

兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金

2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人:兴银基金管理有限责任公司

基金托管人:平安银行股份有限公司

报告送出日期:2023 年 03 月 30 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据基金合同规定，于2023年3月28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。

本报告期自2022年1月26日起至12月31日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
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.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....	13
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
§ 6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息.....	14
6.2 审计报告的基本内容.....	14
§ 7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	18
7.3 净资产（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
§ 8 投资组合报告	50
8.1 期末基金资产组合情况.....	50
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	50
8.3 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.....	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	62
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	77

8.6 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.....	77
8.7 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.....	77
8.8 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.....	77
8.9 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.....	77
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	78
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	78
8.12 投资组合报告附注.....	78
§ 9 基金份额持有人信息.....	79
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	79
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	79
9.3 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.....	79
§ 10 开放式基金份额变动.....	80
§ 11 重大事件揭示.....	80
11.1 基金份额持有人大会决议.....	80
11.2 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.....	80
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	81
11.4 基金投资策略的改变.....	81
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	81
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	81
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	81
11.8 其他重大事件.....	82
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	84
12.1 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.....	84
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	84
§ 13 备查文件目录.....	84
13.1 备查文件目录.....	84
13.2 存放地点.....	85
13.3 查阅方式.....	85

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	兴银中证 1000 指数增强	
基金主代码	014831	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 01 月 26 日	
基金管理人	兴银基金管理有限责任公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	284,606,084.95 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	兴银中证 1000 指数增强 A	兴银中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	014831	014832
报告期末下属分级基金的份额总额	165,443,457.50 份	119,162,627.45 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.hffunds.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市南京西路 1266 号恒隆广场 2 期 16 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2022 年 01 月 26 日（基金合同生效日）-2022 年 12 月 31 日	
	兴银中证 1000 指数增强 A	兴银中证 1000 指数增强 C
本期已实现收益	-20,962,933.10	-15,018,078.68
本期利润	-25,528,551.74	-18,855,226.40
加权平均基金份额本期利润	-0.1588	-0.1988

本期加权平均净值利润率	-16.89%	-21.22%
本期基金份额净值增长率	-15.30%	-15.45%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	
期末可供分配利润	-25,306,546.81	-18,413,023.29
期末可供分配基金份额利润	-0.1530	-0.1545
期末基金资产净值	140,136,910.69	100,749,604.16
期末基金份额净值	0.8470	0.8455
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	
基金份额累计净值增长率	-15.30%	-15.45%

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、本基金财务报表的实际编制期间为 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日，无上年度可比期间数据。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴银中证 1000 指数增强 A 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.82%	1.12%	2.46%	1.14%	-3.28%	-0.02%
过去六个月	-17.58%	1.20%	-9.67%	1.21%	-7.91%	0.01%
自基金合同生效起至今	-15.30%	1.40%	-11.24%	1.50%	-4.06%	0.10%

兴银中证 1000 指数增强 C 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.87%	1.12%	2.46%	1.14%	-3.33%	0.02%
过去六个月	-17.66%	1.20%	-9.67%	1.21%	-7.99%	0.01%

自基金合同生效起至今	-15.45%	1.40%	-11.24%	1.50%	-4.21%	-0.10%
------------	---------	-------	---------	-------	--------	--------

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

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022年01月26日-2022年12月31日)

