

# 兴银丰运稳益回报混合型证券投资基金

2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人:兴银基金管理有限责任公司

基金托管人:中国民生银行股份有限公司

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。

基金托管人中国民生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

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b> .....                     | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2         |
| 1.2 目录.....                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b> .....                        | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 5         |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....               | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 7         |
| 3.3 其他指标.....                                | 8         |
| <b>§ 4 管理人报告</b> .....                       | <b>8</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 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.....             | 10        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 12        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 12        |
| 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.....       | 13        |
| <b>§ 5 托管人报告</b> .....                       | <b>13</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 13        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 13        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....       | 13        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)</b> .....             | <b>13</b> |
| 6.1 资产负债表.....                               | 13        |
| 6.2 利润表.....                                 | 15        |
| 6.3 净资产(基金净值)变动表.....                        | 16        |
| 6.4 报表附注.....                                | 18        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b> .....                      | <b>43</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                          | 43        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 44        |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....       | 44        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 47        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 49        |
| 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.....      | 49        |
| 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.....   | 50        |
| 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.....   | 50        |
| 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.....      | 50        |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....                     | 50        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....               | 50        |

|   |           |
|---|-----------|
| 7.12 投资组合报告附注.....                      | 50        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>              | <b>52</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....              | 52        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....           | 52        |
| 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.....   | 52        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>              | <b>53</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                | <b>53</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                   | 53        |
| 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.....   | 53        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....        | 53        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                     | 53        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....              | 53        |
| 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.....      | 54        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....             | 54        |
| 10.8 其他重大事件.....                        | 54        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>        | <b>55</b> |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况..... | 55        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                | 55        |
| <b>§ 12 备查文件目录.....</b>                 | <b>55</b> |
| 12.1 备查文件目录.....                        | 56        |
| 12.2 存放地点.....                          | 56        |
| 12.3 查阅方式.....                          | 56        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                   |                  |
|-----------------|-------------------|------------------|
| 基金名称            | 兴银丰运稳益回报混合型证券投资基金 |                  |
| 基金简称            | 兴银丰运稳益回报混合        |                  |
| 基金主代码           | 009205            |                  |
| 基金运作方式          | 契约型开放式            |                  |
| 基金合同生效日         | 2020 年 05 月 21 日  |                  |
| 基金管理人           | 兴银基金管理有限责任公司      |                  |
| 基金托管人           | 中国民生银行股份有限公司      |                  |
| 报告期末基金份额总额      | 494,927,919.46 份  |                  |
| 基金合同存续期         | 不定期               |                  |
| 下属分级基金的基金简称     | 兴银丰运稳益回报混合 A      | 兴银丰运稳益回报混合 C     |
| 下属分级基金的交易代码     | 009205            | 009206           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 193,042,199.24 份  | 301,885,720.22 份 |

### 2.2 基金产品说明

|               |   |           |
|---------------|---|-----------|
| 投资目标          | 本基金在严格控制风险的前提下，力争获得长期稳定的投资收益。   |           |
| 投资策略          | 本基金通过对宏观经济发展趋势、政策面、金融市场利率及市场情绪等方面的分析和预测，综合运用资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、股指期货投资策略及资产支持证券投资策略，力争实现基金资产的长期稳健增值。 |           |
| 业绩比较基准        | 沪深 300 指数收益率×30%+中证综合债指数收益率×70%   |           |
| 风险收益特征        | 本基金为混合型证券投资基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金，通常预期风险与预期收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。                             |           |
| 下属分级基金的风险收益特征 | 风险收益特征同上。   | 风险收益特征同上。 |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      |      | 基金管理人                             | 基金托管人              |
|---------|------|-----------------------------------|--------------------|
| 名称      |      | 兴银基金管理有限责任公司                      | 中国民生银行股份有限公司       |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 赵建兴                               | 罗菲菲                |
|         | 联系电话 | 86-21-20296318                    | 010-58560666       |
|         | 电子邮箱 | zjx@hffunds.cn                    | tgxxpl@cmbc.com.cn |
| 客户服务电话  |      | 40000-96326                       | 95568              |
| 传真      |      | 86-21-68630069                    | 010-57093382       |
| 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 | 北京市西城区复兴门内大街 2 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 | 北京市西城区复兴门内大街 2 号 |
| 邮政编码  | 200120                                | 100031           |
| 法定代表人 | 张贵云                                   | 高迎欣              |

## 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） |                |
|---------------|--|----------------|
|               | 兴银丰运稳益回报混合 A                           | 兴银丰运稳益回报混合 C   |
| 本期已实现收益       | -9,399,220.58                          | -15,197,849.34 |
| 本期利润          | -9,517,367.35                          | -20,267,715.13 |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0441                                | -0.0558        |
| 本期加权平均净值利润率   | -3.53%                                 | -4.48%         |
| 本期基金份额净值增长率   | -2.23%                                 | -2.27%         |
| 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      | 35,660,019.57                          | 54,206,120.24  |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.1847                                 | 0.1796         |
| 期末基金资产净值      | 248,465,730.86                         | 386,875,668.81 |
| 期末基金份额净值      | 1.2871                                 | 1.2815         |
| 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   | 28.71%                                 | 28.15%         |

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

##### 兴银丰运稳益回报混合 A 净值表现

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月      | 4.24%    | 0.53%       | 2.83%      | 0.32%         | 1.41%  | 0.21% |
| 过去三个月      | 3.39%    | 0.63%       | 2.70%      | 0.42%         | 0.69%  | 0.21% |
| 过去六个月      | -2.23%   | 0.61%       | -1.37%     | 0.43%         | -0.86% | 0.18% |
| 过去一年       | 10.37%   | 0.56%       | -0.86%     | 0.37%         | 11.23% | 0.19% |
| 自基金合同生效起至今 | 28.71%   | 0.50%       | 9.79%      | 0.38%         | 18.92% | 0.12% |

##### 兴银丰运稳益回报混合 C 净值表现

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月      | 4.23%    | 0.53%       | 2.83%      | 0.32%         | 1.40%  | 0.21% |
| 过去三个月      | 3.36%    | 0.63%       | 2.70%      | 0.42%         | 0.66%  | 0.21% |
| 过去六个月      | -2.27%   | 0.61%       | -1.37%     | 0.43%         | -0.90% | 0.18% |
| 过去一年       | 10.26%   | 0.56%       | -0.86%     | 0.37%         | 11.12% | 0.19% |
| 自基金合同生效起至今 | 28.15%   | 0.50%       | 9.79%      | 0.38%         | 18.36% | 0.12% |

注：1、本基金成立于 2020 年 5 月 21 日；2、比较基准：中证综合债指数收益率\*70%+沪深 300 指数收益率\*30%。

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2020年05月21日-2022年06月30日)



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2020年05月21日-2022年06月30日)



注：1、本基金成立于 2020 年 5 月 21 日；2、比较基准：中证综合债指数收益率\*70%+沪深 300 指数收益率\*30%。

### 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 |      | 证券从业年限 | 说明            |
|-----|-------------|-------------|------|--------|---------------|
|     |             | 任职日期        | 离任日期 |        |               |
| 袁作栋 | 本基金的基金经理、公司 | 2020-       | -    | 10     | 硕士研究生。历任中兴通讯股 |

|  |                 |       |  |   |   |
|--|-----------------|-------|--|---|---|
|  | 资产配置部副总经理（主持工作） | 05-21 |  | 年 | 份有限公司硬件工程师、商务总监，浙商基金管理有限公司投资研究部行业研究员，华夏久盈资产管理有限责任公司权益投资中心高级研究员（独立管理账户）。2019年6月加入兴银基金管理有限公司任行业研究员，现任兴银基金资产配置部副总经理（主持工作），兼任权益投资部基金经理。 |
|--|-----------------|-------|--|---|---|

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告载明日期。

袁作栋先生为本基金的首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

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

注：无。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人按照法律法规关于公平交易的相关规定，严格执行公司公平交易管理制度，加强了对所管理的不同投资组合向交易价差的分析，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

我们的投资框架是“均衡配置+高性价比资产”。“高性价比”通俗来讲就是未来可能的上涨空

间是可能下跌空间的 2-3 倍以上。下跌空间小，就是俗称的“安全边际”，但是我们不会仅仅因为便宜或者安全就进行投资，还要考虑可能的上涨空间大。上涨的主要来源是公司持续的业绩增长、经营基本面的反转或者是长期的产业空间大。

2022 年上半年，是一次比较大的 V 型市场行情，类似的情形可以追溯至 2015-2016 年和 2018 年。每一次市场相对极端的行情都是对投资体系的一次考验，也是一次体系升级的良机。

