新宙邦 | 35,940 | 1,889,006.40 | 1.32 |
| 2 | 600522 | 中天科技 | 81,600 | 1,884,960.00 | 1.31 |
| 3 | 603613 | 国联股份 | 20,195 | 1,789,277.00 | 1.25 |
| 4 | 600497 | 驰宏锌锗 | 318,624 | 1,653,658.56 | 1.15 |
| 5 | 600160 | 巨化股份 | 123,970 | 1,630,205.50 | 1.14 |
| 6 | 603605 | 珀莱雅 | 9,820 | 1,622,067.60 | 1.13 |
| 7 | 603868 | 飞科电器 | 21,200 | 1,605,900.00 | 1.12 |
| 8 | 600732 | 爱旭股份 | 48,300 | 1,594,866.00 | 1.11 |
| 9 | 601872 | 招商轮船 | 267,700 | 1,541,952.00 | 1.07 |
| 10 | 600867 | 通化东宝 | 146,200 | 1,511,708.00 | 1.05 |
| 11 | 300244 | 迪安诊断 | 48,000 | 1,492,800.00 | 1.04 |
| 12 | 600486 | 扬农化工 | 11,100 | 1,479,408.00 | 1.03 |
| 13 | 600765 | 中航重机 | 44,620 | 1,435,871.60 | 1.00 |
| 14 | 603345 | 安井食品 | 8,500 | 1,426,895.00 | 0.99 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 15 | 600863 | 内蒙华电 | 372,500 | 1,359,625.00 | 0.95 |
| 16 | 600673 | 东阳光 | 148,000 | 1,330,520.00 | 0.93 |
| 17 | 600256 | 广汇能源 | 125,800 | 1,325,932.00 | 0.92 |
| 18 | 603317 | 天味食品 | 46,566 | 1,325,734.02 | 0.92 |
| 19 | 600233 | 圆通速递 | 64,100 | 1,306,999.00 | 0.91 |
| 20 | 601128 | 常熟银行 | 165,800 | 1,266,712.00 | 0.88 |
| 21 | 300182 | 捷成股份 | 229,700 | 1,263,350.00 | 0.88 |
| 22 | 300009 | 安科生物 | 119,600 | 1,209,156.00 | 0.84 |
| 23 | 600728 | 佳都科技 | 186,300 | 1,203,498.00 | 0.84 |
| 24 | 600970 | 中材国际 | 122,754 | 1,189,486.26 | 0.83 |
| 25 | 688099 | 晶晨股份 | 11,760 | 1,187,760.00 | 0.83 |
| 26 | 300257 | 开山股份 | 77,800 | 1,163,888.00 | 0.81 |
| 27 | 300253 | 卫宁健康 | 132,000 | 1,158,960.00 | 0.81 |
| 28 | 000970 | 中科三环 | 60,375 | 1,133,842.50 | 0.79 |
| 29 | 600667 | 太极实业 | 149,400 | 1,102,572.00 | 0.77 |
| 30 | 002572 | 索菲亚 | 39,300 | 1,080,750.00 | 0.75 |
| 31 | 600839 | 四川长虹 | 357,800 | 1,030,464.00 | 0.72 |
| 32 | 600582 | 天地科技 | 214,800 | 1,026,744.00 | 0.72 |
| 33 | 002191 | 劲嘉股份 | 88,500 | 948,720.00 | 0.66 |
| 34 | 001914 | 招商积余 | 48,381 | 869,406.57 | 0.61 |
| 35 | 000778 | 新兴铸管 | 175,600 | 846,392.00 | 0.59 |
| 36 | 002507 | 涪陵榨菜 | 24,000 | 828,480.00 | 0.58 |
| 37 | 000983 | 山西焦煤 | 59,700 | 799,383.00 | 0.56 |
| 38 | 002468 | 申通快递 | 65,400 | 779,568.00 | 0.54 |
| 39 | 600195 | 中牧股份 | 59,800 | 733,148.00 | 0.51 |
| 40 | 002673 | 西部证券 | 105,000 | 686,700.00 | 0.48 |
| 41 | 000729 | 燕京啤酒 | 59,200 | 571,872.00 | 0.40 |
| 42 | 600859 | 王府井 | 22,000 | 571,560.00 | 0.40 |
| 43 | 000738 | 航发控制 | 19,800 | 556,380.00 | 0.39 |
| 44 | 002815 | 崇达技术 | 42,500 | 544,425.00 | 0.38 |
| 45 | 600718 | 东软集团 | 46,900 | 539,819.00 | 0.38 |
| 46 | 000519 | 中兵红箭 | 18,500 | 539,275.00 | 0.38 |
| 47 | 002396 | 星网锐捷 | 23,400 | 529,776.00 | 0.37 |
| 48 | 000629 | 攀钢钒钛 | 128,700 | 489,060.00 | 0.34 |
| 49 | 603198 | 迎驾贡酒 | 7,400 | 482,036.00 | 0.34 |
| 50 | 600026 | 中远海能 | 46,300 | 478,279.00 | 0.33 |
| 51 | 300363 | 博腾股份 | 5,900 | 460,141.00 | 0.32 |
| 52 | 000999 | 华润三九 | 10,100 | 454,500.00 | 0.32 |
| 53 | 002078 | 太阳纸业 | 36,900 | 454,239.00 | 0.32 |
| 54 | 600141 | 兴发集团 | 10,300 | 453,097.00 | 0.32 |
| 55 | 603355 | 莱克电气 | 17,917 | 452,045.91 | 0.31 |
| 56 | 603983 | 丸美股份 | 16,800 | 450,240.00 | 0.31 |
| 57 | 600325 | 华发股份 | 59,100 | 447,387.00 | 0.31 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|---------|------------|------|
| 58 | 002444 | 巨星科技 | 23,600 | 444,624.00 | 0.31 |
| 59 | 002831 | 裕同科技 | 15,000 | 443,250.00 | 0.31 |
| 60 | 600435 | 北方导航 | 51,042 | 439,982.04 | 0.31 |
| 61 | 002233 | 塔牌集团 | 49,600 | 438,960.00 | 0.31 |
| 62 | 600039 | 四川路桥 | 41,604 | 438,090.12 | 0.31 |
| 63 | 600060 | 海信视像 | 34,900 | 436,250.00 | 0.30 |
| 64 | 002368 | 太极股份 | 22,700 | 436,067.00 | 0.30 |
| 65 | 000559 | 万向钱潮 | 73,000 | 433,620.00 | 0.30 |
| 66 | 600027 | 华电国际 | 110,100 | 432,693.00 | 0.30 |
| 67 | 600258 | 首旅酒店 | 16,900 | 419,120.00 | 0.29 |
| 68 | 002081 | 金螳螂 | 78,300 | 397,764.00 | 0.28 |
| 69 | 002180 | 纳思达 | 7,800 | 394,836.00 | 0.28 |
| 70 | 600315 | 上海家化 | 8,800 | 376,200.00 | 0.26 |
| 71 | 600348 | 华阳股份 | 24,200 | 374,132.00 | 0.26 |
| 72 | 603883 | 老百姓 | 10,990 | 372,341.20 | 0.26 |
| 73 | 601615 | 明阳智能 | 10,949 | 370,076.20 | 0.26 |
| 74 | 600392 | 盛和资源 | 16,100 | 363,860.00 | 0.25 |
| 75 | 603456 | 九洲药业 | 7,000 | 361,900.00 | 0.25 |
| 76 | 002244 | 滨江集团 | 41,800 | 361,570.00 | 0.25 |
| 77 | 601636 | 旗滨集团 | 28,310 | 360,952.50 | 0.25 |
| 78 | 002508 | 老板电器 | 10,000 | 360,300.00 | 0.25 |
| 79 | 002372 | 伟星新材 | 14,920 | 358,676.80 | 0.25 |
| 80 | 002439 | 启明星辰 | 17,900 | 356,747.00 | 0.25 |
| 81 | 600885 | 宏发股份 | 8,500 | 355,725.00 | 0.25 |
| 82 | 603218 | 日月股份 | 13,900 | 353,060.00 | 0.25 |
| 83 | 002557 | 洽洽食品 | 6,200 | 352,966.00 | 0.25 |
| 84 | 603127 | 昭衍新药 | 3,100 | 352,780.00 | 0.25 |
| 85 | 600549 | 厦门钨业 | 16,300 | 352,406.00 | 0.25 |
| 86 | 600801 | 华新水泥 | 18,000 | 351,180.00 | 0.24 |
| 87 | 603077 | 和邦生物 | 82,200 | 350,172.00 | 0.24 |
| 88 | 603444 | 吉比特 | 900 | 349,200.00 | 0.24 |
| 89 | 300285 | 国瓷材料 | 9,700 | 348,424.00 | 0.24 |
| 90 | 002867 | 周大生 | 22,400 | 347,872.00 | 0.24 |
| 91 | 002603 | 以岭药业 | 14,300 | 347,490.00 | 0.24 |
| 92 | 300699 | 光威复材 | 5,900 | 347,333.00 | 0.24 |
| 93 | 300482 | 万孚生物 | 8,491 | 345,668.61 | 0.24 |
| 94 | 600153 | 建发股份 | 26,400 | 345,048.00 | 0.24 |
| 95 | 002010 | 传化智联 | 53,600 | 344,648.00 | 0.24 |
| 96 | 601156 | 东航物流 | 17,400 | 344,520.00 | 0.24 |
| 97 | 002409 | 雅克科技 | 6,200 | 344,162.00 | 0.24 |
| 98 | 002299 | 圣农发展 | 17,900 | 343,322.00 | 0.24 |
| 99 | 600516 | 方大炭素 | 45,100 | 342,760.00 | 0.24 |
| 100 | 000553 | 安道麦 A | 28,300 | 342,713.00 | 0.24 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 101 | 000830 | 鲁西化工 | 19,800 | 342,342.00 | 0.24 |
| 102 | 000401 | 冀东水泥 | 32,539 | 342,310.28 | 0.24 |
| 103 | 601958 | 金铂股份 | 38,700 | 342,108.00 | 0.24 |
| 104 | 300618 | 寒锐钴业 | 5,900 | 341,728.00 | 0.24 |
| 105 | 002948 | 青岛银行 | 94,300 | 341,366.00 | 0.24 |
| 106 | 600372 | 中航电子 | 17,600 | 341,264.00 | 0.24 |
| 107 | 000630 | 铜陵有色 | 104,656 | 341,178.56 | 0.24 |
| 108 | 600507 | 方大特钢 | 48,800 | 341,112.00 | 0.24 |
| 109 | 000887 | 中鼎股份 | 18,696 | 341,015.04 | 0.24 |
| 110 | 002128 | 电投能源 | 23,800 | 340,816.00 | 0.24 |
| 111 | 600546 | 山煤国际 | 17,500 | 340,550.00 | 0.24 |
| 112 | 000932 | 华菱钢铁 | 66,900 | 340,521.00 | 0.24 |
| 113 | 002250 | 联化科技 | 20,800 | 340,496.00 | 0.24 |
| 114 | 600282 | 南钢股份 | 108,060 | 340,389.00 | 0.24 |
| 115 | 601139 | 深圳燃气 | 49,000 | 340,060.00 | 0.24 |
| 116 | 000998 | 隆平高科 | 20,400 | 339,864.00 | 0.24 |
| 117 | 600398 | 海澜之家 | 71,500 | 339,625.00 | 0.24 |
| 118 | 600985 | 淮北矿业 | 23,300 | 339,248.00 | 0.24 |
| 119 | 601699 | 潞安环能 | 23,200 | 339,184.00 | 0.24 |
| 120 | 002705 | 新宝股份 | 15,416 | 338,997.84 | 0.24 |
| 121 | 300308 | 中际旭创 | 10,900 | 338,445.00 | 0.24 |
| 122 | 002385 | 大北农 | 43,246 | 337,751.26 | 0.24 |
| 123 | 600529 | 山东药玻 | 12,000 | 335,400.00 | 0.23 |
| 124 | 000937 | 冀中能源 | 44,900 | 334,954.00 | 0.23 |
| 125 | 601717 | 郑煤机 | 23,215 | 334,528.15 | 0.23 |
| 126 | 603786 | 科博达 | 5,360 | 330,015.20 | 0.23 |
| 127 | 002153 | 石基信息 | 20,780 | 329,778.60 | 0.23 |
| 128 | 600415 | 小商品城 | 44,100 | 245,637.00 | 0.17 |
| 129 | 000598 | 兴蓉环境 | 45,900 | 234,549.00 | 0.16 |
| 130 | 688188 | 柏楚电子 | 934 | 205,517.36 | 0.14 |
| 131 | 002407 | 多氟多 | 4,200 | 205,422.00 | 0.14 |
| 132 | 603885 | 吉祥航空 | 11,300 | 203,287.00 | 0.14 |
| 133 | 603517 | 绝味食品 | 3,500 | 202,370.00 | 0.14 |
| 134 | 000012 | 南玻 A | 26,900 | 199,598.00 | 0.14 |
| 135 | 002155 | 湖南黄金 | 16,400 | 199,096.00 | 0.14 |
| 136 | 000997 | 新大陆 | 14,800 | 195,508.00 | 0.14 |
| 137 | 600699 | 均胜电子 | 12,300 | 193,233.00 | 0.13 |
| 138 | 002156 | 通富微电 | 12,342 | 190,066.80 | 0.13 |
| 139 | 000623 | 吉林敖东 | 12,400 | 183,024.00 | 0.13 |
| 140 | 000960 | 锡业股份 | 10,844 | 181,853.88 | 0.13 |
| 141 | 002353 | 杰瑞股份 | 4,400 | 177,320.00 | 0.12 |
| 142 | 600597 | 光明乳业 | 12,800 | 161,664.00 | 0.11 |
| 143 | 000402 | 金融街 | 26,600 | 158,270.00 | 0.11 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 144 | 000807 | 云铝股份 | 14,900 | 147,212.00 | 0.10 |
| 145 | 601608 | 中信重工 | 30,000 | 113,700.00 | 0.08 |
| 146 | 688088 | 虹软科技 | 3,451 | 109,017.09 | 0.08 |
| 147 | 000959 | 首钢股份 | 22,610 | 107,623.60 | 0.07 |
| 148 | 000089 | 深圳机场 | 13,900 | 107,308.00 | 0.07 |
| 149 | 300724 | 捷佳伟创 | 1,200 | 107,220.00 | 0.07 |
| 150 | 601869 | 长飞光纤 | 3,400 | 105,128.00 | 0.07 |
| 151 | 300026 | 红日药业 | 13,500 | 103,950.00 | 0.07 |