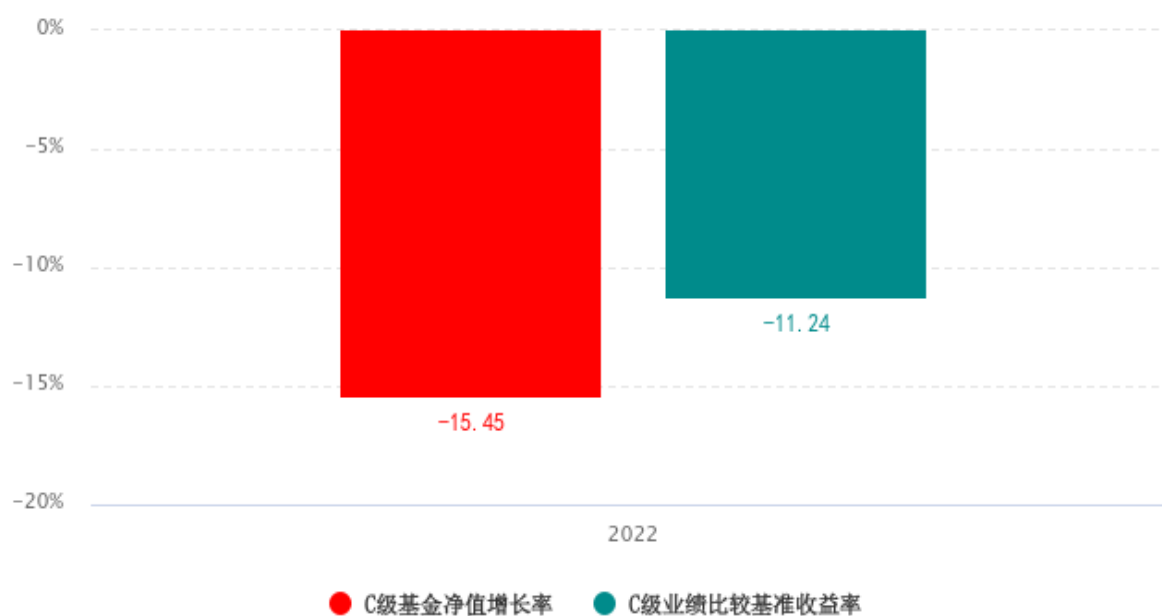
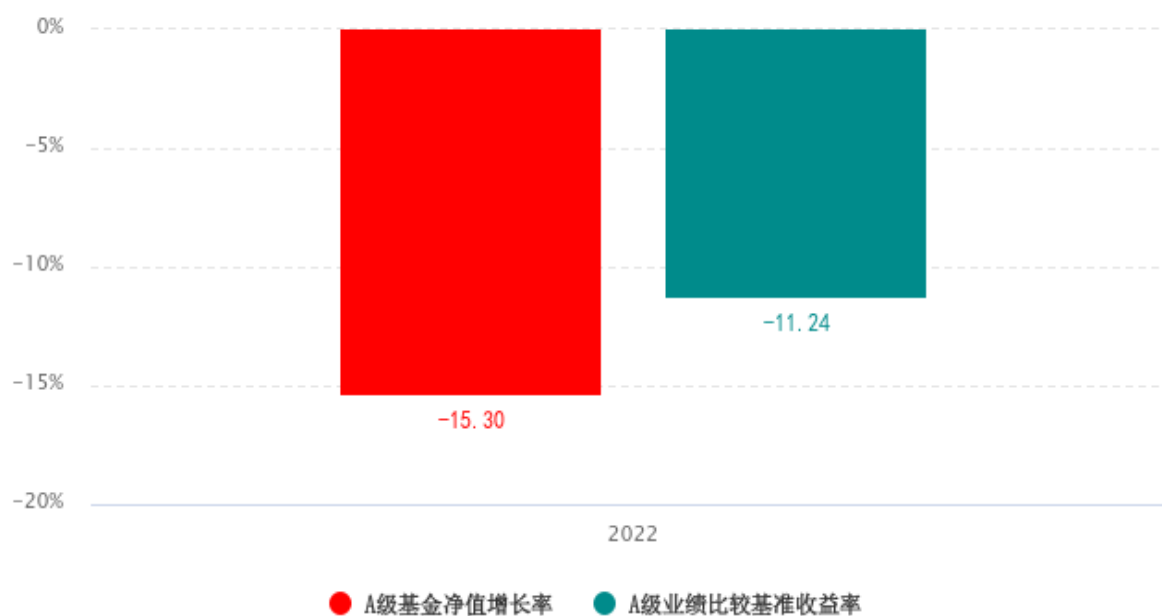


C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022年01月26日-2022年12月31日)



注：1、本基金合同于 2022 年 1 月 26 日生效，截至报告期末基金合同生效未满一年。
2、按基金合同规定，本基金的建仓期为自基金合同生效之日起 6 个月。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合本基金合同的有关规定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同于 2022 年 1 月 26 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

注：无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金自成立日以来未进行过利润分配。

§ 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，本公司共管理基金 47 只。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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

注：1、任职日期和离任日期一般情况下指公司做出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则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。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情形，无须披露该项。

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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人制定了公平交易管理的制度，并根据法律法规及监管规定结合实践予以修订完善。本基金管理人主要从研究的公平、决策的公平、交易的公平、公平交易的监控评估、公平交易的报告和信息披露等方面对公平交易行为进行规范，从而达到保证本基金管理人管理的不同投资组合得到公平对待、保护投资者合法权益的目的。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

产品主要采用多因子选股策略。其中因子涵盖行业、盈利、成长、规模、估值、风险、市场情绪、分析师预期等多维大类因子及其项下的各细分小类因子。团队根据市场状态的变化和因子研究的最新结论，对因子库和模型进行更新，以能够追踪市场的变动，持续跟踪稳健的优质因子。在上述基础上，兼顾股票本身流动性和风险分散度的同时构建股票投资组合。策略资产组合整体结构稳定，仓位控制灵活，市场适应性强。产品策略研究建立在对历史数据的大规模分析及对未来的高精度预测上，同时严格按照策略执行交易管理及风控。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴银中证 1000 指数增强 A 基金份额净值为 0.8470 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-15.30%，同期业绩比较基准收益率为-11.24%；截至报告期末兴银中证 1000 指数

增强 C 基金份额净值为 0.8455 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-15.45%，同期业绩比较基准收益率为-11.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2023 年，随着疫情政策的调整，我们认为可以关注市场的三条主线：

1、 疫情放开和地产托底的政策预期；展望 2023 年，我们认为消费复苏和地产企稳不仅是具备业绩弹性的主线，也是宏观经济向上的主要推动力，是其他主线盈利复苏的前提假设。

2、 互联网+数字经济；2022 年底中央经济工作会议旗帜鲜明支持数字经济和平台企业发展，我们预计互联网和数字经济有望在 2023 年的经济复苏过程中继续扮演重要角色。

3、 后疫情时代的医疗行业机会：从新冠防治、到后疫情时代持续复苏的医药细分领域。医药板块受疫情影响，内部结构分化十分显著，伴随主要城市疫情快速“过峰”，当前市场对业绩的预期已经渡过新冠的预防、治疗阶段，开始进入后疫情时代行业盈利长期修复的环节。