我们方法论的基石是《周期》定位。2021 年年底，我们的基金净值达到新高，但是整个市场的《周期》位置没有显著的偏离。因此，我们没有进行大幅度的调仓，仅仅是按照常规，持续地优化组合的性价比，卖掉相对高估的，买入位置相对低的。

我们的组合在第一个季度的回撤在我们的预期之中。四月份，市场极端时刻来临，无论个股性价比如何，泥沙俱下，这对组合造成了较大的伤害。从四月份开始，我们就持续在反思，能否将回撤控制做的更好一些？在 2022 年的年初，很难做出决策，大幅度降低股票仓位。我们组合中一些相对虚弱的标的，比如一些军工和计算机品种，此前享受了一定的 Beta 行情带来的上涨，但是公司的业绩释放没有同步跟随市值的上涨，持续地上涨也让我们对于止盈有所抗拒。但是，这一类标的的性价比确实已经变得比较差了，我们应该更加坚持自己的标准，更积极地进行止盈，把他们替换为更具有性价比的品种。

四月中下旬，根据《周期》的位置，我们判断市场整体的性价比到了一个非常好的位置。因此，我们积极地进行加仓，这是我们后面的反弹能够跟上市场的核心原因。但是，此前净值回撤幅度较大，限制了我们的加仓能力，如果回撤控制的更好一些，我们在底部的加仓会更加坚决。

具体投资标的上，我们利用年报和一季报的窗口期挑选出了很多高性价比个股，总体的效果还是不错的，我们对于自己的选股能力保有信心。消费领域是我们投资的第一大方向，我们在啤酒和食品上的投资进一步提升了消费投资的能力，对于持续表现优异的中药和快递，我们边打边撤。家电领域做了一些调整，重点投资了产品周期上行的高端家电和品牌小家电。科技领域，我们通过调整结构，降低了计算机的持仓，调整了军工的持仓品种。周期领域，我们新增了重卡和一些有色新材料的标的，部分表现优秀，部分还在底部徘徊。制造业我们重点投资了一些汽车零部件、化工材料和造纸。金融领域我们减小银行的持仓，增加了财富管理的券商持仓。

2021 年年底，可转债市场整体的性价比变差，因此我们大幅度降低了转债的仓位。无风险收益率处于低位，我们在利率债的投资也是以流动性管理作为主要目标。

经过市场的 V 型考验，我们更坚信我们投资框架的健壮性，同时让我们意识到，必须强化“高性价比”的标准，《周期》让我们对于市场的 Beta 有了更深刻的理解，我们将尽量在市场底部增加权益仓位，在市场相对高位降低权益仓位，争取为持有人提供更好的投资体验。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴银丰运稳益回报混合 A 基金份额净值为 1.2871 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-2.23%，同期业绩比较基准收益率为-1.37%；截至报告期末兴银丰运稳益回报混合 C 基金份额净值为 1.2815 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-2.27%，同期业绩比较基准收益率为-1.37%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观基本面有所企稳，显示稳增长政策正在发挥效力。对比欧美国家，我们的能源价格仍然处在相对低位，我们的通胀压力仍然可控，流动性预期能够维持相对宽松的状态。疫情有所反复，但是我们的抗疫政策也在持续进化，我们对于未来充满信心。

疫情的反复，国际政治和局部冲突这些环境变量对上市公司的经营都提出了较大的挑战，但是我们在普遍的调研中发现，上市公司仍然在积极地工作，努力发展业务，这是我们投资信心和投资价值的最大来源。同时，外界环境的波动，让我们有机会以更加具有吸引力的价格买入我们心仪的好公司。

经过 2022 年 5 月、6 月的反弹，市场不再像 4 月底那样，遍地都是高性价比的好股票，但是目前的市场位置仍然在均衡位置以下，还是可以有所作为。当然，我们也需要做好应对复杂情况的准备，持续地提升组合的性价比，不可懈怠。

#### 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

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确和完整。

### § 6 半年度财务会计报告(未经审计)

#### 6.1 资产负债表

会计主体：兴银丰运稳益回报混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末 2022 年 06 月<br>30 日 | 上年度末 2021 年 12<br>月 31 日 |
|------------|---------|-------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |         |                         |                          |
| 银行存款       | 6.4.7.1 | 7,464,274.29            | 33,206,579.95            |
| 结算备付金      |         | 7,725,296.09            | 631,322.17               |

|               |            |                             |                              |
|---------------|------------|-----------------------------|------------------------------|
| 存出保证金         |            | 165,483.19                  | 127,340.42                   |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 529,672,588.67              | 508,967,623.59               |
| 其中：股票投资       |            | 235,995,994.30              | 220,688,223.54               |
| 基金投资          |            | -                           | -                            |
| 债券投资          |            | 293,676,594.37              | 288,279,400.05               |
| 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    | 80,000,000.00               | 210,000,000.00               |
| 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         |            | 11,724,840.22               | -                            |
| 应收股利          |            | -                           | -                            |
| 应收申购款         |            | 635,917.54                  | 26,843,559.60                |
| 递延所得税资产       |            | -                           | -                            |
| 其他资产          | 6.4.7.5    | -                           | 2,318,025.13                 |
| 资产总计          |            | 637,388,400.00              | 782,094,450.86               |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末 2022 年 06 月 30 日</b> | <b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债：</b>   |            |                             |                              |
| 短期借款          |            | -                           | -                            |
| 交易性金融负债       |            | -                           | -                            |
| 衍生金融负债        | 6.4.7.3    | -                           | -                            |
| 卖出回购金融资产款     |            | -                           | -                            |
| 应付清算款         |            | -                           | 27,894,874.13                |
| 应付赎回款         |            | 1,318,577.58                | 1,342,625.32                 |
| 应付管理人报酬       |            | 311,491.52                  | 256,358.59                   |
| 应付托管费         |            | 77,872.88                   | 64,089.62                    |
| 应付销售服务费       |            | 31,699.61                   | 26,945.93                    |
| 应付投资顾问费       |            | -                           | -                            |
| 应交税费          |            | 206.86                      | 347.11                       |
| 应付利润          |            | -                           | -                            |
| 递延所得税负债       |            | -                           | -                            |
| 其他负债          | 6.4.7.6    | 307,151.88                  | 414,545.75                   |
| 负债合计          |            | 2,047,000.33                | 29,999,786.45                |
| <b>净资产：</b>   |            |                             |                              |
| 实收基金          | 6.4.7.7    | 494,927,919.46              | 572,745,292.29               |
| 其他综合收益（若有）    |            | -                           | -                            |

|          |         |                |                |
|----------|---------|----------------|----------------|
| 未分配利润    | 6.4.7.8 | 140,413,480.21 | 179,349,372.12 |
| 净资产合计    |         | 635,341,399.67 | 752,094,664.41 |
| 负债和净资产总计 |         | 637,388,400.00 | 782,094,450.86 |

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 494,927,919.46 份。其中兴银丰运稳益回报混合 A 基金份额净值 1.2871 元，基金份额总额 193,042,199.24 份；兴银丰运稳益回报混合 C 基金份额净值 1.2815 元，基金份额总额 301,885,720.22 份。

## 6.2 利润表

会计主体：兴银丰运稳益回报混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                        | 附注号      | 本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日 | 上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日 |
|---------------------------|----------|---------------------------------------|--|
| <b>一、营业总收入</b>            |          | -26,768,335.62                        | 5,128,822.58                               |
| 1. 利息收入                   |          | 1,888,462.10                          | 592,401.28                                 |
| 其中：存款利息收入                 | 6.4.7.9  | 150,361.10                            | 9,330.81                                   |
| 债券利息收入                    |          | -                                     | 570,317.90                                 |
| 资产支持证券利息收入                |          | -                                     | -  |
| 买入返售金融资产收入                |          | 1,738,101.00                          | 12,752.57                                  |
| 证券出借利息收入                  |          | -                                     | -  |
| 其他利息收入                    |          | -                                     | -  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）         |          | -23,851,264.56                        | 6,481,091.03                               |
| 其中：股票投资收益                 | 6.4.7.10 | -31,254,665.47                        | 7,610,671.85                               |
| 基金投资收益                    |          | -                                     | -  |
| 债券投资收益                    | 6.4.7.11 | 5,674,220.10                          | -1,231,777.46                              |
| 资产支持证券投资收益                | 6.4.7.12 | -                                     | -  |
| 贵金属投资收益                   | 6.4.7.13 | -                                     | -  |
| 衍生工具收益                    | 6.4.7.14 | -                                     | -  |
| 股利收益                      | 6.4.7.15 | 1,729,180.81                          | 102,196.64                                 |
| 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 | -5,188,012.56                         | -1,965,817.34                              |
| 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 | 382,479.40                            | 21,147.61                                  |

|                            |            |                |              |
|----------------------------|------------|----------------|--------------|
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 3,016,746.86   | 661,125.51   |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 2,156,554.71   | 222,514.34   |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 539,138.70     | 55,628.57    |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 225,626.52     | 18,901.29    |
| 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                   |            | 118.14         | 63.85        |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.18   | 95,308.79      | 364,017.46   |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | -29,785,082.48 | 4,467,697.07 |
| 减：所得税费用                    |            | -              | -            |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | -29,785,082.48 | 4,467,697.07 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | -              | -            |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | -29,785,082.48 | 4,467,697.07 |