| 152 | 002373 | 千方科技 | 9,300 | 103,416.00 | 0.07 |
| 153 | 002946 | 新乳业 | 7,943 | 103,179.57 | 0.07 |
| 154 | 601456 | 国联证券 | 8,400 | 103,068.00 | 0.07 |
| 155 | 603719 | 良品铺子 | 3,600 | 103,068.00 | 0.07 |
| 156 | 002240 | 盛新锂能 | 1,700 | 102,612.00 | 0.07 |
| 157 | 002390 | 信邦制药 | 14,800 | 102,268.00 | 0.07 |
| 158 | 300357 | 我武生物 | 1,963 | 102,134.89 | 0.07 |
| 159 | 300630 | 普利制药 | 2,900 | 101,935.00 | 0.07 |
| 160 | 600536 | 中国软件 | 2,510 | 101,880.90 | 0.07 |
| 161 | 688777 | 中控技术 | 1,400 | 101,864.00 | 0.07 |
| 162 | 002901 | 大博医疗 | 2,600 | 101,764.00 | 0.07 |
| 163 | 603026 | 石大胜华 | 700 | 101,745.00 | 0.07 |
| 164 | 300168 | 万达信息 | 10,700 | 101,008.00 | 0.07 |
| 165 | 600580 | 卧龙电驱 | 7,000 | 100,940.00 | 0.07 |
| 166 | 000062 | 深圳华强 | 7,942 | 100,863.40 | 0.07 |
| 167 | 002387 | 维信诺 | 15,000 | 100,800.00 | 0.07 |
| 168 | 002624 | 完美世界 | 7,000 | 100,590.00 | 0.07 |
| 169 | 002511 | 中顺洁柔 | 8,021 | 100,422.92 | 0.07 |
| 170 | 300463 | 迈克生物 | 4,900 | 100,401.00 | 0.07 |
| 171 | 603939 | 益丰药房 | 1,900 | 100,377.00 | 0.07 |
| 172 | 603927 | 中科软 | 4,300 | 100,276.00 | 0.07 |
| 173 | 002399 | 海普瑞 | 5,700 | 100,206.00 | 0.07 |
| 174 | 002683 | 广东宏大 | 3,600 | 100,188.00 | 0.07 |
| 175 | 002124 | 天邦食品 | 14,900 | 100,128.00 | 0.07 |
| 176 | 603379 | 三美股份 | 4,500 | 100,125.00 | 0.07 |
| 177 | 600171 | 上海贝岭 | 4,000 | 100,120.00 | 0.07 |
| 178 | 603000 | 人民网 | 8,900 | 99,680.00 | 0.07 |
| 179 | 002745 | 木林森 | 10,200 | 99,654.00 | 0.07 |
| 180 | 600216 | 浙江医药 | 7,300 | 99,645.00 | 0.07 |
| 181 | 603515 | 欧普照明 | 5,700 | 99,465.00 | 0.07 |
| 182 | 002004 | 华邦健康 | 17,800 | 99,324.00 | 0.07 |
| 183 | 002382 | 蓝帆医疗 | 10,400 | 99,320.00 | 0.07 |
| 184 | 600446 | 金证股份 | 9,564 | 99,274.32 | 0.07 |
| 185 | 000488 | 晨鸣纸业 | 17,600 | 99,264.00 | 0.07 |
| 186 | 300212 | 易华录 | 5,700 | 99,180.00 | 0.07 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|--------|-----------|------|
| 187 | 002242 | 九阳股份 | 5,400 | 99,144.00 | 0.07 |
| 188 | 600499 | 科达制造 | 4,800 | 99,072.00 | 0.07 |
| 189 | 002925 | 盈趣科技 | 4,600 | 98,992.00 | 0.07 |
| 190 | 300869 | 康泰医学 | 3,500 | 98,910.00 | 0.07 |
| 191 | 300024 | 机器人 | 9,800 | 98,784.00 | 0.07 |
| 192 | 002268 | 卫士通 | 2,300 | 98,693.00 | 0.07 |
| 193 | 002174 | 游族网络 | 10,100 | 98,677.00 | 0.07 |
| 194 | 600201 | 生物股份 | 10,766 | 98,616.56 | 0.07 |
| 195 | 000563 | 陕国投 A | 31,600 | 98,592.00 | 0.07 |
| 196 | 300017 | 网宿科技 | 18,393 | 98,586.48 | 0.07 |
| 197 | 601200 | 上海环境 | 9,700 | 98,552.00 | 0.07 |
| 198 | 002185 | 华天科技 | 10,500 | 98,490.00 | 0.07 |
| 199 | 600764 | 中国海防 | 3,900 | 98,436.00 | 0.07 |
| 200 | 600500 | 中化国际 | 14,800 | 98,420.00 | 0.07 |
| 201 | 000158 | 常山北明 | 16,400 | 98,400.00 | 0.07 |
| 202 | 300115 | 长盈精密 | 9,540 | 98,357.40 | 0.07 |
| 203 | 600572 | 康恩贝 | 22,200 | 98,346.00 | 0.07 |
| 204 | 000785 | 居然之家 | 22,100 | 98,345.00 | 0.07 |
| 205 | 601187 | 厦门银行 | 16,500 | 98,340.00 | 0.07 |
| 206 | 600329 | 达仁堂 | 4,000 | 98,320.00 | 0.07 |
| 207 | 000028 | 国药一致 | 3,300 | 98,307.00 | 0.07 |
| 208 | 000685 | 中山公用 | 12,800 | 98,304.00 | 0.07 |
| 209 | 000528 | 柳工 | 15,100 | 98,301.00 | 0.07 |
| 210 | 600120 | 浙江东方 | 24,500 | 98,245.00 | 0.07 |
| 211 | 600717 | 天津港 | 24,500 | 98,245.00 | 0.07 |
| 212 | 688321 | 微芯生物 | 3,900 | 98,241.00 | 0.07 |
| 213 | 002249 | 大洋电机 | 16,000 | 98,240.00 | 0.07 |
| 214 | 601577 | 长沙银行 | 12,385 | 98,213.05 | 0.07 |
| 215 | 600917 | 重庆燃气 | 13,600 | 98,192.00 | 0.07 |
| 216 | 601860 | 紫金银行 | 34,200 | 98,154.00 | 0.07 |
| 217 | 600823 | 世茂股份 | 32,900 | 98,042.00 | 0.07 |
| 218 | 601003 | 柳钢股份 | 24,200 | 98,010.00 | 0.07 |
| 219 | 002002 | 鸿达兴业 | 26,407 | 97,969.97 | 0.07 |
| 220 | 600307 | 酒钢宏兴 | 50,400 | 97,776.00 | 0.07 |
| 221 | 002221 | 东华能源 | 10,500 | 97,755.00 | 0.07 |
| 222 | 002048 | 宁波华翔 | 6,100 | 97,722.00 | 0.07 |
| 223 | 600376 | 首开股份 | 19,900 | 97,709.00 | 0.07 |
| 224 | 000636 | 风华高科 | 5,200 | 97,708.00 | 0.07 |
| 225 | 000540 | 中天金融 | 50,600 | 97,658.00 | 0.07 |
| 226 | 300072 | 三聚环保 | 19,300 | 97,658.00 | 0.07 |
| 227 | 000930 | 中粮科技 | 10,800 | 97,632.00 | 0.07 |
| 228 | 002223 | 鱼跃医疗 | 3,800 | 97,508.00 | 0.07 |
| 229 | 600835 | 上海机电 | 7,100 | 97,483.00 | 0.07 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 230 | 600901 | 江苏租赁 | 19,000 | 97,470.00 | 0.07 |
| 231 | 002212 | 天融信 | 9,600 | 97,440.00 | 0.07 |
| 232 | 600811 | 东方集团 | 34,400 | 97,352.00 | 0.07 |
| 233 | 000690 | 宝新能源 | 22,200 | 97,236.00 | 0.07 |
| 234 | 000718 | 苏宁环球 | 26,400 | 97,152.00 | 0.07 |
| 235 | 000967 | 盈峰环境 | 19,200 | 97,152.00 | 0.07 |
| 236 | 000671 | 阳光城 | 44,300 | 97,017.00 | 0.07 |
| 237 | 000961 | 中南建设 | 31,800 | 96,990.00 | 0.07 |
| 238 | 000717 | 韶钢松山 | 27,700 | 96,950.00 | 0.07 |
| 239 | 600066 | 宇通客车 | 11,200 | 96,880.00 | 0.07 |
| 240 | 300166 | 东方国信 | 10,500 | 96,810.00 | 0.07 |
| 241 | 002416 | 爱施德 | 10,400 | 96,720.00 | 0.07 |
| 242 | 002281 | 光迅科技 | 5,500 | 96,690.00 | 0.07 |
| 243 | 600166 | 福田汽车 | 34,100 | 96,503.00 | 0.07 |
| 244 | 600259 | 广晟有色 | 1,900 | 96,235.00 | 0.07 |
| 245 | 002434 | 万里扬 | 11,000 | 94,050.00 | 0.07 |
| 246 | 600006 | 东风汽车 | 12,400 | 93,620.00 | 0.07 |
| 247 | 601866 | 中远海发 | 17,300 | 51,900.00 | 0.04 |
| 248 | 000878 | 云南铜业 | 4,300 | 48,977.00 | 0.03 |
| 249 | 688185 | 康希诺 | 38 | 7,565.04 | 0.01 |
| 250 | 688180 | 君实生物 | 100 | 7,534.00 | 0.01 |
| 251 | 688289 | 圣湘生物 | 148 | 4,382.28 | 0.00 |
| 252 | 002028 | 思源电气 | 90 | 3,209.40 | 0.00 |
| 253 | 600895 | 张江高科 | 56 | 697.20 | 0.00 |
| 254 | 600535 | 天士力 | 59 | 620.09 | 0.00 |
| 255 | 000039 | 中集集团 | 43 | 595.55 | 0.00 |
| 256 | 601168 | 西部矿业 | 48 | 567.84 | 0.00 |
| 257 | 601611 | 中国核建 | 55 | 461.45 | 0.00 |
| 258 | 002966 | 苏州银行 | 67 | 408.70 | 0.00 |
| 259 | 300296 | 利亚德 | 49 | 357.70 | 0.00 |
| 260 | 002266 | 浙富控股 | 70 | 335.30 | 0.00 |
| 261 | 002092 | 中泰化学 | 40 | 310.40 | 0.00 |
| 262 | 002532 | 天山铝业 | 42 | 274.26 | 0.00 |
| 263 | 600566 | 济川药业 | 6 | 162.96 | 0.00 |
| 264 | 002701 | 奥瑞金 | 25 | 130.00 | 0.00 |
| 265 | 000987 | 越秀金控 | 18 | 126.54 | 0.00 |
| 266 | 002019 | 亿帆医药 | 7 | 97.86 | 0.00 |
| 267 | 600827 | 百联股份 | 7 | 92.47 | 0.00 |
| 268 | 603866 | 桃李面包 | 4 | 66.20 | 0.00 |
| 269 | 601928 | 凤凰传媒 | 1 | 7.15 | 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 | 600938 | 中国海油 | 120,005 | 1,960,520.89 | 1.37 |
| 2 | 601066 | 中信建投 | 40,000 | 1,156,400.00 | 0.81 |
| 3 | 600420 | 国药现代 | 61,800 | 611,820.00 | 0.43 |
| 4 | 300015 | 爱尔眼科 | 12,800 | 573,056.00 | 0.40 |
| 5 | 002639 | 雪人股份 | 48,500 | 555,810.00 | 0.39 |
| 6 | 300412 | 迦南科技 | 56,700 | 384,993.00 | 0.27 |
| 7 | 601155 | 新城控股 | 14,600 | 371,278.00 | 0.26 |
| 8 | 600703 | 三安光电 | 15,000 | 368,700.00 | 0.26 |
| 9 | 601100 | 恒立液压 | 5,900 | 364,148.00 | 0.25 |
| 10 | 300568 | 星源材质 | 12,100 | 351,384.00 | 0.24 |
| 11 | 002245 | 蔚蓝锂芯 | 14,800 | 343,508.00 | 0.24 |
| 12 | 688388 | 嘉元科技 | 4,000 | 339,480.00 | 0.24 |
| 13 | 603138 | 海量数据 | 24,400 | 335,988.00 | 0.23 |
| 14 | 603489 | 八方股份 | 1,700 | 330,633.00 | 0.23 |
| 15 | 300491 | 通合科技 | 22,500 | 330,075.00 | 0.23 |
| 16 | 002812 | 恩捷股份 | 1,300 | 325,585.00 | 0.23 |
| 17 | 603333 | 尚纬股份 | 47,500 | 291,175.00 | 0.20 |
| 18 | 300095 | 华伍股份 | 20,900 | 274,208.00 | 0.19 |
| 19 | 002227 | 奥特迅 | 17,600 | 253,968.00 | 0.18 |
| 20 | 603169 | 兰石重装 | 37,600 | 249,288.00 | 0.17 |
| 21 | 002100 | 天康生物 | 22,300 | 216,756.00 | 0.15 |
| 22 | 002805 | 丰元股份 | 3,500 | 216,650.00 | 0.15 |
| 23 | 600929 | 雪天盐业 | 23,300 | 216,224.00 | 0.15 |
| 24 | 002916 | 深南电路 | 2,300 | 215,533.00 | 0.15 |
| 25 | 688598 | 金博股份 | 700 | 206,290.00 | 0.14 |
| 26 | 601021 | 春秋航空 | 3,500 | 204,225.00 | 0.14 |
| 27 | 300316 | 晶盛机电 | 3,000 | 202,770.00 | 0.14 |
| 28 | 300681 | 英搏尔 | 3,440 | 198,728.80 | 0.14 |
| 29 | 002215 | 诺普信 | 35,400 | 197,886.00 | 0.14 |
| 30 | 002993 | 奥海科技 | 4,700 | 195,332.00 | 0.14 |
| 31 | 603737 | 三棵树 | 1,500 | 194,145.00 | 0.14 |
| 32 | 300616 | 尚品宅配 | 6,700 | 190,615.00 | 0.13 |
| 33 | 002436 | 兴森科技 | 16,800 | 189,336.00 | 0.13 |
| 34 | 600481 | 双良节能 | 11,100 | 187,035.00 | 0.13 |
| 35 | 600995 | 文山电力 | 12,100 | 185,251.00 | 0.13 |
| 36 | 600196 | 复星医药 | 4,200 | 185,178.00 | 0.13 |
| 37 | 603313 | 梦百合 | 15,300 | 183,600.00 | 0.13 |
| 38 | 300171 | 东富龙 | 5,400 | 183,114.00 | 0.13 |
| 39 | 300666 | 江丰电子 | 3,000 | 183,000.00 | 0.13 |
| 40 | 002849 | 威星智能 | 15,300 | 182,529.00 | 0.13 |