围绕上述主线，投资者可以关注消费、计算机、医疗器械、新能源等行业的投资机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，不断健全完善内控机制，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行，推动公司的合规文化和内部风险控制机制的完善与优化。本基金管理人主要监察稽核工作如下：

(1) 加强公司和基金日常运作的合规审核。做好在新基金产品开发、新投资品种、及其他创新业务中法律、合规及风险控制方面的支持，坚持定期对投资、研究、交易、核算、销售等各项业务实施事前、事中、事后的合规性审核，确保基金运作的诚信和合法合规性符合监管要求。

(2) 深入重点专项稽核工作。本基金管理人进一步梳理业务模式、主要监管规则、潜在风险点等，全面、深入地对关键业务领域进行专项稽核，内容涵盖相关业务领域的各个重要环节的内部控制与风险防范，促进制度规章及时更新，优化操作流程，提升业务线合规管理及风控意识。

(3) 持续规范对投资研究交易特定岗位的通讯管理。对投资研究交易特定岗位通讯工具在交易时间集中管理，并定期或不定期的对其网络即时通讯记录、电话录音等进行抽查，有效地防范了各种形式的利益输送行为。

(4) 强化法规学习，开展内控培训，促进合规文化建设。本基金管理人及时根据新颁布的法律法规开展合规宣传培训工作，通过专题培训、律师讲座、合规期刊等多种形式进一步加强内部合规培训力度，深化基金从业人员合规风险意识，提升职业道德素养，营造良好合规氛围，促进公司稳定健康地发展。

(5) 完成各种定期报告及临时公告的信息披露工作。按照法规要求，做好旗下各支基金的信息披露工作，做到信息披露的真实、完整、准确、及时。

在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，完善内控制度，提高工作水

平，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 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

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2300407 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金（以下简称“兴银中证 1000 指数增强”）财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表、自 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则（以下简称“企业会计准则”）、《资产管理产品相关会计处理规定》及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“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编制，公允反映了兴银中证 1000 指数增强 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日止期间的

	经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于兴银中证 1000 指数增强，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	兴银中证 1000 指数增强管理人兴银基金管理有限责任公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括兴银中证 1000 指数增强 2022 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人管理层负责按照企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及财务报表附注 7.4.2 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编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估兴银中证 1000 指数增强的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非兴银中证 1000 指数增强预计在清算时资产无法按照公允价值处置。基金管理人治理层负责监督兴银中证 1000 指数增强的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于

	内部控制之上，未能发现由于舞弊 导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效 性发表意见。(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证 据，就可能对导致对兴银中证 1000 指数增强持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准 则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充 分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然 而，未来的事项或情况可能导致兴银中证 1000 指数增强不能持续经营。(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映 相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通， 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	黄小熠	欧梦澍
会计师事务所的地址	上海市南京西路 1266 号恒隆广场 2 期 16 楼	
审计报告日期	2023-03-29	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	4,435,449.19
结算备付金		33,851,871.38
存出保证金		3,204,228.00
交易性金融资产	7.4.7.2	198,962,519.61
其中：股票投资		198,962,519.61
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-

衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
债权投资		-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资		-
其他权益工具投资		-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		848,870.87
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-
资产总计		241,302,939.05
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		19,738.73
应付管理人报酬		166,270.57
应付托管费		41,567.61
应付销售服务费		17,065.90
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.6	171,781.39
负债合计		416,424.20
净资产：		
实收基金	7.4.7.7	284,606,084.95
其他综合收益		-
未分配利润	7.4.7.8	-43,719,570.10
净资产合计		240,886,514.85
负债和净资产总计		241,302,939.05

注：1、报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额总额 284,606,084.95 份。其中兴银中证 1000 指数增强 A 基金份额净值 0.8470 元，基金份额总额 165,443,457.50 份；兴银中证 1000 指数增强 C 基金份额净值 0.8455 元，基金份额总额 119,162,627.45 份。

2、本基金财务报表的实际编制期间为 2022 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日，无上年度可比期间数据。

7.2 利润表

会计主体：兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2022 年 01 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 01 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-41,795,152.80
1. 利息收入		431,665.34
其中：存款利息收入	7.4.7.9	422,641.05
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		9,024.29
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-34,267,396.88
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-34,247,531.08
基金投资收益	7.4.7.11	-
债券投资收益	7.4.7.12	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-1,180,265.95
股利收益	7.4.7.16	1,160,400.15
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-8,402,766.36
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	443,345.10
减：二、营业总支出		2,588,625.34
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,781,849.42
2. 托管费	7.4.10.2.2	445,462.30
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	164,874.38
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	7.4.7.19	-
7. 税金及附加		1,739.24
8. 其他费用	7.4.7.20	194,700.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-44,383,778.14

减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-44,383,778.14
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-44,383,778.14

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2022 年 01 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	268,420,575.82	-	-	268,420,575.82
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	16,185,509.13	-	43,719,570.10	-27,534,060.97
（一）、综合收益总额	-	-	44,383,778.14	-44,383,778.14
（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）	16,185,509.13	-	664,208.04	16,849,717.17
其中：1. 基金申购款	244,775,006.03	-	-8,539,365.57	236,235,640.46
2. 基金赎回款	-	-	9,203,573.61	-
	228,589,496.90			219,385,923.29
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	284,606,084.95	-	43,719,570.10	240,886,514.85