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：兴银丰运稳益回报混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                                 | 本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日 |                |                |                |
|-------------------------------------|---------------------------------------|----------------|----------------|----------------|
|                                     | 实收基金                                  | 其他综合收益<br>(若有) | 未分配利润          | 净资产合计          |
| 一、上期期末净资产（基金净值）                     | 572,745,292.29                        | -              | 179,349,372.12 | 752,094,664.41 |
| 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）                     | 572,745,292.29                        | -              | 179,349,372.12 | 752,094,664.41 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                | -                                     | -              | -              | -              |
|                                     | 77,817,372.83                         |                | 38,935,891.91  | 116,753,264.74 |
| （一）、综合收益总额                          | -                                     | -              | -              | -              |
|                                     |                                       |                | 29,785,082.48  | 29,785,082.48  |
| （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） | -                                     | -              | -              | -              |
|                                     | 77,817,372.83                         |                | 9,150,809.43   | 86,968,182.26  |
| 其中：1. 基金申购款                         | 225,951,418.                          | -              | 66,234,023.4   | 292,185,441.   |



|  |  |            |                |                |
|--|--|------------|----------------|----------------|
|  | 42   |            | 2              | 84             |
| 2. 基金赎回款                                 | -  | -          | -              | -              |
|  | 303,768,791.25                             |            | 75,384,832.85  | 379,153,624.10 |
| (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)                          | 494,927,919.46                             | -          | 140,413,480.21 | 635,341,399.67 |
| 项 目                                      | 上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日 |            |                |                |
|  | 实收基金                                       | 其他综合收益(若有) | 未分配利润          | 净资产合计          |
| 一、上期期末净资产(基金净值)                          | 104,891,781.70                             | -          | 10,244,571.73  | 115,136,353.43 |
| 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)                          | 104,891,781.70                             | -          | 10,244,571.73  | 115,136,353.43 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -  | -          | -              | -              |
|  | 58,921,251.55                              |            | 2,703,997.43   | 61,625,248.98  |
| (一)、综合收益总额                               | -  | -          | 4,467,697.07   | 4,467,697.07   |
| (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)      | -  | -          | -              | -              |
|  | 58,921,251.55                              |            | 7,171,694.50   | 66,092,946.05  |
| 其中: 1. 基金申购款                             | 13,848,558.78                              | -          | 1,757,704.57   | 15,606,263.35  |
| 2. 基金赎回款                                 | -  | -          | -              | -              |
|  | 72,769,810.33                              |            | 8,929,399.07   | 81,699,209.40  |
| (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)                          | 45,970,530.15                              | -          | 7,540,574.30   | 53,511,104.45  |

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

兴银丰运稳益回报混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监许可（2019）2215 号注册募集。《兴银丰运稳益回报混合型证券投资基金合同》于 2020 年 5 月 21 日正式生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，本基金首次募集规模为人民币 392,883,966.29 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，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》相关规定以及《兴银丰运稳益回报混合型证券投资基金合同》等法律文件约定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（包括国债、金融债、公司债、企业债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

基金的投资组合比例为：本基金对股票的投资比例占基金资产的 0%-40%，本基金投资于同业存单的比例不高于基金资产的 20%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；股指期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×30%+中证综合债指数收益率×70%。

### 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的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的影响汇总如下：

(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、买入返售金融资产、应收利息，对应的账面价值分别为人民币 33,206,579.95 元、631,322.17 元、127,340.42 元、210,000,000.00 元、2,318,025.13 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、买入返售金融资产，对应的账面价值分别为人民币 33,210,634.48 元、631,634.68 元、127,403.45 元、210,072,882.15 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 508,967,623.59 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 511,208,336.50 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 248,384.93 元、166,160.82 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 414,545.75 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           | 7,464,274.29         |
| 等于：本金          | 7,462,590.50         |
| 加：应计利息         | 1,683.79             |
| 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             | 7,464,274.29         |

## 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            | 218,123,410.47       | -              | 235,995,994.30 | 17,872,583.83  |              |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                    | -              | -              | -              |              |
| 债券            | 交易所市场                | 251,484,808.34 | 3,904,819.01   | 258,713,050.81 | 3,323,423.46 |
|               | 银行间市场                | 34,084,930.00  | 727,543.56     | 34,963,543.56  | 151,070.00   |
|               | 合计                   | 285,569,738.34 | 4,632,362.57   | 293,676,594.37 | 3,474,493.46 |
| 资产支持证券        | -                    | -              | -              | -              |              |
| 基金            | -                    | -              | -              | -              |              |
| 其他            | -                    | -              | -              | -              |              |
| 合计            | 503,693,148.81       | 4,632,362.57   | 529,672,588.67 | 21,347,077.29  |              |

## 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

注：本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

## 6.4.7.4 买入返售金融资产

## 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

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

|       | 账面余额          | 其中：买断式逆回购 |
|-------|---------------|-----------|
| 交易所市场 | 80,000,000.00 | -         |
| 银行间市场 | -             | -         |
| 合计    | 80,000,000.00 | -         |

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度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：本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末 2022 年 06 月 30 日 |
|-------------|----------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                    |
| 应付赎回费       | 52.73                |
| 应付证券出借违约金   | -                    |
| 应付交易费用      | 221,520.20           |
| 其中：交易所市场    | 221,520.20           |
| 银行间市场       | -                    |
| 应付利息        | -                    |
| 预提费用        | 85,578.95            |
| 合计          | 307,151.88           |

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 兴银丰运稳益回报混合 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          | 203,418,950.14                        | 203,418,950.14 |
| 本期申购          | 62,275,878.57                         | 62,275,878.57  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -72,652,629.47                        | -72,652,629.47 |
| 本期末           | 193,042,199.24                        | 193,042,199.24 |

##### 兴银丰运稳益回报混合 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 | 369,326,342.15                        | 369,326,342.15 |
| 本期申购 | 163,675,539.85                        | 163,675,539.85 |



|               |                 |                 |
|---------------|-----------------|-----------------|
| 本期赎回（以“-”号填列） | -231,116,161.78 | -231,116,161.78 |
| 本期末           | 301,885,720.22  | 301,885,720.22  |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

##### 兴银丰运稳益回报混合 A

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分         | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 本期期初           | 46,671,004.00  | 17,690,213.51 | 64,361,217.51  |
| 本期利润           | -9,399,220.58  | -118,146.77   | -9,517,367.35  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -1,611,763.85  | 2,191,445.31  | 579,681.46     |
| 其中：基金申购款       | 14,298,733.56  | 4,038,401.18  | 18,337,134.74  |
| 基金赎回款          | -15,910,497.41 | -1,846,955.87 | -17,757,453.28 |
| 本期已分配利润        | -              | -             | -              |
| 本期末            | 35,660,019.57  | 19,763,512.05 | 55,423,531.62  |

##### 兴银丰运稳益回报混合 C

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分         | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 本期期初           | 82,986,167.18  | 32,001,987.43 | 114,988,154.61 |
| 本期利润           | -15,197,849.34 | -5,069,865.79 | -20,267,715.13 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -13,582,197.60 | 3,851,706.71  | -9,730,490.89  |
| 其中：基金申购款       | 36,734,178.59  | 11,162,710.09 | 47,896,888.68  |
| 基金赎回款          | -50,316,376.19 | -7,311,003.38 | -57,627,379.57 |
| 本期已分配利润        | -              | -             | -              |
| 本期末            | 54,206,120.24  | 30,783,828.35 | 84,989,948.59  |

#### 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  | 40,409.09                             |
| 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 | 108,610.53                            |
| 其他        | 1,341.48                              |
| 合计        | 150,361.10                            |

#### 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   | 323,697,489.28 |
| 减：卖出股票成本总额 | 354,049,820.52 |
| 减：交易费用     | 902,334.23     |
| 买卖股票差价收入   | -31,254,665.47 |

#### 6.4.7.10.2 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日 |
|------------------------------|---------------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 3,351,275.09                          |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 2,322,945.01                          |
| 债券投资收益——赎回差价收入               | -                                     |
| 债券投资收益——申购差价收入               | -                                     |
| 合计                           | 5,674,220.10                          |

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日 |
|------------------------|---------------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 53,829,596.98                         |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 50,558,073.16                         |
| 减：应计利息总额               | 948,168.32                            |
| 减：交易费用                 | 410.49                                |
| 买卖债券差价收入               | 2,322,945.01                          |