| | | | | | |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 41 | 603817 | 海峡环保 | 25,000 | 182,500.00 | 0.13 |
| 42 | 601339 | 百隆东方 | 35,800 | 181,864.00 | 0.13 |
| 43 | 300402 | 宝色股份 | 9,000 | 181,350.00 | 0.13 |
| 44 | 688661 | 和林微纳 | 2,996 | 179,640.16 | 0.13 |
| 45 | 603187 | 海容冷链 | 4,900 | 179,095.00 | 0.12 |
| 46 | 300210 | 森远股份 | 50,300 | 175,547.00 | 0.12 |
| 47 | 002487 | 大金重工 | 4,200 | 175,266.00 | 0.12 |
| 48 | 002706 | 良信股份 | 10,600 | 175,218.00 | 0.12 |
| 49 | 600711 | 盛屯矿业 | 22,400 | 173,824.00 | 0.12 |
| 50 | 603566 | 普莱柯 | 6,500 | 173,745.00 | 0.12 |
| 51 | 600416 | 湘电股份 | 9,100 | 172,536.00 | 0.12 |
| 52 | 603633 | 徕木股份 | 11,800 | 172,044.00 | 0.12 |
| 53 | 603507 | 振江股份 | 5,200 | 171,288.00 | 0.12 |
| 54 | 605333 | 沪光股份 | 7,400 | 170,940.00 | 0.12 |
| 55 | 688303 | 大全能源 | 2,500 | 170,800.00 | 0.12 |
| 56 | 300083 | 创世纪 | 14,800 | 170,200.00 | 0.12 |
| 57 | 603337 | 杰克股份 | 7,900 | 169,692.00 | 0.12 |
| 58 | 002881 | 美格智能 | 5,290 | 169,597.40 | 0.12 |
| 59 | 601865 | 福莱特 | 4,400 | 167,640.00 | 0.12 |
| 60 | 000301 | 东方盛虹 | 9,900 | 167,409.00 | 0.12 |
| 61 | 300118 | 东方日升 | 5,700 | 167,181.00 | 0.12 |
| 62 | 300421 | 力星股份 | 13,800 | 166,152.00 | 0.12 |
| 63 | 300680 | 隆盛科技 | 6,400 | 165,888.00 | 0.12 |
| 64 | 605111 | 新洁能 | 1,300 | 163,553.00 | 0.11 |
| 65 | 603982 | 泉峰汽车 | 6,700 | 163,413.00 | 0.11 |
| 66 | 300566 | 激智科技 | 9,000 | 162,900.00 | 0.11 |
| 67 | 300887 | 谱尼测试 | 3,800 | 162,298.00 | 0.11 |
| 68 | 688135 | 利扬芯片 | 5,155 | 162,279.40 | 0.11 |
| 69 | 688033 | 天宜上佳 | 7,600 | 161,424.00 | 0.11 |
| 70 | 300655 | 晶瑞电材 | 8,183 | 157,931.90 | 0.11 |
| 71 | 688567 | 孚能科技 | 5,344 | 151,823.04 | 0.11 |
| 72 | 688568 | 中科星图 | 2,226 | 150,833.76 | 0.11 |
| 73 | 688560 | 明冠新材 | 4,400 | 150,656.00 | 0.10 |
| 74 | 300751 | 迈为股份 | 300 | 147,270.00 | 0.10 |
| 75 | 688046 | 药康生物 | 5,538 | 145,317.12 | 0.10 |
| 76 | 300571 | 平治信息 | 3,500 | 144,550.00 | 0.10 |
| 77 | 002386 | 天原股份 | 13,000 | 143,260.00 | 0.10 |
| 78 | 688297 | 中无人机 | 2,681 | 123,004.28 | 0.09 |
| 79 | 688295 | 中复神鹰 | 3,350 | 115,307.00 | 0.08 |
| 80 | 002865 | 钧达股份 | 1,200 | 114,432.00 | 0.08 |
| 81 | 300674 | 宇信科技 | 7,000 | 109,760.00 | 0.08 |
| 82 | 300796 | 贝斯美 | 7,200 | 109,296.00 | 0.08 |
| 83 | 300246 | 宝莱特 | 6,800 | 107,100.00 | 0.07 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 84 | 603518 | 锦泓集团 | 13,300 | 106,666.00 | 0.07 |
| 85 | 300062 | 中能电气 | 15,100 | 105,247.00 | 0.07 |
| 86 | 300903 | 科翔股份 | 7,420 | 104,696.20 | 0.07 |
| 87 | 603011 | 合锻智能 | 15,100 | 101,774.00 | 0.07 |
| 88 | 688357 | 建龙微纳 | 900 | 101,196.00 | 0.07 |
| 89 | 688349 | 三一重能 | 2,481 | 91,648.14 | 0.06 |
| 90 | 002825 | 纳尔股份 | 7,200 | 79,848.00 | 0.06 |
| 91 | 300275 | 梅安森 | 5,200 | 69,004.00 | 0.05 |
| 92 | 600328 | 中盐化工 | 2,900 | 68,295.00 | 0.05 |
| 93 | 300177 | 中海达 | 8,300 | 67,147.00 | 0.05 |
| 94 | 300546 | 雄帝科技 | 2,600 | 66,872.00 | 0.05 |
| 95 | 002109 | 兴化股份 | 11,500 | 65,780.00 | 0.05 |
| 96 | 300562 | 乐心医疗 | 6,600 | 63,822.00 | 0.04 |
| 97 | 300426 | 唐德影视 | 8,000 | 63,120.00 | 0.04 |
| 98 | 603871 | 嘉友国际 | 3,500 | 59,150.00 | 0.04 |
| 99 | 300710 | 万隆光电 | 1,400 | 57,106.00 | 0.04 |
| 100 | 300671 | 富满微 | 700 | 50,442.00 | 0.04 |
| 101 | 000702 | 正虹科技 | 8,900 | 48,238.00 | 0.03 |
| 102 | 300464 | 星徽股份 | 6,900 | 47,886.00 | 0.03 |
| 103 | 688202 | 美迪西 | 140 | 47,545.40 | 0.03 |
| 104 | 000920 | 沃顿科技 | 5,100 | 45,441.00 | 0.03 |
| 105 | 600552 | 凯盛科技 | 4,000 | 45,320.00 | 0.03 |
| 106 | 603377 | 东方时尚 | 7,400 | 44,400.00 | 0.03 |
| 107 | 002140 | 东华科技 | 4,100 | 41,533.00 | 0.03 |
| 108 | 600353 | 旭光电子 | 4,600 | 40,894.00 | 0.03 |
| 109 | 002302 | 西部建设 | 5,000 | 38,800.00 | 0.03 |
| 110 | 601089 | 福元医药 | 1,749 | 36,816.45 | 0.03 |
| 111 | 300408 | 三环集团 | 1,200 | 36,120.00 | 0.03 |
| 112 | 603300 | 华铁应急 | 4,260 | 33,952.20 | 0.02 |
| 113 | 603301 | 振德医疗 | 800 | 33,640.00 | 0.02 |
| 114 | 600098 | 广州发展 | 5,300 | 33,178.00 | 0.02 |
| 115 | 002714 | 牧原股份 | 600 | 33,162.00 | 0.02 |
| 116 | 688200 | 华峰测控 | 90 | 32,076.00 | 0.02 |
| 117 | 600029 | 南方航空 | 4,100 | 29,971.00 | 0.02 |
| 118 | 001323 | 慕思股份 | 573 | 28,111.38 | 0.02 |
| 119 | 300055 | 万邦达 | 3,000 | 28,080.00 | 0.02 |
| 120 | 601008 | 连云港 | 6,500 | 27,365.00 | 0.02 |
| 121 | 001201 | 东瑞股份 | 700 | 27,006.00 | 0.02 |
| 122 | 603191 | 望变电气 | 1,149 | 26,197.20 | 0.02 |
| 123 | 603278 | 大业股份 | 3,000 | 24,990.00 | 0.02 |
| 124 | 603773 | 沃格光电 | 1,557 | 24,912.00 | 0.02 |
| 125 | 601018 | 宁波港 | 6,000 | 23,400.00 | 0.02 |
| 126 | 301238 | 瑞泰新材 | 669 | 22,855.95 | 0.02 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 127 | 600305 | 恒顺醋业 | 1,700 | 21,930.00 | 0.02 |
| 128 | 603051 | 鹿山新材 | 272 | 21,488.00 | 0.01 |
| 129 | 002053 | 云南能投 | 1,600 | 20,512.00 | 0.01 |
| 130 | 001308 | 康冠科技 | 667 | 19,456.39 | 0.01 |
| 131 | 000560 | 我爱我家 | 6,700 | 19,296.00 | 0.01 |
| 132 | 000876 | 新希望 | 1,200 | 18,360.00 | 0.01 |
| 133 | 301215 | 中汽股份 | 2,698 | 17,240.22 | 0.01 |
| 134 | 603070 | 万控智造 | 775 | 16,197.50 | 0.01 |
| 135 | 300409 | 道氏技术 | 600 | 15,588.00 | 0.01 |
| 136 | 001319 | 铭科精技 | 536 | 15,474.32 | 0.01 |
| 137 | 001313 | 粤海饲料 | 1,232 | 15,104.32 | 0.01 |
| 138 | 301122 | 采纳股份 | 201 | 14,237.12 | 0.01 |
| 139 | 300280 | 紫天科技 | 600 | 13,818.00 | 0.01 |
| 140 | 301120 | 新特电气 | 887 | 13,739.63 | 0.01 |
| 141 | 603097 | 江苏华辰 | 577 | 13,617.20 | 0.01 |
| 142 | 603209 | 兴通股份 | 595 | 13,518.40 | 0.01 |
| 143 | 002539 | 云图控股 | 800 | 12,792.00 | 0.01 |
| 144 | 301263 | 泰恩康 | 382 | 11,987.16 | 0.01 |
| 145 | 301116 | 益客食品 | 577 | 11,805.42 | 0.01 |
| 146 | 301187 | 欧圣电气 | 520 | 11,720.80 | 0.01 |
| 147 | 600821 | 金开新能 | 1,800 | 11,592.00 | 0.01 |
| 148 | 001268 | 联合精密 | 409 | 11,337.48 | 0.01 |
| 149 | 301259 | 艾布鲁 | 449 | 11,198.06 | 0.01 |
| 150 | 301217 | 铜冠铜箔 | 743 | 11,018.69 | 0.01 |
| 151 | 301162 | 国能日新 | 200 | 10,822.00 | 0.01 |
| 152 | 300763 | 锦浪科技 | 50 | 10,650.00 | 0.01 |
| 153 | 301117 | 佳缘科技 | 191 | 10,398.04 | 0.01 |
| 154 | 301268 | 铭利达 | 293 | 10,216.91 | 0.01 |
| 155 | 301211 | 亨迪药业 | 455 | 9,864.40 | 0.01 |
| 156 | 301298 | 东利机械 | 465 | 9,685.95 | 0.01 |
| 157 | 301212 | 联盛化学 | 291 | 9,684.48 | 0.01 |
| 158 | 301256 | 华融化学 | 936 | 9,434.88 | 0.01 |
| 159 | 301221 | 光庭信息 | 144 | 9,335.52 | 0.01 |
| 160 | 688408 | 中信博 | 100 | 9,248.00 | 0.01 |
| 161 | 301288 | 清研环境 | 452 | 9,030.96 | 0.01 |
| 162 | 301201 | 诚达药业 | 126 | 9,014.04 | 0.01 |
| 163 | 301163 | 宏德股份 | 277 | 8,955.41 | 0.01 |
| 164 | 301130 | 西点药业 | 237 | 8,934.90 | 0.01 |
| 165 | 301097 | 天益医疗 | 174 | 8,322.42 | 0.01 |
| 166 | 605050 | 福然德 | 571 | 8,011.13 | 0.01 |
| 167 | 301125 | 腾亚精工 | 289 | 7,924.38 | 0.01 |
| 168 | 301286 | 侨源股份 | 398 | 7,876.42 | 0.01 |
| 169 | 301158 | 德石股份 | 379 | 7,724.02 | 0.01 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-----|----------|------|
| 170 | 301228 | 实朴检测 | 373 | 7,586.82 | 0.01 |
| 171 | 301137 | 哈焊华通 | 468 | 7,483.32 | 0.01 |
| 172 | 301236 | 软通动力 | 238 | 7,468.44 | 0.01 |
| 173 | 301206 | 三元生物 | 160 | 7,310.40 | 0.01 |
| 174 | 688559 | 海目星 | 100 | 7,270.00 | 0.01 |
| 175 | 301248 | 杰创智能 | 242 | 7,228.54 | 0.01 |
| 176 | 301216 | 万凯新材 | 229 | 6,833.36 | 0.00 |
| 177 | 301190 | 善水科技 | 284 | 6,739.32 | 0.00 |
| 178 | 301103 | 何氏眼科 | 207 | 6,628.14 | 0.00 |
| 179 | 600861 | 北京城乡 | 300 | 6,534.00 | 0.00 |
| 180 | 301150 | 中一科技 | 78 | 6,455.28 | 0.00 |
| 181 | 000505 | 京粮控股 | 700 | 6,419.00 | 0.00 |
| 182 | 301109 | 军信股份 | 396 | 6,391.44 | 0.00 |
| 183 | 002214 | 大立科技 | 500 | 6,360.00 | 0.00 |
| 184 | 301100 | 风光股份 | 288 | 6,215.04 | 0.00 |
| 185 | 301222 | 浙江恒威 | 211 | 6,110.56 | 0.00 |
| 186 | 002928 | 华夏航空 | 500 | 5,885.00 | 0.00 |
| 187 | 301148 | 嘉戎技术 | 245 | 5,855.50 | 0.00 |
| 188 | 301258 | 富士莱 | 136 | 5,668.48 | 0.00 |
| 189 | 301151 | 冠龙节能 | 263 | 5,643.98 | 0.00 |
| 190 | 301123 | 奕东电子 | 219 | 5,560.41 | 0.00 |
| 191 | 301135 | 瑞德智能 | 211 | 5,540.86 | 0.00 |
| 192 | 301279 | 金道科技 | 241 | 5,497.21 | 0.00 |
| 193 | 301237 | 和顺科技 | 131 | 5,483.66 | 0.00 |
| 194 | 301166 | 优宁维 | 93 | 5,473.98 | 0.00 |
| 195 | 301207 | 华兰疫苗 | 97 | 5,472.74 | 0.00 |
| 196 | 301181 | 标榜股份 | 176 | 5,383.84 | 0.00 |
| 197 | 301219 | 腾远钴业 | 58 | 5,093.56 | 0.00 |
| 198 | 603185 | 上机数控 | 31 | 4,835.69 | 0.00 |
| 199 | 301189 | 奥尼电子 | 145 | 4,829.95 | 0.00 |
| 200 | 300926 | 博俊科技 | 200 | 4,670.00 | 0.00 |
| 201 | 300834 | 星辉环材 | 149 | 4,474.47 | 0.00 |
| 202 | 301110 | 青木股份 | 107 | 4,263.95 | 0.00 |
| 203 | 300767 | 震安科技 | 72 | 4,188.96 | 0.00 |
| 204 | 300188 | 美亚柏科 | 300 | 4,044.00 | 0.00 |
| 205 | 301196 | 唯科科技 | 82 | 3,076.64 | 0.00 |
| 206 | 002311 | 海大集团 | 48 | 2,880.48 | 0.00 |
| 207 | 601012 | 隆基绿能 | 40 | 2,665.20 | 0.00 |
| 208 | 688221 | 前沿生物 | 164 | 2,432.12 | 0.00 |
| 209 | 001266 | 宏英智能 | 47 | 2,340.13 | 0.00 |
| 210 | 688028 | 沃尔德 | 62 | 2,089.40 | 0.00 |
| 211 | 688020 | 方邦股份 | 52 | 2,027.48 | 0.00 |
| 212 | 300416 | 苏试试验 | 80 | 1,966.40 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-----|----------|------|
| 213 | 688136 | 科兴制药 | 74 | 1,961.00 | 0.00 |
| 214 | 300436 | 广生堂 | 52 | 1,867.32 | 0.00 |
| 215 | 300787 | 海能实业 | 60 | 1,736.40 | 0.00 |
| 216 | 603078 | 江化微 | 50 | 1,428.50 | 0.00 |
| 217 | 002947 | 恒铭达 | 73 | 1,343.20 | 0.00 |
| 218 | 301053 | 远信工业 | 55 | 1,284.80 | 0.00 |
| 219 | 688066 | 航天宏图 | 15 | 1,182.00 | 0.00 |
| 220 | 600729 | 重庆百货 | 53 | 1,143.21 | 0.00 |
| 221 | 688166 | 博瑞医药 | 47 | 1,135.05 | 0.00 |
| 222 | 603718 | 海利生物 | 91 | 1,044.68 | 0.00 |
| 223 | 300129 | 泰胜风能 | 100 | 905.00 | 0.00 |
| 224 | 300723 | 一品红 | 32 | 860.80 | 0.00 |
| 225 | 688025 | 杰普特 | 16 | 793.28 | 0.00 |
| 226 | 300968 | 格林精密 | 87 | 788.22 | 0.00 |
| 227 | 000877 | 天山股份 | 59 | 725.70 | 0.00 |
| 228 | 603159 | 上海亚虹 | 40 | 552.40 | 0.00 |
| 229 | 603132 | 金徽股份 | 42 | 542.22 | 0.00 |
| 230 | 002724 | 海洋王 | 40 | 497.20 | 0.00 |
| 231 | 002819 | 东方中科 | 20 | 483.20 | 0.00 |
| 232 | 300669 | 沪宁股份 | 50 | 472.00 | 0.00 |
| 233 | 002746 | 仙坛股份 | 50 | 457.50 | 0.00 |
| 234 | 600640 | 新国脉 | 32 | 335.68 | 0.00 |
| 235 | 300138 | 晨光生物 | 21 | 326.97 | 0.00 |
| 236 | 300456 | 赛微电子 | 17 | 310.76 | 0.00 |
| 237 | 600841 | 动力新科 | 35 | 303.10 | 0.00 |
| 238 | 301078 | 孩子王 | 18 | 263.88 | 0.00 |
| 239 | 600219 | 南山铝业 | 50 | 184.50 | 0.00 |
| 240 | 600123 | 兰花科创 | 11 | 180.95 | 0.00 |
| 241 | 300469 | 信息发展 | 12 | 164.52 | 0.00 |
| 242 | 000090 | 天健集团 | 18 | 124.02 | 0.00 |
| 243 | 300735 | 光弘科技 | 10 | 104.50 | 0.00 |
| 244 | 600908 | 无锡银行 | 17 | 95.71 | 0.00 |
| 245 | 603708 | 家家悦 | 4 | 56.96 | 0.00 |
| 246 | 000851 | 高鸿股份 | 8 | 38.16 | 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 | 600256 | 广汇能源 | 18,122,071.00 | 6.50 |