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》相关规定以及《兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》等法律文件约定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以标的指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、银行存款、债券（包括国债、中央银行票据、地方政府债、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债、企业债、公司债、超短期融资券、短期融资券、中期票据、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券）、债券回购、股指期货、股票期权、资产支持证券、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金管理人根据相关法律法规可以参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终，在扣除股指期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金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和《资产管理产品相关会计处理规定》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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要

求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况、自 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。

本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资等。

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

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

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

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

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

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

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

(b) 金融负债的分类

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

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

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

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认**(a) 金融工具的初始确认**

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

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b) 金融工具的后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

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

- 以摊余成本计量的金融资产

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

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

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

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

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

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

- 所转移金融资产的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

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

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

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

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

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

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

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

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

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

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

核销

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

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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

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

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

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

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

期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

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

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

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产款在资金实际占用期间按实际利率法逐日确认为利息支出。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；A类基金份额和C类基金份额之间由于收取费用的不同，将导致在可供分配利润上有所不同；同一类别每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

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

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

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	4,435,449.19
等于：本金	4,434,717.27
加：应计利息	731.92
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	4,435,449.19

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	206,998,885.97	-	198,962,519.61	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	8,036,366.36
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	206,998,885.97	-	198,962,519.61	8,036,366.36

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	21,727,920.00	0.00	-	-
—股指期货	21,727,920.00	0.00	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	21,727,920.00	-	-	-

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《证券投资基金股指期货投资会计核算业务细则（试行）》及《企业会计准则——金融工具列报》的相关规定，“权益衍生工具——股指期货投资”与“证券清算款——股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“权益衍生工具——股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IM2301	中证 1000 股指期货 2301	17	21,361,520.00	-366,400.00
合计				-366,400.00
减：可抵销期货暂收款				-366,400.00
净额				0.00

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金于本报告期末未持有任何买入返售金融资产。

7.4.7.5 其他资产

注：本基金于本报告期末未持有任何其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	31.39
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	171,750.00
合计	171,781.39

7.4.7.7 实收基金

兴银中证 1000 指数增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	170,524,346.65	170,524,346.65
本期申购	98,642,113.51	98,642,113.51
本期赎回（以“-”号填列）	-103,723,002.66	-103,723,002.66
本期末	165,443,457.50	165,443,457.50

兴银中证 1000 指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	97,896,229.17	97,896,229.17
本期申购	146,132,892.52	146,132,892.52
本期赎回（以“-”号填列）	-124,866,494.24	-124,866,494.24
本期末	119,162,627.45	119,162,627.45

注：此处申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

兴银中证 1000 指数增强 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-20,962,933.10	-4,565,618.64	-25,528,551.74
本期基金份额交易产生的变动数	824,415.05	-602,410.12	222,004.93
其中：基金申购款	-4,863,762.12	1,715,568.21	-3,148,193.91
基金赎回款	5,688,177.17	-2,317,978.33	3,370,198.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-20,138,518.05	-5,168,028.76	-25,306,546.81

兴银中证 1000 指数增强 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-15,018,078.68	-3,837,147.72	-18,855,226.40
本期基金份额交易产生的变动数	320,709.09	121,494.02	442,203.11
其中：基金申购款	-7,588,046.12	2,196,874.46	-5,391,171.66
基金赎回款	7,908,755.21	-2,075,380.44	5,833,374.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-14,697,369.59	-3,715,653.70	-18,413,023.29

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	23,859.63
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	398,781.42
其他	-

合计	422,641.05
----	------------

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 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 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	5,463,115,191.41
减：卖出股票成本总额	5,488,727,146.42
减：交易费用	8,635,576.07
买卖股票差价收入	-34,247,531.08

7.4.7.10.2 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金在本报告期内无股票投资证券出借差价收入。

7.4.7.11 基金投资收益

注：本基金在本报告期内无基金投资收益。

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

注：本基金在本报告期内无债券投资收益。

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金在本报告期内无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金在本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金在本报告期内无衍生工具收益买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2022 年 01 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
----	--

股指期货投资收益	-1,140,395.00
减：其他衍生工具收益应缴纳增值税	17,392.42
减：交易费用	22,478.53
合计	-1,180,265.95

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	1,160,400.15
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	1,160,400.15

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 01 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-8,036,366.36
——股票投资	-8,036,366.36
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-366,400.00
——权证投资	-
——期货投资	-366,400.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-8,402,766.36

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	442,104.24
转换费收入	1,240.86
合计	443,345.10

7.4.7.19 信用减值损失

注：本基金在本报告期内无信用减值损失。

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	43,500.00
信息披露费	150,000.00
证券出借违约金	-
账户开户费	1,200.00
合计	194,700.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

7.4.9.1 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

本报告期未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。

7.4.9.2 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
平安银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
华福证券有限责任公司	基金管理人的股东、基金销售机构
国脉科技股份有限公司	基金管理人的股东
上海兴瀚资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 01 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31
-------	--

	日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华福证券	11,148,068,039.83	100.00%

7.4.10.1.2 权证交易

注：本基金在本报告期内没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

注：本基金在本报告期内没有通过关联方的交易单元进行过债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 01 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
华福证券	120,000,000.00	100.00%