##### 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**

注：无。

**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   | 1,729,180.81                          |
| 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            | 1,729,180.81                          |

**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 | -5,188,012.56                         |
| ——股票投资     | -332,097.35                           |
| ——债券投资     | -4,855,915.21                         |
| ——资产支持证券投资 | -                                     |
| ——基金投资     | -                                     |
| ——贵金属投资    | -                                     |
| ——其他       | -                                     |
| 2. 衍生工具    | -                                     |

|                        |               |
|------------------------|---------------|
| ——权证投资                 | -             |
| 3. 其他                  | -             |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -             |
| 合计                     | -5,188,012.56 |

#### 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 | 382,227.70                            |
| 转换费收入   | 251.70                                |
| 合计      | 382,479.40                            |

#### 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   | -                                     |
| 账户维护费-中债登 | 9,000.00                              |
| 银行汇划费     | 5,229.84                              |
| 合计        | 95,308.79                             |

#### 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 |
| 中国民生银行股份有限公司 | 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**

注：本基金本报告期以及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

**6.4.10.1.2 权证交易**

注：本基金本报告期以及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

**6.4.10.1.3 债券交易**

注：本基金本报告期以及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

**6.4.10.1.4 债券回购交易**

注：本基金本报告期以及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

注：本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方佣金。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目              | 本期 2022 年 01 月 01 日至<br>2022 年 06 月 30 日 | 上年度可比期间 2021 年 01 月<br>01 日至 2021 年 06 月 30 日 |
|-----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 2,156,554.71                             | 222,514.34                                    |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,040,673.51                             | 109,869.45                                    |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.60% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

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<br>2022 年 06 月 30 日 | 上年度可比期间 2021 年 01 月<br>01 日至 2021 年 06 月 30 日 |
|----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 539,138.70                               | 55,628.57                                     |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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                           |              |          |
|                | 兴银丰运稳益回报混合 A                               | 兴银丰运稳益回报混合 C | 合计       |
| 华福证券           | -  | 6,378.43     | 6,378.43 |
| 兴银基金           | -  | 1,181.6      | 1,181.6  |
| 合计             | -  | 7,560.03     | 7,560.03 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日 |              |          |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |              |          |
|                | 兴银丰运稳益回报混合 A                               | 兴银丰运稳益回报混合 C | 合计       |
| 华福证券           | -  | 3,719.71     | 3,719.71 |
| 兴银基金           | -  | 111.46       | 111.46   |
| 合计             | -  | 3,831.17     | 3,831.17 |

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 0.10%，销售服务费计提的计算公式如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间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<br>2022 年 06 月 30 日 |           | 上年度可比期间 2021 年 01 月<br>01 日至 2021 年 06 月 30 日 |          |
|--------------|--|-----------|---|----------|
|              | 期末余额                                     | 当期利息收入    | 期末余额  | 当期利息收入   |
| 中国民生银行股份有限公司 | 7,464,274.29                             | 40,409.09 | 4,338,043.49                                  | 6,395.58 |

#### 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：本基金本报告期末以及上年度可比期间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<br>(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 | -  |
| 688045               | 必易微  | 2022年05月19日 | 6个月 | 科创板新股锁定 | 55.15 | 61.98  | 3,939        | 217,235.85 | 244,139.22   | -  |
| 301139               | 元道通信 | 2022年06月30日 | 6个月 | 新股流通受限  | 38.46 | 38.46  | 5,651        | 217,337.46 | 217,337.46   | -  |
| 301239               | 普瑞眼科 | 2022年06月22日 | 6个月 | 新股流通受限  | 33.65 | 33.65  | 5,747        | 193,386.55 | 193,386.55   | -  |
| 688267               | 中触媒  | 2022年02月09日 | 6个月 | 科创板新股锁定 | 41.90 | 31.90  | 3,390        | 142,041.00 | 108,141.00   | -  |
| 688163               | 赛伦生物 | 2022年03月02日 | 6个月 | 科创板新股锁定 | 33.03 | 23.56  | 3,607        | 119,139.21 | 84,980.92    | -  |
| 301233               | 盛帮股份 | 2022年06月24日 | 6个月 | 新股流通受限  | 41.52 | 41.52  | 1,576        | 65,435.52  | 65,435.52    | -  |
| 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  | 1,850        | 35,483.00  | 59,329.50    | -  |
| 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  | 2,102        | 36,301.54  | 31,172.66    | -  |
| 301302               | 华如科技 | 2022年06月16日 | 6个月 | 创业板新股锁定 | 52.03 | 56.42  | 466          | 24,245.98  | 26,291.72    | -  |
| 301236               | 软通动力 | 2022年03月    | 6个月 | 创业板新    | 48.59 | 31.38  | 789          | 38,334.88  | 24,758.82    | -  |



|            |          |                        |      |                     |            |           |       |               |               |   |
|------------|----------|------------------------|------|---------------------|------------|-----------|-------|---------------|---------------|---|
|            |          | 08 日                   |      | 股锁<br>定             |            |           |       |               |               |   |
| 3012<br>16 | 万凯<br>新材 | 2022 年<br>03 月<br>21 日 | 6 个月 | 创业<br>板新<br>股锁<br>定 | 35.6<br>8  | 29.8<br>4 | 775   | 27,652<br>.00 | 23,126<br>.00 | - |
| 3011<br>09 | 军信<br>股份 | 2022 年<br>04 月<br>06 日 | 6 个月 | 创业<br>板新<br>股锁<br>定 | 23.2<br>2  | 16.1<br>4 | 1,387 | 32,199<br>.25 | 22,386<br>.18 | - |
| 3012<br>68 | 铭利<br>达  | 2022 年<br>03 月<br>29 日 | 6 个月 | 创业<br>板新<br>股锁<br>定 | 28.5<br>0  | 34.8<br>7 | 641   | 18,268<br>.50 | 22,351<br>.67 | - |
| 3012<br>06 | 三元<br>生物 | 2022 年<br>01 月<br>26 日 | 6 个月 | 创业<br>板新<br>股锁<br>定 | 72.8<br>7  | 45.6<br>9 | 489   | 35,631<br>.80 | 22,342<br>.41 | - |
| 3011<br>50 | 中一<br>科技 | 2022 年<br>04 月<br>14 日 | 6 个月 | 创业<br>板新<br>股锁<br>定 | 109.<br>25 | 82.7<br>6 | 265   | 28,950<br>.12 | 21,931<br>.40 | - |
| 3012<br>63 | 泰恩<br>康  | 2022 年<br>03 月<br>22 日 | 6 个月 | 创业<br>板新<br>股锁<br>定 | 19.9<br>3  | 31.3<br>8 | 682   | 13,592<br>.26 | 21,401<br>.16 | - |
| 3011<br>22 | 采纳<br>股份 | 2022 年<br>01 月<br>19 日 | 6 个月 | 创业<br>板新<br>股锁<br>定 | 50.3<br>1  | 70.3<br>7 | 301   | 15,143<br>.31 | 21,181<br>.37 | - |
| 3012<br>07 | 华兰<br>疫苗 | 2022 年<br>02 月<br>10 日 | 6 个月 | 创业<br>板新<br>股锁<br>定 | 56.8<br>8  | 56.4<br>2 | 356   | 20,249<br>.28 | 20,085<br>.52 | - |
| 3011<br>87 | 欧圣<br>电气 | 2022 年<br>04 月<br>13 日 | 6 个月 | 创业<br>板新<br>股锁<br>定 | 21.3<br>3  | 22.5<br>4 | 876   | 18,685<br>.08 | 19,745<br>.04 | - |
| 3012<br>01 | 诚达<br>药业 | 2022 年<br>01 月<br>12 日 | 6 个月 | 创业<br>板新<br>股锁<br>定 | 72.6<br>9  | 71.5<br>4 | 267   | 19,408<br>.23 | 19,101<br>.18 | - |
| 3012<br>56 | 华融<br>化学 | 2022 年<br>03 月         | 6 个月 | 创业<br>板新            | 8.05       | 10.0<br>8 | 1,831 | 14,739<br>.55 | 18,456<br>.48 | - |