| | | | | |
|----|--------|------|-------------------|------|
| 2 | 600039 | 四川路桥 | 16,339,116.0 0 | 5.86 |
| 3 | 600233 | 圆通速递 | 15,981,459.0 0 | 5.73 |
| 4 | 688005 | 容百科技 | 13,846,930.7 2 | 4.97 |
| 5 | 601168 | 西部矿业 | 13,742,958.5 7 | 4.93 |
| 6 | 600884 | 杉杉股份 | 13,688,964.0 0 | 4.91 |
| 7 | 600546 | 山煤国际 | 12,491,958.0 0 | 4.48 |
| 8 | 300363 | 博腾股份 | 12,476,247.0 0 | 4.48 |
| 9 | 600718 | 东软集团 | 12,418,356.0 0 | 4.46 |
| 10 | 600160 | 巨化股份 | 11,828,927.2 0 | 4.24 |
| 11 | 600141 | 兴发集团 | 11,775,973.6 5 | 4.23 |
| 12 | 600765 | 中航重机 | 11,757,692.0 0 | 4.22 |
| 13 | 300474 | 景嘉微 | 11,625,225.0 0 | 4.17 |
| 14 | 600188 | 兖矿能源 | 11,499,740.6 5 | 4.13 |
| 15 | 000983 | 山西焦煤 | 11,364,474.0 0 | 4.08 |
| 16 | 002185 | 华天科技 | 10,874,734.0 0 | 3.90 |
| 17 | 605358 | 立昂微 | 10,826,703.0 0 | 3.88 |
| 18 | 300009 | 安科生物 | 10,673,675.2 6 | 3.83 |
| 19 | 600258 | 首旅酒店 | 10,396,286.0 0 | 3.73 |
| 20 | 601615 | 明阳智能 | 10,228,279.0 0 | 3.67 |
| 21 | 600563 | 法拉电子 | 10,111,543.0 0 | 3.63 |
| 22 | 000733 | 振华科技 | 9,960,915.00 | 3.57 |
| 23 | 002128 | 电投能源 | 9,455,834.00 | 3.39 |
| 24 | 601958 | 金钼股份 | 9,422,957.00 | 3.38 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 25 | 601872 | 招商轮船 | 9,302,863.80 | 3.34 |
| 26 | 603613 | 国联股份 | 9,141,901.00 | 3.28 |
| 27 | 688099 | 晶晨股份 | 9,024,671.11 | 3.24 |
| 28 | 600673 | 东阳光 | 8,962,957.44 | 3.22 |
| 29 | 600315 | 上海家化 | 8,948,329.00 | 3.21 |
| 30 | 300223 | 北京君正 | 8,814,609.00 | 3.16 |
| 31 | 002180 | 纳思达 | 8,605,939.00 | 3.09 |
| 32 | 002396 | 星网锐捷 | 8,526,075.00 | 3.06 |
| 33 | 600737 | 中粮糖业 | 8,499,535.00 | 3.05 |
| 34 | 002212 | 天融信 | 8,479,936.00 | 3.04 |
| 35 | 600728 | 佳都科技 | 8,460,299.59 | 3.04 |
| 36 | 603456 | 九洲药业 | 8,424,670.09 | 3.02 |
| 37 | 600803 | 新奥股份 | 8,285,122.00 | 2.97 |
| 38 | 000629 | 攀钢钒钛 | 8,258,472.00 | 2.96 |
| 39 | 600348 | 华阳股份 | 8,181,927.00 | 2.94 |
| 40 | 600415 | 小商品城 | 8,163,869.00 | 2.93 |
| 41 | 600282 | 南钢股份 | 8,141,448.13 | 2.92 |
| 42 | 002048 | 宁波华翔 | 7,978,546.00 | 2.86 |
| 43 | 300168 | 万达信息 | 7,943,860.00 | 2.85 |
| 44 | 603225 | 新凤鸣 | 7,699,082.00 | 2.76 |
| 45 | 002505 | 鹏都农牧 | 7,664,793.00 | 2.75 |
| 46 | 000039 | 中集集团 | 7,659,325.57 | 2.75 |
| 47 | 000960 | 锡业股份 | 7,524,203.48 | 2.70 |
| 48 | 300182 | 捷成股份 | 7,522,902.00 | 2.70 |
| 49 | 601636 | 旗滨集团 | 7,496,319.00 | 2.69 |
| 50 | 300285 | 国瓷材料 | 7,360,751.00 | 2.64 |
| 51 | 600026 | 中远海能 | 7,358,439.00 | 2.64 |
| 52 | 300037 | 新宙邦 | 7,318,565.00 | 2.63 |
| 53 | 603708 | 家家悦 | 7,294,137.50 | 2.62 |
| 54 | 000887 | 中鼎股份 | 7,270,916.00 | 2.61 |
| 55 | 300115 | 长盈精密 | 7,240,559.00 | 2.60 |
| 56 | 600409 | 三友化工 | 7,174,220.00 | 2.57 |
| 57 | 603198 | 迎驾贡酒 | 7,144,560.00 | 2.56 |
| 58 | 600859 | 王府井 | 7,118,484.00 | 2.55 |
| 59 | 300418 | 昆仑万维 | 7,109,714.44 | 2.55 |
| 60 | 001914 | 招商积余 | 7,065,106.88 | 2.54 |
| 61 | 000519 | 中兵红箭 | 7,060,615.00 | 2.53 |
| 62 | 600316 | 洪都航空 | 7,029,806.00 | 2.52 |
| 63 | 002416 | 爱施德 | 6,952,724.00 | 2.49 |
| 64 | 601456 | 国联证券 | 6,929,370.21 | 2.49 |
| 65 | 300244 | 迪安诊断 | 6,876,018.09 | 2.47 |
| 66 | 600497 | 驰宏锌锗 | 6,801,245.00 | 2.44 |
| 67 | 002458 | 益生股份 | 6,753,791.60 | 2.42 |