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 01 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华福证券	3,085,773.78	100.00%	0.00	0.00%

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用华福证券证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还从华福证券获得证券研究综合服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,781,849.42
其中：支付销售机构的客户维护费	864,227.71

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.8% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	445,462.30

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022 年 01 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴银中证 1000 指数增强 A	兴银中证 1000 指数增强 C	合计
平安银行	-	452.97	452.97
兴银基金	-	4,692.92	4,692.92
华福证券	-	154,862.98	154,862.98
合计	-	160,008.87	160,008.87

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 0.2%，销售服务费计提的计算公式如下：

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

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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 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

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

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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

注：本基金的管理人在本报告期内未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末未持有本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 01 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
平安银行股份有限公司	4,435,449.19	23,859.63

注：本基金通过“平安银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于华福证券有限责任公司的结算备付金，于 2022 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 25,759,495.24 元。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期末未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明**7.4.11 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。

7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688351	微	2022	6 个月	科	16.51	24.76	4,378	72,280.78	108,399.28	-

	电生理	年 08 月 23 日		科创板新股锁定							
688403	汇成股份	2022 年 08 月 10 日	6 个月	科创板新股锁定	8.88	10.12	9,895	87,867.60	100,137.40	-	
688203	海正生材	2022 年 08 月 09 日	6 个月	科创板新股锁定	16.68	15.09	4,389	73,208.52	66,230.01	-	
688459	哈铁科技	2022 年 09 月 28 日	6 个月	科创板新股锁定	13.58	8.27	6,883	93,471.14	56,922.41	-	
688455	科捷智能	2022 年 09 月 07 日	6 个月	科创板新股锁定	21.88	13.12	3,815	83,472.20	50,052.80	-	
301239	普瑞眼科	2022 年 06 月 22 日	6 个月	创业板新股锁定	33.65	69.68	240	8,076.00	16,723.20	-	
301095	广立微	2022 年 07 月 28 日	6 个月	创业板	58.00	86.49	191	11,078.00	16,519.59	-	

		日		新股 锁定							
301327	华宝新能	2022 年 09 月 08 日	6 个月	创业 板新 股锁 定	237.50	176.97	85	20,187.50	15,042.45	-	
301308	江波龙	2022 年 07 月 27 日	6 个月	创业 板新 股锁 定	55.67	56.72	214	11,913.38	12,138.08	-	
301367	怡和嘉业	2022 年 10 月 21 日	6 个月	创业 板新 股锁 定	119.88	175.78	68	8,151.84	11,953.04	-	
301230	泓博医药	2022 年 10 月 21 日	6 个月	创业 板新 股锁 定	40.00	48.32	193	7,720.00	9,325.76	-	
301330	熵基科技	2022 年 08 月 10 日	6 个月	创业 板新 股锁 定	43.32	31.31	290	12,562.80	9,079.90	-	
301338	凯格精机	2022 年 08 月 08 日	6 个月	创业 板新 股	46.33	48.99	184	8,524.72	9,014.16	-	

				锁定						
301152	天力锂能	2022年08月19日	6个月	创业板新股锁定	57.00	46.64	188	10,716.00	8,768.32	-
301121	紫建电子	2022年08月01日	6个月	创业板新股锁定	61.07	49.77	174	10,626.18	8,659.98	-
301363	美好医疗	2022年09月28日	6个月	创业板新股锁定	30.66	37.85	207	6,346.62	7,834.95	-
301273	瑞晨环保	2022年10月11日	6个月	创业板新股锁定	37.89	37.79	207	7,843.23	7,822.53	-
301161	唯万密封	2022年09月06日	6个月	创业板新股锁定	18.66	21.73	346	6,456.36	7,518.58	-
301132	满坤科技	2022年08月03日	6个月	创业板新股锁定	26.80	24.48	296	7,932.80	7,246.08	-

301227	森鹰窗业	2022年09月16日	6个月	创业板新股锁定	38.25	29.49	237	9,065.25	6,989.13	-
301306	西测测试	2022年07月19日	6个月	创业板新股锁定	43.23	42.29	164	7,089.72	6,935.56	-
301197	工大科雅	2022年07月29日	6个月	创业板新股锁定	25.50	20.08	323	8,236.50	6,485.84	-
301339	通行宝	2022年09月02日	6个月	创业板新股锁定	18.78	15.59	413	7,756.14	6,438.67	-
301313	凡拓数创	2022年09月22日	6个月	创业板新股锁定	25.25	29.14	218	5,504.50	6,352.52	-
301171	易点天下	2022年08月10日	6个月	创业板新股锁定	18.18	17.72	358	6,508.44	6,343.76	-
301139	元道	2022年06	6个月	创业	38.46	25.31	249	9,576.54	6,302.19	-

	通信	月 30 日		板新股锁定							
301223	中荣股份	2022 年 10 月 13 日	6 个月	创业板新股锁定	26.28	18.13	342	8,987.76	6,200.46	-	
301326	捷邦科技	2022 年 09 月 09 日	6 个月	创业板新股锁定	51.72	36.62	168	8,688.96	6,152.16	-	
301115	建科股份	2022 年 08 月 23 日	6 个月	创业板新股锁定	42.05	24.04	255	10,722.75	6,130.20	-	
301270	汉仪股份	2022 年 08 月 19 日	6 个月	创业板新股锁定	25.68	28.37	210	5,392.80	5,957.70	-	
301285	鸿日达	2022 年 09 月 21 日	6 个月	创业板新股锁定	14.60	12.60	469	6,847.40	5,909.40	-	
301282	金禄电子	2022 年 08 月 18 日	6 个月	创业板新	30.38	25.25	227	6,896.26	5,731.75	-	