|            |          |                        |      |                     |           |           |       |               |               |   |
|------------|----------|------------------------|------|---------------------|-----------|-----------|-------|---------------|---------------|---|
|            |          | 14 日                   |      | 股锁<br>定             |           |           |       |               |               |   |
| 3011<br>62 | 国能<br>日新 | 2022 年<br>04 月<br>19 日 | 6 个月 | 创业<br>板新<br>股锁<br>定 | 45.1<br>3 | 54.1<br>1 | 334   | 15,073<br>.42 | 18,072<br>.74 | - |
| 3011<br>12 | 信邦<br>智能 | 2022 年<br>06 月<br>20 日 | 6 个月 | 创业<br>板新<br>股锁<br>定 | 27.5<br>3 | 45.0<br>4 | 399   | 10,984<br>.47 | 17,970<br>.96 | - |
| 3012<br>19 | 腾远<br>钻业 | 2022 年<br>03 月<br>10 日 | 6 个月 | 创业<br>板新<br>股锁<br>定 | 96.7<br>6 | 87.8<br>2 | 187   | 18,093<br>.92 | 16,422<br>.34 | - |
| 3011<br>03 | 何氏<br>眼科 | 2022 年<br>03 月<br>14 日 | 6 个月 | 创业<br>板新<br>股锁<br>定 | 32.6<br>9 | 32.0<br>2 | 507   | 16,575<br>.00 | 16,234<br>.14 | - |
| 3011<br>20 | 新特<br>电气 | 2022 年<br>04 月<br>11 日 | 6 个月 | 创业<br>板新<br>股锁<br>定 | 13.7<br>3 | 15.4<br>9 | 1,032 | 14,169<br>.36 | 15,985<br>.68 | - |
| 3012<br>86 | 侨源<br>股份 | 2022 年<br>06 月<br>06 日 | 6 个月 | 创业<br>板新<br>股锁<br>定 | 16.9<br>1 | 19.7<br>9 | 784   | 13,257<br>.44 | 15,515<br>.36 | - |
| 3011<br>23 | 奕东<br>电子 | 2022 年<br>01 月<br>14 日 | 6 个月 | 创业<br>板新<br>股锁<br>定 | 37.2<br>3 | 25.3<br>9 | 597   | 22,226<br>.31 | 15,157<br>.83 | - |
| 3011<br>51 | 冠龙<br>节能 | 2022 年<br>03 月<br>30 日 | 6 个月 | 创业<br>板新<br>股锁<br>定 | 30.8<br>2 | 21.4<br>6 | 703   | 21,666<br>.46 | 15,086<br>.38 | - |
| 3011<br>17 | 佳缘<br>科技 | 2022 年<br>01 月<br>07 日 | 6 个月 | 创业<br>板新<br>股锁<br>定 | 46.8<br>0 | 54.4<br>4 | 262   | 12,261<br>.60 | 14,263<br>.28 | - |
| 3012<br>48 | 杰创<br>智能 | 2022 年<br>04 月<br>13 日 | 6 个月 | 创业<br>板新<br>股锁<br>定 | 39.0<br>7 | 29.8<br>7 | 472   | 18,441<br>.04 | 14,098<br>.64 | - |
| 3012<br>12 | 联盛<br>化学 | 2022 年<br>04 月         | 6 个月 | 创业<br>板新            | 29.6<br>7 | 33.2<br>8 | 416   | 12,342<br>.72 | 13,844<br>.48 | - |

|        |      |                  |      |         |       |       |     |           |           |   |
|--------|------|------------------|------|---------|-------|-------|-----|-----------|-----------|---|
|        |      | 07 日             |      | 股锁定     |       |       |     |           |           |   |
| 301298 | 东利机械 | 2022 年 05 月 27 日 | 6 个月 | 创业板新股锁定 | 12.68 | 20.83 | 634 | 8,039.12  | 13,206.22 | - |
| 301148 | 嘉戎技术 | 2022 年 04 月 14 日 | 6 个月 | 创业板新股锁定 | 38.39 | 23.90 | 516 | 19,809.24 | 12,332.40 | - |
| 301258 | 富士莱  | 2022 年 03 月 21 日 | 6 个月 | 创业板新股锁定 | 48.30 | 41.68 | 295 | 14,248.50 | 12,295.60 | - |
| 301259 | 艾布鲁  | 2022 年 04 月 18 日 | 6 个月 | 创业板新股锁定 | 18.39 | 24.94 | 483 | 8,882.37  | 12,046.02 | - |
| 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 | 249 | 13,040.13 | 11,909.67 | - |
| 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 | - |
| 301220 | 亚香股份 | 2022 年 06 月 15 日 | 6 个月 | 创业板新股锁定 | 35.98 | 39.15 | 285 | 10,254.30 | 11,157.75 | - |
| 301237 | 和顺科技 | 2022 年 03 月 16 日 | 6 个月 | 创业板新股锁定 | 56.69 | 41.86 | 261 | 14,796.09 | 10,925.46 | - |
| 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 | 644 | 9,898.28  | 10,297.56 | - |
| 301222 | 浙江恒威 | 2022 年 03 月 02 日 | 6 个月 | 创业板新股锁定 | 33.98 | 28.96 | 332 | 11,281.36 | 9,614.72  | - |
| 301288 | 清研环境 | 2022 年 04 月      | 6 个月 | 创业板新    | 19.09 | 19.98 | 452 | 8,628.68  | 9,030.96  | - |

|        |      |                  |      |         |       |       |     |           |          |   |
|--------|------|------------------|------|---------|-------|-------|-----|-----------|----------|---|
|        |      | 14 日             |      | 股锁定     |       |       |     |           |          |   |
| 301125 | 腾亚精工 | 2022 年 05 月 27 日 | 6 个月 | 创业板新股锁定 | 22.49 | 27.42 | 327 | 7,354.23  | 8,966.34 | - |
| 301163 | 宏德股份 | 2022 年 04 月 11 日 | 6 个月 | 创业板新股锁定 | 26.27 | 32.33 | 277 | 7,276.79  | 8,955.41 | - |
| 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 | - |
| 301135 | 瑞德智能 | 2022 年 04 月 01 日 | 6 个月 | 创业板新股锁定 | 31.98 | 26.26 | 338 | 10,809.24 | 8,875.88 | - |
| 301110 | 青木股份 | 2022 年 03 月 04 日 | 6 个月 | 创业板新股锁定 | 63.10 | 39.85 | 202 | 12,746.20 | 8,049.70 | - |
| 301181 | 标榜股份 | 2022 年 02 月 11 日 | 6 个月 | 创业板新股锁定 | 40.25 | 30.59 | 257 | 10,344.25 | 7,861.63 | - |
| 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 | - |
| 301279 | 金道科技 | 2022 年 04 月 06 日 | 6 个月 | 创业板新股锁定 | 31.20 | 22.81 | 296 | 9,235.20  | 6,751.76 | - |

#### 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：本基金本报告期末和上年度末均未持有除国债、政策性金融债、央行票据及地方政府债以外的需按短期信通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**

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2022 年 06 月 30 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
|--------|----------------------|-----------------------|
| AAA    | 67,424,743.92        | 80,583,690.70         |
| AAA 以下 | 18,487,712.36        | 18,598,202.25         |
| 未评级    | -                    | -                     |
| 合计     | 85,912,456.28        | 99,181,892.95         |

注：以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债、央行票据及地方政府债等。

**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 金融资产和金融负债的到期期限分析**

注：无。

**6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 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<br>2022 年 06<br>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                       | 7,464,274.29  | -             | -             | -              | -             | -              | 7,464,274.29   |
| 结算备付金                      | 7,725,296.09  | -             | -             | -              | -             | -              | 7,725,296.09   |
| 存出保证金                      | 165,483.19    | -             | -             | -              | -             | -              | 165,483.19     |
| 交易性金融资产                    | 25,907,290.74 | 71,188,145.48 | 19,800,763.20 | 156,923,571.17 | 19,856,823.78 | 235,995,994.30 | 529,672,588.67 |
| 买入返售金融资产                   | 80,000,000.00 | -             | -             | -              | -             | -              | 80,000,000.00  |