| | | | | |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 68 | 688002 | 睿创微纳 | 6,753,561.73 | 2.42 |
| 69 | 600970 | 中材国际 | 6,745,708.08 | 2.42 |
| 70 | 000630 | 铜陵有色 | 6,606,473.00 | 2.37 |
| 71 | 603290 | 斯达半导 | 6,586,679.00 | 2.36 |
| 72 | 600153 | 建发股份 | 6,572,670.00 | 2.36 |
| 73 | 000970 | 中科三环 | 6,558,797.45 | 2.35 |
| 74 | 601128 | 常熟银行 | 6,519,934.00 | 2.34 |
| 75 | 601689 | 拓普集团 | 6,516,470.00 | 2.34 |
| 76 | 002268 | 卫士通 | 6,410,806.00 | 2.30 |
| 77 | 600535 | 天士力 | 6,292,620.00 | 2.26 |
| 78 | 000090 | 天健集团 | 6,279,639.00 | 2.25 |
| 79 | 600435 | 北方导航 | 6,260,478.72 | 2.25 |
| 80 | 600325 | 华发股份 | 6,226,644.00 | 2.23 |
| 81 | 600729 | 重庆百货 | 6,225,817.00 | 2.23 |
| 82 | 600699 | 均胜电子 | 6,197,404.00 | 2.22 |
| 83 | 600862 | 中航高科 | 6,195,807.00 | 2.22 |
| 84 | 000537 | 广宇发展 | 6,159,921.00 | 2.21 |
| 85 | 002745 | 木林森 | 6,117,000.00 | 2.19 |
| 86 | 600885 | 宏发股份 | 6,042,146.00 | 2.17 |
| 87 | 300146 | 汤臣倍健 | 5,950,190.00 | 2.14 |
| 88 | 002444 | 巨星科技 | 5,879,618.00 | 2.11 |
| 89 | 688536 | 思瑞浦 | 5,867,527.02 | 2.11 |
| 90 | 000825 | 太钢不锈 | 5,860,779.00 | 2.10 |
| 91 | 600066 | 宇通客车 | 5,859,785.00 | 2.10 |
| 92 | 603317 | 天味食品 | 5,842,508.40 | 2.10 |
| 93 | 603589 | 口子窖 | 5,813,153.77 | 2.09 |
| 94 | 601717 | 郑煤机 | 5,758,229.00 | 2.07 |
| 95 | 600623 | 华谊集团 | 5,682,661.00 | 2.04 |
| 96 | 000999 | 华润三九 | 5,677,848.00 | 2.04 |
| 97 | 000830 | 鲁西化工 | 5,637,419.00 | 2.02 |
| 98 | 600486 | 扬农化工 | 5,634,032.00 | 2.02 |
| 99 | 600908 | 无锡银行 | 5,633,721.52 | 2.02 |
| 100 | 002948 | 青岛银行 | 5,624,113.50 | 2.02 |
| 101 | 603605 | 珀莱雅 | 5,604,880.00 | 2.01 |