				股 锁 定						
301176	逸豪新材	2022 年 09 月 21 日	6 个月	创 业 板 新 股 锁 定	23.88	16.89	322	7,689.36	5,438.58	-
301233	盛帮股份	2022 年 06 月 24 日	6 个月	创 业 板 新 股 锁 定	41.52	34.30	154	6,394.08	5,282.20	-
301316	慧博云通	2022 年 09 月 29 日	6 个月	创 业 板 新 股 锁 定	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88	-
301319	唯特偶	2022 年 09 月 22 日	6 个月	创 业 板 新 股 锁 定	47.75	53.27	90	4,297.50	4,794.30	-
301318	维海德	2022 年 08 月 03 日	6 个月	创 业 板 新 股 锁 定	64.68	41.74	101	6,532.68	4,215.74	-
301309	万得凯	2022 年 09 月 08 日	6 个月	创 业 板 新 股 锁	39.00	24.46	124	4,836.00	3,033.04	-

				定					
--	--	--	--	---	--	--	--	--	--

注：根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及创业板股票需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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度的证券，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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末未持有除国债、政策性金融债、央行票据及地方政府债以外的需按短期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末未持有需按短期信用评级列示的资产支持证券。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末未持有需按短期信用评级列示的同业存单。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末未持有除国债、政策性金融债、央行票据及地方政府债以外的需按长期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末未持有需按长期信用评级列示的资产支持证券。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末未持有需按长期信用评级列示的同业存单。

7.4.13.3 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 7.4.12 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。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

7.4.13.3.2 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 12 月 31	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
--------------------------	------------	-----------	--------------	-------	------------------	-----	----

日					上		
资产							
银行存款	4,435,449.19	-	-	-	-	-	4,435,449.19
结算备付金	33,851,871.38	-	-	-	-	-	33,851,871.38
存出保证金	3,204,228.00	-	-	-	-	-	3,204,228.00
交易性金融资产	-	-	-	-	-	198,962,519.61	198,962,519.61
应收申购款	-	-	-	-	-	848,870.87	848,870.87
资产总计	41,491,548.57	-	-	-	-	199,811,390.48	241,302,939.05
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	19,738.73	19,738.73
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	166,270.57	166,270.57
应付托管费	-	-	-	-	-	41,567.61	41,567.61
应付销售服务费	-	-	-	-	-	17,065.90	17,065.90
其他负债	-	-	-	-	-	171,781.39	171,781.39
负债总计	-	-	-	-	-	416,424.20	416,424.20
利率敏感度缺口	41,491,548.57	-	-	-	-	199,394,966.28	240,886,514.85

7.4.13.4.1.2 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。	
	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 12 月 31 日
分析	市场利率上升 25 个基点	-
	市场利率下降 25 个基点	-

注：于 12 月 31 日，本基金未持有对利率敏感的金融资产与金融负债。因此，市场利率的变动对本基金资产的净值无重大影响。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金为指数增强型股票基金，采取定量方法进行组合管理。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	198,962,519.61	82.60
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	198,962,519.61	82.60

7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日
	沪深 300 指数上涨 5%	9,365,123.17
	沪深 300 指数下跌 5%	-9,365,123.17

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日
第一层次	198,323,297.01
第二层次	-
第三层次	639,222.60
合计	198,962,519.61

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 26 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票交易	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	1,948,708.66	1,948,708.66
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	1,679,201.77	1,679,201.77
当期利得或损失总额	-	369,715.71	369,715.71
其中：计入损益的利得或损失	-	369,715.71	369,715.71
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	639,222.60	639,222.60
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-42,964.11	-42,964.11

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票	639,222.60	平均价格	预期波动率	0.2063-	负相关

投资		亚式期权模型		2.4756	
----	--	--------	--	--------	--

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

其他金融工具主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2022 年 12 月 31 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	198,962,519.61	82.45
	其中：股票	198,962,519.61	82.45
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	38,287,320.57	15.87
8	其他各项资产	4,053,098.87	1.68
9	合计	241,302,939.05	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	2,686,777.00	1.12
B	采矿业	1,784,892.00	0.74
C	制造业	136,432,097.74	56.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应	5,505,023.00	2.29

	业		
E	建筑业	2,975,310.00	1.24
F	批发和零售业	5,810,311.00	2.41
G	交通运输、仓储和邮政业	1,556,829.84	0.65
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,523,671.20	6.03
J	金融业	2,482,841.00	1.03
K	房地产业	2,891,196.00	1.20
L	租赁和商务服务业	1,851,234.00	0.77
M	科学研究和技术服务业	2,606,506.79	1.08
N	水利、环境和公共设施管理业	805,730.60	0.33
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	283,420.00	0.12
S	综合	-	-
	合计	182,195,840.17	75.64