|                       |                |               |                |                |               |                |                |
|-----------------------|----------------|---------------|----------------|----------------|---------------|----------------|----------------|
| 应收清算款                 | -              | -             | -              | -              | -             | 11,724,840.22  | 11,724,840.22  |
| 应收申购款                 | -              | -             | -              | -              | -             | 635,917.54     | 635,917.54     |
| 资产总计                  | 121,262,344.31 | 71,188,145.48 | 19,800,763.20  | 156,923,571.17 | 19,856,823.78 | 248,356,752.06 | 637,388,400.00 |
| 负债                    |                |               |                |                |               |                |                |
| 应付赎回款                 | -              | -             | -              | -              | -             | 1,318,577.58   | 1,318,577.58   |
| 应付管理人报酬               | -              | -             | -              | -              | -             | 311,491.52     | 311,491.52     |
| 应付托管费                 | -              | -             | -              | -              | -             | 77,872.88      | 77,872.88      |
| 应付销售服务费               | -              | -             | -              | -              | -             | 31,699.61      | 31,699.61      |
| 应交税费                  | -              | -             | -              | -              | -             | 206.86         | 206.86         |
| 其他负债                  | -              | -             | -              | -              | -             | 307,151.88     | 307,151.88     |
| 负债总计                  | -              | -             | -              | -              | -             | 2,047,000.33   | 2,047,000.33   |
| 利率敏感度缺口               | 121,262,344.31 | 71,188,145.48 | 19,800,763.20  | 156,923,571.17 | 19,856,823.78 | 246,309,751.73 | 635,341,399.67 |
| 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                  | 33,206,579.95  | -             | -              | -              | -             | -              | 33,206,579.95  |
| 结算备付金                 | 631,322.17     | -             | -              | -              | -             | -              | 631,322.17     |
| 存出保证金                 | 127,340.42     | -             | -              | -              | -             | -              | 127,340.42     |
| 交易性金融资产               | -              | -             | 115,609,865.50 | 152,437,490.50 | 20,232,044.05 | 220,688,223.54 | 508,967,623.59 |
| 买入返售金融资产              | 210,000,000.00 | -             | -              | -              | -             | -              | 210,000,000.00 |
| 其他资产                  | -              | -             | -              | -              | -             | 2,318,025.13   | 2,318,025.13   |
| 应收申购款                 | -              | -             | -              | -              | -             | 26,843,559.60  | 26,843,559.60  |
| 资产总计                  | 243,965,242.54 | -             | 115,609,865.50 | 152,437,490.50 | 20,232,044.05 | 249,849,808.27 | 782,094,450.86 |
| 负债                    |                |               |                |                |               |                |                |



|         |                |   |                |                |               |                |                |
|---------|----------------|---|----------------|----------------|---------------|----------------|----------------|
| 应付证券清算款 | -              | - | -              | -              | -             | 27,894,874.13  | 27,894,874.13  |
| 应付赎回款   | -              | - | -              | -              | -             | 1,342,625.32   | 1,342,625.32   |
| 应付管理人报酬 | -              | - | -              | -              | -             | 256,358.59     | 256,358.59     |
| 应付托管费   | -              | - | -              | -              | -             | 64,089.62      | 64,089.62      |
| 应付销售服务费 | -              | - | -              | -              | -             | 26,945.93      | 26,945.93      |
| 应交税费    | -              | - | -              | -              | -             | 347.11         | 347.11         |
| 其他负债    | -              | - | -              | -              | -             | 414,545.75     | 414,545.75     |
| 负债总计    | -              | - | -              | -              | -             | 29,999,786.45  | 29,999,786.45  |
| 利率敏感度缺口 | 243,965,242.54 | - | 115,609,865.50 | 152,437,490.50 | 20,232,044.05 | 219,850,021.82 | 752,094,664.41 |

#### 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                  | -992,704.81                 | -589,182.59           |
|    | 市场利率下降 25 个基点                  | 1,013,292.06                | 594,677.30            |

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

## 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末 2022 年 06 月 30 日 |               | 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  | 235,995,994.30       | 37.14         | 220,688,223.54        | 29.34         |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                    | -             | -                     | -             |
| 交易性金融资产—债券投资  | 293,676,594.37       | 46.22         | 288,279,400.05        | 38.33         |
| 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            | 529,672,588.67       | 83.37         | 508,967,623.59        | 67.67         |

## 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%                   | 12,582,101.38               | 7,050,934.74          |
|    | 沪深 300 指数下跌 5%                   | -12,582,101.38              | -7,050,934.74         |

## 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          | 318,918,085.29       | 319,696,482.10        |
| 第二层次          | 210,754,503.38       | 189,271,141.49        |
| 第三层次          | -                    | -                     |
| 合计            | 529,672,588.67       | 508,967,623.59        |

#### 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   | 235,995,994.30 | 37.03        |
|    | 其中:股票  | 235,995,994.30 | 37.03        |
| 2  | 基金投资   | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资 | 293,676,594.37 | 46.07        |
|    | 其中:债券  | 293,676,594.37 | 46.07        |
|    | 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          | 80,000,000.00  | 12.55  |
|   | 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      | 15,189,570.38  | 2.38   |
| 8 | 其他各项资产            | 12,526,240.95  | 1.97   |
| 9 | 合计                | 637,388,400.00 | 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         | 57,483.00      | 0.01         |
| B  | 采矿业              | 1,332,320.89   | 0.21         |
| C  | 制造业              | 181,770,713.67 | 28.61        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -              | -            |
| E  | 建筑业              | -              | -            |
| F  | 批发和零售业           | 25,954.72      | 0.00         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 6,602,474.00   | 1.04         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 24,237,247.57  | 3.81         |
| J  | 金融业              | 16,812,804.40  | 2.65         |
| K  | 房地产业             | -              | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | -              | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 7,586.82       | 0.00         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 304,898.06     | 0.05         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -            |
| P  | 教育               | -              | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | 209,893.17     | 0.03         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 4,634,618.00   | 0.73         |
| S  | 综合               | -              | -            |
|    | 合计               | 235,995,994.30 | 37.14        |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)     | 公允价值          | 占基金资产净值比例<br>(%) |
|----|--------|------|-----------|---------------|------------------|
| 1  | 002705 | 新宝股份 | 970,900   | 21,350,091.00 | 3.36             |
| 2  | 002101 | 广东鸿图 | 567,100   | 12,929,880.00 | 2.04             |
| 3  | 000729 | 燕京啤酒 | 1,265,200 | 12,221,832.00 | 1.92             |
| 4  | 600131 | 国网信通 | 877,500   | 11,802,375.00 | 1.86             |
| 5  | 300034 | 钢研高纳 | 246,300   | 10,388,934.00 | 1.64             |
| 6  | 000999 | 华润三九 | 224,801   | 10,116,045.00 | 1.59             |
| 7  | 600690 | 海尔智家 | 344,300   | 9,454,478.00  | 1.49             |
| 8  | 000768 | 中航西飞 | 305,700   | 9,259,653.00  | 1.46             |
| 9  | 000776 | 广发证券 | 455,300   | 8,514,110.00  | 1.34             |
| 10 | 000951 | 中国重汽 | 654,900   | 8,507,151.00  | 1.34             |
| 11 | 688066 | 航天宏图 | 98,160    | 7,735,008.00  | 1.22             |
| 12 | 601799 | 星宇股份 | 44,500    | 7,609,500.00  | 1.20             |
| 13 | 600456 | 宝钛股份 | 119,700   | 7,110,180.00  | 1.12             |
| 14 | 603345 | 安井食品 | 42,200    | 7,084,114.00  | 1.12             |
| 15 | 000338 | 潍柴动力 | 474,700   | 5,919,509.00  | 0.93             |
| 16 | 600885 | 宏发股份 | 136,020   | 5,692,437.00  | 0.90             |
| 17 | 300438 | 鹏辉能源 | 90,500    | 5,561,225.00  | 0.88             |
| 18 | 300596 | 利安隆  | 120,100   | 5,297,611.00  | 0.83             |
| 19 | 300251 | 光线传媒 | 489,400   | 4,634,618.00  | 0.73             |
| 20 | 600030 | 中信证券 | 213,900   | 4,633,074.00  | 0.73             |
| 21 | 600085 | 同仁堂  | 87,600    | 4,632,288.00  | 0.73             |
| 22 | 605376 | 博迁新材 | 74,400    | 4,337,520.00  | 0.68             |
| 23 | 600346 | 恒力石化 | 183,300   | 4,076,592.00  | 0.64             |
| 24 | 300285 | 国瓷材料 | 99,500    | 3,574,040.00  | 0.56             |
| 25 | 600285 | 羚锐制药 | 268,900   | 3,369,317.00  | 0.53             |
| 26 | 688030 | 山石网科 | 148,492   | 3,081,209.00  | 0.48             |
| 27 | 000895 | 双汇发展 | 104,900   | 3,073,570.00  | 0.48             |
| 28 | 002078 | 太阳纸业 | 241,600   | 2,974,096.00  | 0.47             |
| 29 | 002064 | 华峰化学 | 341,100   | 2,878,884.00  | 0.45             |
| 30 | 688257 | 新锐股份 | 70,064    | 2,775,935.68  | 0.44             |
| 31 | 603733 | 仙鹤股份 | 96,100    | 2,556,260.00  | 0.40             |
| 32 | 601658 | 邮储银行 | 444,400   | 2,395,316.00  | 0.38             |
| 33 | 603885 | 吉祥航空 | 130,700   | 2,351,293.00  | 0.37             |
| 34 | 002120 | 韵达股份 | 136,400   | 2,326,984.00  | 0.37             |
| 35 | 002032 | 苏泊尔  | 37,400    | 2,107,116.00  | 0.33             |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 36 | 688213 | 思特威  | 33,296  | 1,908,193.76 | 0.30 |
| 37 | 600233 | 圆通速递 | 82,600  | 1,684,214.00 | 0.27 |
| 38 | 600938 | 中国海油 | 84,005  | 1,332,320.89 | 0.21 |
| 39 | 600036 | 招商银行 | 30,102  | 1,270,304.40 | 0.20 |
| 40 | 600166 | 福田汽车 | 433,300 | 1,226,239.00 | 0.19 |
| 41 | 605338 | 巴比食品 | 37,000  | 1,128,870.00 | 0.18 |
| 42 | 300811 | 铂科新材 | 9,700   | 944,004.00   | 0.15 |
| 43 | 300253 | 卫宁健康 | 106,300 | 933,314.00   | 0.15 |
| 44 | 002557 | 洽洽食品 | 11,800  | 671,774.00   | 0.11 |
| 45 | 603588 | 高能环境 | 22,136  | 255,228.08   | 0.04 |
| 46 | 688045 | 必易微  | 3,939   | 244,139.22   | 0.04 |
| 47 | 002352 | 顺丰控股 | 4,300   | 239,983.00   | 0.04 |
| 48 | 301139 | 元道通信 | 5,651   | 217,337.46   | 0.03 |
| 49 | 301239 | 普瑞眼科 | 5,747   | 193,386.55   | 0.03 |
| 50 | 601360 | 三六零  | 12,800  | 109,056.00   | 0.02 |
| 51 | 688267 | 中触媒  | 3,390   | 108,141.00   | 0.02 |
| 52 | 603517 | 绝味食品 | 1,600   | 92,512.00    | 0.01 |
| 53 | 688163 | 赛伦生物 | 3,607   | 84,980.92    | 0.01 |
| 54 | 301233 | 盛帮股份 | 1,576   | 65,435.52    | 0.01 |
| 55 | 301238 | 瑞泰新材 | 1,892   | 60,909.96    | 0.01 |
| 56 | 300498 | 温氏股份 | 2,700   | 57,483.00    | 0.01 |
| 57 | 601089 | 福元医药 | 1,749   | 36,816.45    | 0.01 |
| 58 | 301150 | 中一科技 | 404     | 34,690.21    | 0.01 |
| 59 | 301217 | 铜冠铜箔 | 2,102   | 31,172.66    | 0.00 |
| 60 | 001323 | 慕思股份 | 573     | 28,111.38    | 0.00 |
| 61 | 301302 | 华如科技 | 466     | 26,291.72    | 0.00 |
| 62 | 301236 | 软通动力 | 832     | 26,175.67    | 0.00 |
| 63 | 301263 | 泰恩康  | 813     | 25,954.72    | 0.00 |
| 64 | 301207 | 华兰疫苗 | 454     | 25,907.70    | 0.00 |
| 65 | 301268 | 铭利达  | 707     | 24,886.07    | 0.00 |
| 66 | 301206 | 三元生物 | 537     | 24,619.05    | 0.00 |
| 67 | 301162 | 国能日新 | 431     | 24,013.02    | 0.00 |
| 68 | 301216 | 万凯新材 | 775     | 23,126.00    | 0.00 |
| 69 | 301109 | 军信股份 | 1,423   | 23,002.86    | 0.00 |
| 70 | 301219 | 腾远钴业 | 252     | 22,433.54    | 0.00 |
| 71 | 301187 | 欧圣电气 | 959     | 21,941.22    | 0.00 |
| 72 | 301122 | 采纳股份 | 301     | 21,181.37    | 0.00 |
| 73 | 301256 | 华融化学 | 1,908   | 19,288.08    | 0.00 |
| 74 | 301201 | 诚达药业 | 267     | 19,101.18    | 0.00 |
| 75 | 301112 | 信邦智能 | 399     | 17,970.96    | 0.00 |
| 76 | 301120 | 新特电气 | 1,111   | 17,402.94    | 0.00 |
| 77 | 301103 | 何氏眼科 | 515     | 16,506.62    | 0.00 |
| 78 | 301151 | 冠龙节能 | 725     | 15,597.22    | 0.00 |