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 | 600256 | 广汇能源 | 20,067,925.30 | 7.20 |
| 2 | 600039 | 四川路桥 | 16,167,058.2 | 5.80 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| | | | 4 | |
| 3 | 600884 | 杉杉股份 | 15,590,996.13 | 5.59 |
| 4 | 600233 | 圆通速递 | 14,666,135.38 | 5.26 |
| 5 | 688005 | 容百科技 | 14,187,047.60 | 5.09 |
| 6 | 600765 | 中航重机 | 13,804,677.60 | 4.95 |
| 7 | 600546 | 山煤国际 | 13,700,481.75 | 4.92 |
| 8 | 300363 | 博腾股份 | 13,527,444.00 | 4.85 |
| 9 | 601168 | 西部矿业 | 13,162,486.00 | 4.72 |
| 10 | 600188 | 兖矿能源 | 12,604,823.00 | 4.52 |
| 11 | 601615 | 明阳智能 | 12,134,225.98 | 4.35 |
| 12 | 600141 | 兴发集团 | 11,864,358.00 | 4.26 |
| 13 | 600718 | 东软集团 | 11,584,918.00 | 4.16 |
| 14 | 300474 | 景嘉微 | 11,402,703.00 | 4.09 |
| 15 | 000983 | 山西焦煤 | 11,361,240.77 | 4.08 |
| 16 | 605358 | 立昂微 | 11,340,828.12 | 4.07 |
| 17 | 600160 | 巨化股份 | 10,643,097.35 | 3.82 |
| 18 | 002185 | 华天科技 | 10,596,020.39 | 3.80 |
| 19 | 600803 | 新奥股份 | 10,578,847.00 | 3.80 |
| 20 | 002180 | 纳思达 | 10,544,658.00 | 3.78 |
| 21 | 603456 | 九洲药业 | 9,975,069.85 | 3.58 |
| 22 | 000733 | 振华科技 | 9,974,002.00 | 3.58 |
| 23 | 600563 | 法拉电子 | 9,884,069.00 | 3.55 |
| 24 | 688099 | 晶晨股份 | 9,880,480.01 | 3.55 |
| 25 | 300009 | 安科生物 | 9,677,170.33 | 3.47 |
| 26 | 600258 | 首旅酒店 | 9,488,477.00 | 3.40 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 27 | 300168 | 万达信息 | 9,435,387.59 | 3.39 |
| 28 | 603198 | 迎驾贡酒 | 9,409,558.00 | 3.38 |
| 29 | 002128 | 电投能源 | 9,381,609.00 | 3.37 |
| 30 | 000039 | 中集集团 | 9,233,329.00 | 3.31 |
| 31 | 000830 | 鲁西化工 | 9,176,301.00 | 3.29 |
| 32 | 601636 | 旗滨集团 | 9,151,111.03 | 3.28 |
| 33 | 601958 | 金钼股份 | 9,144,197.40 | 3.28 |
| 34 | 300182 | 捷成股份 | 9,120,774.00 | 3.27 |
| 35 | 601689 | 拓普集团 | 9,061,638.00 | 3.25 |
| 36 | 600728 | 佳都科技 | 9,017,161.00 | 3.24 |
| 37 | 300751 | 迈为股份 | 9,016,975.20 | 3.24 |
| 38 | 300223 | 北京君正 | 8,979,393.00 | 3.22 |
| 39 | 300418 | 昆仑万维 | 8,924,261.33 | 3.20 |
| 40 | 600315 | 上海家化 | 8,776,490.00 | 3.15 |
| 41 | 000960 | 锡业股份 | 8,737,038.00 | 3.14 |
| 42 | 600737 | 中粮糖业 | 8,727,513.00 | 3.13 |
| 43 | 002505 | 鹏都农牧 | 8,605,327.00 | 3.09 |
| 44 | 600415 | 小商品城 | 8,504,117.91 | 3.05 |
| 45 | 600862 | 中航高科 | 8,495,712.00 | 3.05 |
| 46 | 002396 | 星网锐捷 | 8,403,918.34 | 3.02 |
| 47 | 002416 | 爱施德 | 8,312,235.00 | 2.98 |
| 48 | 000887 | 中鼎股份 | 8,295,483.38 | 2.98 |
| 49 | 002156 | 通富微电 | 8,230,399.90 | 2.95 |
| 50 | 600348 | 华阳股份 | 8,225,808.69 | 2.95 |
| 51 | 000090 | 天健集团 | 8,141,501.51 | 2.92 |
| 52 | 601128 | 常熟银行 | 8,099,452.00 | 2.91 |
| 53 | 002212 | 天融信 | 8,054,362.00 | 2.89 |
| 54 | 600908 | 无锡银行 | 7,991,471.50 | 2.87 |
| 55 | 603225 | 新凤鸣 | 7,956,720.00 | 2.86 |
| 56 | 300037 | 新宙邦 | 7,945,000.80 | 2.85 |
| 57 | 688536 | 思瑞浦 | 7,899,171.96 | 2.83 |
| 58 | 600673 | 东阳光 | 7,888,636.00 | 2.83 |
| 59 | 002048 | 宁波华翔 | 7,872,738.00 | 2.82 |
| 60 | 603613 | 国联股份 | 7,841,581.10 | 2.81 |
| 61 | 002458 | 益生股份 | 7,810,241.18 | 2.80 |
| 62 | 601872 | 招商轮船 | 7,764,810.60 | 2.79 |
| 63 | 600282 | 南钢股份 | 7,716,981.00 | 2.77 |
| 64 | 603708 | 家家悦 | 7,650,309.00 | 2.75 |
| 65 | 688521 | 芯原股份 | 7,609,018.24 | 2.73 |
| 66 | 000825 | 太钢不锈 | 7,584,093.00 | 2.72 |
| 67 | 000629 | 攀钢钒钛 | 7,583,654.41 | 2.72 |
| 68 | 603317 | 天味食品 | 7,516,958.66 | 2.70 |
| 69 | 000519 | 中兵红箭 | 7,514,800.70 | 2.70 |