8.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	993,326.00	0.41
B	采矿业	97,493.00	0.04
C	制造业	13,707,198.81	5.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	280,938.00	0.12
E	建筑业	41,280.00	0.02
F	批发和零售业	101,122.00	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	20,454.00	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	392,551.50	0.16
J	金融业	-	-
K	房地产业	979,984.00	0.41
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	53,936.53	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	32,945.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	20,535.60	0.01
R	文化、体育和娱乐业	44,915.00	0.02
S	综合	-	-
	合计	16,766,679.44	6.96

8.3 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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	002695	煌上煌	353,200	4,902,416.00	2.04
2	300327	中颖电子	127,800	4,520,286.00	1.88
3	688019	安集科技	23,659	4,258,620.00	1.77
4	688037	芯源微	21,000	3,286,500.00	1.36
5	688518	联赢激光	107,869	3,150,853.49	1.31
6	002833	弘亚数控	200,020	2,466,246.60	1.02
7	300204	舒泰神	163,200	2,219,520.00	0.92
8	603489	八方股份	19,534	2,089,942.66	0.87
9	300761	立华股份	51,900	1,777,575.00	0.74
10	002649	博彦科技	167,400	1,722,546.00	0.72
11	002085	万丰奥威	278,400	1,656,480.00	0.69
12	002541	鸿路钢构	56,200	1,646,098.00	0.68
13	601882	海天精工	62,200	1,629,640.00	0.68
14	603313	梦百合	141,700	1,502,020.00	0.62
15	600305	恒顺醋业	121,700	1,498,127.00	0.62
16	300602	飞荣达	101,800	1,464,902.00	0.61
17	002782	可立克	85,000	1,463,700.00	0.61
18	300118	东方日升	58,686	1,456,586.52	0.60
19	600057	厦门象屿	141,300	1,451,151.00	0.60
20	300616	尚品宅配	73,100	1,435,684.00	0.60
21	002815	崇达技术	143,800	1,425,058.00	0.59
22	688789	宏华数科	7,933	1,369,473.79	0.57
23	603025	大豪科技	66,000	1,254,000.00	0.52
24	600389	江山股份	26,700	1,176,936.00	0.49
25	300083	创世纪	138,700	1,174,789.00	0.49
26	000011	深物业 A	101,000	1,170,590.00	0.49
27	600710	苏美达	197,400	1,160,712.00	0.48
28	600295	鄂尔多斯	75,460	1,146,237.40	0.48
29	603229	奥翔药业	47,600	1,132,880.00	0.47
30	600602	云赛智联	128,600	1,120,106.00	0.46
31	600184	光电股份	98,100	1,098,720.00	0.46
32	300222	科大智能	169,500	1,076,325.00	0.45
33	300590	移为通信	109,600	1,075,176.00	0.45
34	688508	芯朋微	16,132	1,045,514.92	0.43
35	000517	荣安地产	354,400	1,045,480.00	0.43
36	600105	永鼎股份	302,500	1,031,525.00	0.43
37	603728	鸣志电器	29,700	989,901.00	0.41
38	300205	天喻信息	88,500	973,500.00	0.40
39	002929	润建股份	24,500	961,870.00	0.40

40	603187	海容冷链	30,123	955,501.56	0.40
41	002832	比音勒芬	35,800	916,838.00	0.38
42	000735	罗牛山	128,600	909,202.00	0.38
43	603533	掌阅科技	62,100	899,829.00	0.37
44	603595	东尼电子	14,900	895,937.00	0.37
45	688318	财富趋势	9,983	889,984.45	0.37
46	002484	江海股份	39,600	885,852.00	0.37
47	601567	三星医疗	65,700	885,636.00	0.37
48	300035	中科电气	43,000	884,940.00	0.37
49	002194	武汉凡谷	95,900	883,239.00	0.37
50	600483	福能股份	83,400	882,372.00	0.37
51	002556	辉隆股份	100,800	882,000.00	0.37
52	688586	江航装备	54,100	881,830.00	0.37
53	002351	漫步者	99,300	881,784.00	0.37
54	600876	凯盛新能	44,000	881,760.00	0.37
55	300768	迪普科技	66,978	881,430.48	0.37
56	603118	共进股份	110,700	880,065.00	0.37
57	000958	电投产融	197,300	879,958.00	0.37
58	600277	亿利洁能	210,100	878,218.00	0.36
59	300284	苏交科	156,800	878,080.00	0.36
60	002218	拓日新能	181,700	877,611.00	0.36
61	300725	药石科技	10,900	877,450.00	0.36
62	002941	新疆交建	71,400	876,792.00	0.36
63	002174	游族网络	94,600	875,996.00	0.36
64	002139	拓邦股份	84,400	875,228.00	0.36
65	000901	航天科技	107,200	874,752.00	0.36
66	600835	上海机电	77,900	874,038.00	0.36
67	688278	特宝生物	22,447	873,861.71	0.36
68	002151	北斗星通	31,100	873,288.00	0.36
69	002534	西子洁能	60,300	873,144.00	0.36
70	000801	四川九洲	133,900	873,028.00	0.36
71	600903	贵州燃气	112,500	871,875.00	0.36
72	002517	恺英网络	132,700	870,512.00	0.36
73	000881	中广核技	112,510	869,702.30	0.36
74	300856	科思股份	16,650	868,297.50	0.36
75	300114	中航电测	84,400	865,944.00	0.36
76	603416	信捷电气	19,100	865,612.00	0.36
77	002516	旷达科技	176,500	864,850.00	0.36
78	300298	三诺生物	25,500	860,115.00	0.36
79	300394	天孚通信	33,800	856,830.00	0.36
80	002011	盾安环境	65,000	853,450.00	0.35
81	300224	正海磁材	68,000	852,040.00	0.35
82	603279	景津装备	28,900	851,972.00	0.35