|     |        |      |     |           |      |
|-----|--------|------|-----|-----------|------|
| 79  | 301248 | 杰创智能 | 516 | 15,539.20 | 0.00 |
| 80  | 301286 | 侨源股份 | 784 | 15,515.36 | 0.00 |
| 81  | 301212 | 联盛化学 | 458 | 15,433.76 | 0.00 |
| 82  | 301123 | 奕东电子 | 597 | 15,157.83 | 0.00 |
| 83  | 301258 | 富士莱  | 342 | 14,430.81 | 0.00 |
| 84  | 301117 | 佳缘科技 | 262 | 14,263.28 | 0.00 |
| 85  | 301220 | 亚香股份 | 349 | 13,905.27 | 0.00 |
| 86  | 301259 | 艾布鲁  | 528 | 13,369.02 | 0.00 |
| 87  | 301298 | 东利机械 | 640 | 13,358.92 | 0.00 |
| 88  | 301148 | 嘉戎技术 | 553 | 13,298.10 | 0.00 |
| 89  | 301237 | 和顺科技 | 310 | 13,120.66 | 0.00 |
| 90  | 301163 | 宏德股份 | 364 | 12,210.08 | 0.00 |
| 91  | 301222 | 浙江恒威 | 415 | 12,169.46 | 0.00 |
| 92  | 301097 | 天益医疗 | 249 | 11,909.67 | 0.00 |
| 93  | 301137 | 哈焊华通 | 731 | 11,822.67 | 0.00 |
| 94  | 301116 | 益客食品 | 577 | 11,805.42 | 0.00 |
| 95  | 001268 | 联合精密 | 409 | 11,337.48 | 0.00 |
| 96  | 301288 | 清研环境 | 516 | 10,587.44 | 0.00 |
| 97  | 301125 | 腾亚精工 | 370 | 10,311.38 | 0.00 |
| 98  | 301130 | 西点药业 | 270 | 10,254.90 | 0.00 |
| 99  | 301135 | 瑞德智能 | 376 | 9,966.48  | 0.00 |
| 100 | 301110 | 青木股份 | 213 | 8,526.00  | 0.00 |
| 101 | 301279 | 金道科技 | 356 | 8,265.56  | 0.00 |
| 102 | 301181 | 标榜股份 | 257 | 7,861.63  | 0.00 |
| 103 | 301158 | 德石股份 | 379 | 7,724.02  | 0.00 |
| 104 | 301228 | 实朴检测 | 373 | 7,586.82  | 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<br>金额      | 占期初基金资产净值比例<br>(%) |
|----|--------|------|-------------------|--------------------|
| 1  | 605338 | 巴比食品 | 19,847,703.5<br>2 | 2.64               |
| 2  | 002705 | 新宝股份 | 19,373,397.0<br>0 | 2.58               |
| 3  | 000776 | 广发证券 | 15,845,793.0<br>0 | 2.11               |
| 4  | 002987 | 京北方  | 15,799,314.9<br>7 | 2.10               |
| 5  | 000951 | 中国重汽 | 14,717,908.0<br>0 | 1.96               |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 6  | 600131 | 国网信通 | 11,354,367.63 | 1.51 |
| 7  | 000002 | 万科 A | 10,318,604.00 | 1.37 |
| 8  | 600036 | 招商银行 | 10,242,764.10 | 1.36 |
| 9  | 600690 | 海尔智家 | 10,046,996.00 | 1.34 |
| 10 | 000729 | 燕京啤酒 | 9,777,743.00  | 1.30 |
| 11 | 002557 | 洽洽食品 | 8,638,952.75  | 1.15 |
| 12 | 688030 | 山石网科 | 8,167,811.83  | 1.09 |
| 13 | 600346 | 恒力石化 | 8,105,279.00  | 1.08 |
| 14 | 002101 | 广东鸿图 | 7,985,424.00  | 1.06 |
| 15 | 002078 | 太阳纸业 | 7,225,022.78  | 0.96 |
| 16 | 300348 | 长亮科技 | 7,074,762.00  | 0.94 |
| 17 | 600030 | 中信证券 | 6,973,790.60  | 0.93 |
| 18 | 601799 | 星宇股份 | 6,811,418.00  | 0.91 |
| 19 | 300034 | 钢研高纳 | 6,506,543.46  | 0.87 |
| 20 | 000999 | 华润三九 | 6,049,433.18  | 0.80 |