| | | | | |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 70 | 600409 | 三友化工 | 7,434,935.54 | 2.67 |
| 71 | 000877 | 天山股份 | 7,336,950.00 | 2.63 |
| 72 | 603290 | 斯达半导 | 7,261,478.00 | 2.61 |
| 73 | 600026 | 中远海能 | 7,227,911.00 | 2.59 |
| 74 | 300285 | 国瓷材料 | 7,070,729.00 | 2.54 |
| 75 | 002092 | 中泰化学 | 7,059,291.00 | 2.53 |
| 76 | 600535 | 天士力 | 6,966,402.20 | 2.50 |
| 77 | 002745 | 木林森 | 6,920,646.00 | 2.48 |
| 78 | 300115 | 长盈精密 | 6,886,088.00 | 2.47 |
| 79 | 603077 | 和邦生物 | 6,879,041.00 | 2.47 |
| 80 | 600316 | 洪都航空 | 6,820,959.00 | 2.45 |
| 81 | 001914 | 招商积余 | 6,519,318.03 | 2.34 |
| 82 | 300136 | 信维通信 | 6,517,968.00 | 2.34 |
| 83 | 600131 | 国网信通 | 6,467,900.00 | 2.32 |
| 84 | 688002 | 睿创微纳 | 6,456,294.54 | 2.32 |
| 85 | 601456 | 国联证券 | 6,412,314.28 | 2.30 |
| 86 | 603267 | 鸿远电子 | 6,407,504.00 | 2.30 |
| 87 | 600859 | 王府井 | 6,375,960.00 | 2.29 |
| 88 | 603444 | 吉比特 | 6,345,727.80 | 2.28 |
| 89 | 600699 | 均胜电子 | 6,330,915.13 | 2.27 |
| 90 | 603355 | 莱克电气 | 6,298,584.90 | 2.26 |
| 91 | 600153 | 建发股份 | 6,271,765.00 | 2.25 |
| 92 | 000630 | 铜陵有色 | 6,199,361.00 | 2.22 |
| 93 | 002268 | 卫士通 | 6,172,614.89 | 2.21 |
| 94 | 000537 | 广宇发展 | 6,094,001.00 | 2.19 |
| 95 | 002191 | 劲嘉股份 | 6,025,817.49 | 2.16 |
| 96 | 600729 | 重庆百货 | 5,980,092.31 | 2.15 |
| 97 | 601156 | 东航物流 | 5,947,898.00 | 2.13 |
| 98 | 300251 | 光线传媒 | 5,935,587.00 | 2.13 |
| 99 | 603707 | 健友股份 | 5,921,618.00 | 2.12 |
| 100 | 000988 | 华工科技 | 5,844,158.82 | 2.10 |
| 101 | 603589 | 口子窖 | 5,840,528.00 | 2.10 |
| 102 | 600325 | 华发股份 | 5,836,271.00 | 2.09 |
| 103 | 300244 | 迪安诊断 | 5,826,765.91 | 2.09 |
| 104 | 300146 | 汤臣倍健 | 5,778,692.00 | 2.07 |
| 105 | 000807 | 云铝股份 | 5,730,839.00 | 2.06 |
| 106 | 600066 | 宇通客车 | 5,715,886.00 | 2.05 |
| 107 | 000970 | 中科三环 | 5,615,140.00 | 2.01 |
| 108 | 600435 | 北方导航 | 5,587,114.10 | 2.00 |
| 109 | 600885 | 宏发股份 | 5,575,936.00 | 2.00 |