#### 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  | 601985 | 中国核电 | 17,539,611.10 | 2.33            |
| 2  | 600233 | 圆通速递 | 17,339,752.00 | 2.31            |
| 3  | 002557 | 洽洽食品 | 16,831,836.00 | 2.24            |
| 4  | 605338 | 巴比食品 | 15,809,857.00 | 2.10            |
| 5  | 000999 | 华润三九 | 14,870,990.00 | 1.98            |
| 6  | 002987 | 京北方  | 12,703,028.82 | 1.69            |
| 7  | 002032 | 苏泊尔  | 12,292,600.00 | 1.63            |
| 8  | 600036 | 招商银行 | 10,578,448.24 | 1.41            |
| 9  | 002352 | 顺丰控股 | 10,563,804.00 | 1.40            |
| 10 | 000776 | 广发证券 | 10,287,651.00 | 1.37            |



|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
|    |        |      | 0            |      |
| 11 | 603885 | 吉祥航空 | 9,833,613.40 | 1.31 |
| 12 | 000002 | 万科 A | 9,240,080.06 | 1.23 |
| 13 | 601111 | 中国国航 | 7,680,036.00 | 1.02 |
| 14 | 688087 | 英科再生 | 6,623,957.11 | 0.88 |
| 15 | 603588 | 高能环境 | 6,608,619.57 | 0.88 |
| 16 | 600131 | 国网信通 | 6,514,975.59 | 0.87 |
| 17 | 000951 | 中国重汽 | 6,310,314.60 | 0.84 |
| 18 | 300348 | 长亮科技 | 5,993,236.00 | 0.80 |
| 19 | 600285 | 羚锐制药 | 5,649,318.00 | 0.75 |
| 20 | 000768 | 中航西飞 | 5,429,225.00 | 0.72 |

#### 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 | 369,689,688.63 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 323,697,489.28 |

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值           | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 135,745,972.05 | 21.37        |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 72,018,166.04  | 11.34        |
|    | 其中：政策性金融债 | 72,018,166.04  | 11.34        |
| 4  | 企业债券      | -              | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -            |
| 6  | 中期票据      | -              | -            |
| 7  | 可转债(可交换债) | 85,912,456.28  | 13.52        |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 293,676,594.37 | 46.22        |

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量(张)   | 公允价值          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 019641 | 20 国债 11 | 695,000 | 71,188,145.48 | 11.20        |
| 2  | 210322 | 21 进出 22 | 300,000 | 30,718,512.33 | 4.83         |
| 3  | 018008 | 国开 1802  | 273,490 | 28,864,494.2  | 4.54         |

|   |        |          |         |               |      |
|---|--------|----------|---------|---------------|------|
|   |        |          |         | 6             |      |
| 4 | 019658 | 21 国债 10 | 254,230 | 25,907,290.74 | 4.08 |
| 5 | 019666 | 22 国债 01 | 195,810 | 19,800,763.20 | 3.12 |

### 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

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

### 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

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

#### 7.11.2 本期国债期货投资评价

报告期内本基金未进行国债期货投资。

### 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

本基金不存在前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情形。

### 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 | 165,483.19    |
| 2  | 应收清算款 | 11,724,840.22 |
| 3  | 应收股利  | -             |
| 4  | 应收利息  | -             |
| 5  | 应收申购款 | 635,917.54    |
| 6  | 其他应收款 | -             |
| 7  | 待摊费用  | -             |
| 8  | 其他    | -             |
| 9  | 合计    | 12,526,240.95 |

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称    | 公允价值          | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|---------|---------------|---------------|
| 1  | 110059 | 浦发转债    | 17,688,014.27 | 2.78          |
| 2  | 113021 | 中信转债    | 16,676,058.09 | 2.62          |
| 3  | 113037 | 紫银转债    | 16,567,991.61 | 2.61          |
| 4  | 110067 | 华安转债    | 14,548,299.30 | 2.29          |
| 5  | 113044 | 大秦转债    | 8,663,574.05  | 1.36          |
| 6  | 123107 | 温氏转债    | 7,709,525.76  | 1.21          |
| 7  | 113024 | 核建转债    | 1,741,400.03  | 0.27          |
| 8  | 110082 | 宏发转债    | 707,593.21    | 0.11          |
| 9  | 123104 | 卫宁转债    | 427,332.59    | 0.07          |
| 10 | 113043 | 财通转债    | 397,872.42    | 0.06          |
| 11 | 113635 | 升 21 转债 | 299,457.94    | 0.05          |
| 12 | 128135 | 洽洽转债    | 256,008.05    | 0.04          |
| 13 | 128083 | 新北转债    | 229,328.96    | 0.04          |

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

### 7.12.6 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         | 持有人户数（户） | 户均持有的基金份额 | 持有人结构        |         |                |          |
|--------------|----------|-----------|--------------|---------|----------------|----------|
|              |          |           | 机构投资者        |         | 个人投资者          |          |
|              |          |           | 持有份额         | 占总份额比例  | 持有份额           | 占总份额比例   |
| 兴银丰运稳益回报混合 A | 2,739    | 70,479.08 | 7,606,141.65 | 3.9401% | 185,436,057.59 | 96.0599% |
| 兴银丰运稳益回报混合 C | 15,951   | 18,925.82 | 0            | 0%      | 301,885,720.22 | 100%     |
| 合计           | 18,690   | 26,480.89 | 7,606,141.65 | 1.5368% | 487,321,777.81 | 98.4632% |

### 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 | 兴银丰运稳益回报混合 A | 152,535.53 | 0.0790%  |
|                  | 兴银丰运稳益回报混合 C | 400,944.76 | 0.1328%  |
|                  | 合计           | 553,480.29 | 0.1118%  |

### 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、基金投资和部门负责持有本开放式基金 | 兴银丰运稳益回报混合 A | 0~10              |
|                             | 兴银丰运稳益回报混合 C | 0~10              |
|                             | 合计           | 0~10              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金             | 兴银丰运稳益回报混合 A | 0                 |
|                             | 兴银丰运稳益回报混合 C | 0                 |

|  |    |   |
|--|----|---|
|  | 合计 | 0 |
|--|----|---|

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                     | 兴银丰运稳益回报混合 A   | 兴银丰运稳益回报混合 C   |
|-------------------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日（2020 年 05 月 21 日）<br>基金份额总额 | 165,719,489.24 | 227,164,477.05 |
| 本报告期期初基金份额总额                        | 203,418,950.14 | 369,326,342.15 |
| 本报告期基金总申购份额                         | 62,275,878.57  | 163,675,539.85 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                       | 72,652,629.47  | 231,116,161.78 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少<br>以“-”填列）        | -              | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                        | 193,042,199.24 | 301,885,720.22 |

## § 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

报告期内基金投资策略未改变。

### 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、托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易           |              | 应支付该券商的佣金  |            | 备注 |
|------|--------|----------------|--------------|------------|------------|----|
|      |        | 成交金额           | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金         | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 广发证券 | 2      | 678,925,947.82 | 100.00%      | 496,502.61 | 100.00%    | -  |

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易          |              | 债券回购交易        |                | 权证交易 |              | 基金交易 |              |
|------|---------------|--------------|---------------|----------------|------|--------------|------|--------------|
|      | 成交金额          | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额          | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
| 广发证券 | 88,815,249.38 | 100.00%      | 15,649,000.00 | 100.00%        | -    | -            | -    | -            |

## 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                   | 法定披露方式                     | 法定披露日期     |
|----|--|----------------------------|------------|
| 1  | 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  | 兴银丰运稳益回报混合型证券投资基金 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                          | 上海证券报、证券日报、证券              | 2022-01-29 |

|    |  |                            |            |
|----|--|----------------------------|------------|
|    | 于高级管理人员变更的公告                           | 时报、中国证券报、指定网站              |            |
| 5  | 兴银基金管理有限责任公司关于高级管理人员变更的公告              | 上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、指定网站 | 2022-03-01 |
| 6  | 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 |
| 7  | 兴银丰运稳益回报混合型证券投资基金 2021 年年度报告           | 指定网站                       | 2022-03-21 |
| 8  | 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 |
| 9  | 兴银基金管理有限责任公司关于旗下全资子公司自有资金申购公司旗下基金的公告   | 上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报      | 2022-04-06 |
| 10 | 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 |
| 11 | 兴银丰运稳益回报混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告       | 指定网站                       | 2022-04-22 |
| 12 | 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 |
| 13 | 关于旗下部分基金在安信证券开通转换、定期定额投资并参与费率优惠活动的公告   | 证券日报、上海证券报、证券时报、指定网站       | 2022-06-06 |
| 14 | 关于旗下部分基金在广发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 | 2022-06-13 |
| 15 | 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

注：本基金本报告期内单一投资者持有基金份额比例未出现超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

## 12.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予基金募集注册的文件
2. 《兴银丰运稳益回报混合型证券投资基金基金合同》
3. 《兴银丰运稳益回报混合型证券投资基金招募说明书》
4. 《兴银丰运稳益回报混合型证券投资基金托管协议》
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照
6. 报告期内在指定信息披露媒体上公开披露的各项公告

## 12.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处。

## 12.3 查阅方式

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

兴银基金管理有限责任公司  
二〇二二年八月三十一日