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 | 2,193,668,386.95 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 2,279,662,095.65 |

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

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：无。

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投资。

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投资。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

运用衍生品捕捉利率变动的波段交易机会，并通过期现套利、跨期套利和跨品种套利等择机增厚收益，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

报告期内，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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 | 2,034,778.61 |
| 2 | 应收清算款 | 840,480.62 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 288,438.68 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 3,163,697.91 |

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未存在流通受限的情况。

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 | 0.93 | 流通受限股票 |

7.12.8 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告中因四舍五入原因，投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 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 | 户均持有 | 持有人结构 |
|------|------|------|-------|
|------|------|------|-------|

| | 数（户） | 的基金份 额 | 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 500 指数 增强 A | 2,282 | 16,636.29 | 0.00 | 0% | 37,964,01 9.31 | 100% |
| 兴银中证 500 指数 增强 C | 24,309 | 4,196.52 | 21,739,88 3.58 | 21.3108% | 80,273,41 5.01 | 78.6892% |
| 合计 | 26,591 | 5,264.09 | 21,739,88 3.58 | 15.5310% | 118,237,4 34.32 | 84.4690% |

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 500 指数增强 A | 18,074.3 | 0.0476% |
| | 兴银中证 500 指数增强 C | 135,513.1 | 0.1328% |
| | 合计 | 153,587.4 | 0.1097% |

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 500 指数增强 A | 0 |
| | 兴银中证 500 指数增强 C | 0~10 |
| | 合计 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 兴银中证 500 指数增强 A | 0 |
| | 兴银中证 500 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 500 指数增强 A | 兴银中证 500 指数增强 C |
|-------------------------------------|-----------------|-----------------|
| 基金合同生效日（2021 年 03 月 01 日） 基金份额总额 | 120,603,411.79 | 143,434,150.49 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 47,028,780.71 | 194,107,060.11 |
| 本报告期基金总申购份额 | 4,559,943.05 | 27,873,349.86 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 13,624,704.45 | 119,967,111.38 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少） | - | - |

| | | |
|-------------|---------------|----------------|
| 以“-”填列) | | |
| 本报告期末基金份额总额 | 37,964,019.31 | 102,013,298.59 |

§ 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 | 占当期股票成 | 佣金 | 占当期佣金总 | |
| | | | | | | |

| | | 额 | 交总额的比例 | | 量的比例 | |
|------|---|------------------|--------|------------|--------|---|
| 华福证券 | 2 | 1,773,414,134.07 | 39.71% | 410,212.91 | 39.71% | - |
| 广发证券 | 2 | 1,159,661,987.91 | 25.96% | 268,218.59 | 25.96% | - |
| 民生证券 | 2 | 1,171,040,017.41 | 26.22% | 270,871.58 | 26.22% | - |
| 渤海证券 | 2 | 362,224,422.70 | 8.11% | 83,784.89 | 8.11% | - |

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 | - | - | 10,000,000.00 | 100.00% | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 渤海证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |

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 | 关于旗下基金参与联泰基金费率优惠活动并开通定期定额投资的公告 | 上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、指定网站 | 2022-01-12 |
| 2 | 兴银中证 500 指数增强型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告 | 指定网站 | 2022-01-24 |
| 3 | 兴银基金管理有限责任公司旗下部分基金 2021 年第 4 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 | 2022-01-24 |

| | | | |
|----|--|----------------------------|------------|
| 4 | 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 |
| 5 | 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 |
| 6 | 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 |
| 7 | 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 |
| 8 | 兴银中证 500 指数增强型证券投资基金 2021 年年度报告 | 指定网站 | 2022-03-21 |
| 9 | 兴银基金管理有限责任公司旗下部分基金 2021 年年度报告提示性公告 | 上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报 | 2022-03-21 |
| 10 | 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 |
| 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 500 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 |
| 14 | 关于旗下部分基金在兴业银行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 | 2022-06-13 |

§ 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 | 份额占比 |
| 产品 | 1 | 20220101 - 20220518 | 61,587,189.86 | 0 | 61,587,189.86 | 0 | 0% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| (1) 赎回申请延缓支付的风险 上述高占比投资者大额赎回时易构成本基金巨额赎回，中小投资者可能面临小额赎回申 | | | | | | | |

请也需要与该等投资者按同比例延缓支付的风险。

(2) 基金净值大幅波动的风险

上述高占比投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。

(3) 基金规模过小导致的风险

上述高占比投资者赎回后，可能导致基金规模过小。基金可能面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，实现基金投资目标存在一定的不确定性。

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 500 指数增强型证券投资基金变更注册的文件
2. 《兴银中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》
3. 《兴银中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》
4. 《兴银中证 500 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）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