83	000034	神州数码	38,500	844,690.00	0.35
84	300432	富临精工	58,450	843,433.50	0.35
85	000652	泰达股份	209,000	842,270.00	0.35
86	002318	久立特材	50,600	841,984.00	0.35
87	002839	张家港行	182,500	841,325.00	0.35
88	000875	吉电股份	137,000	834,330.00	0.35
89	002100	天康生物	100,400	834,324.00	0.35
90	000795	英洛华	127,700	828,773.00	0.34
91	002906	华阳集团	24,900	827,178.00	0.34
92	600098	广州发展	148,700	825,285.00	0.34
93	002597	金禾实业	25,350	823,875.00	0.34
94	002258	利尔化学	45,443	816,156.28	0.34
95	688559	海目星	14,100	815,544.00	0.34
96	603636	南威软件	59,300	814,782.00	0.34
97	300401	花园生物	56,600	814,474.00	0.34
98	300130	新国都	67,400	813,518.00	0.34
99	300470	中密控股	20,900	813,219.00	0.34
100	002463	沪电股份	68,300	812,770.00	0.34
101	002158	汉钟精机	33,900	811,905.00	0.34
102	600284	浦东建设	120,400	811,496.00	0.34
103	000811	冰轮环境	73,100	811,410.00	0.34
104	300149	睿智医药	77,700	808,857.00	0.34
105	600285	羚锐制药	62,000	808,480.00	0.34
106	600578	京能电力	248,000	806,000.00	0.33
107	003040	楚天龙	46,200	805,728.00	0.33
108	300232	洲明科技	146,700	805,383.00	0.33
109	300170	汉得信息	98,800	804,232.00	0.33
110	603393	新天然气	36,900	803,313.00	0.33
111	600850	电科数字	40,000	803,200.00	0.33
112	300910	瑞丰新材	6,500	801,515.00	0.33
113	301035	润丰股份	9,200	801,320.00	0.33
114	001696	宗申动力	134,400	798,336.00	0.33
115	300502	新易盛	33,600	798,000.00	0.33
116	002287	奇正藏药	34,900	797,465.00	0.33
117	688016	心脉医疗	4,214	796,614.56	0.33
118	603387	基蛋生物	63,600	795,000.00	0.33
119	300134	大富科技	102,400	794,624.00	0.33
120	600575	淮河能源	329,000	792,890.00	0.33
121	688106	金宏气体	42,200	791,672.00	0.33
122	000950	重药控股	155,000	787,400.00	0.33
123	600742	一汽富维	94,176	787,311.36	0.33
124	603298	杭叉集团	46,700	785,027.00	0.33
125	300080	易成新能	168,100	783,346.00	0.33

126	300343	联创股份	80,100	780,975.00	0.32
127	600481	双良节能	60,100	777,694.00	0.32
128	002006	精工科技	31,100	777,500.00	0.32
129	300634	彩讯股份	50,800	774,700.00	0.32
130	603690	至纯科技	20,404	772,087.36	0.32
131	000913	钱江摩托	41,600	768,768.00	0.32
132	603179	新泉股份	19,900	765,951.00	0.32
133	603129	春风动力	6,700	753,884.00	0.31
134	603612	索通发展	28,952	753,331.04	0.31
135	600777	新潮能源	343,500	748,830.00	0.31
136	603305	旭升集团	23,220	748,612.80	0.31
137	002176	江特电机	42,600	743,370.00	0.31
138	600422	昆药集团	52,600	742,712.00	0.31
139	603906	龙蟠科技	31,900	738,485.00	0.31
140	300428	立中集团	29,800	737,550.00	0.31
141	603959	百利科技	68,800	727,216.00	0.30
142	002432	九安医疗	14,000	715,540.00	0.30
143	002324	普利特	30,300	484,800.00	0.20
144	600308	华泰股份	95,100	482,157.00	0.20
145	600449	宁夏建材	40,300	478,361.00	0.20
146	002042	华孚时尚	156,500	477,325.00	0.20
147	688556	高测股份	5,800	435,116.00	0.18
148	603920	世运电路	25,600	368,128.00	0.15
149	300177	中海达	57,688	353,627.44	0.15
150	002302	西部建设	45,500	329,875.00	0.14
151	600729	重庆百货	12,100	286,165.00	0.12
152	300981	中红医疗	15,200	285,456.00	0.12
153	601921	浙版传媒	38,300	283,420.00	0.12
154	600548	深高速	31,500	282,870.00	0.12
155	002677	浙江美大	25,500	282,540.00	0.12
156	600997	开滦股份	41,500	281,370.00	0.12
157	601963	重庆银行	41,500	281,370.00	0.12
158	002233	塔牌集团	39,600	281,160.00	0.12
159	000789	万年青	32,900	280,966.00	0.12
160	000672	上峰水泥	26,300	280,884.00	0.12
161	600370	三房巷	92,700	280,881.00	0.12
162	600639	浦东金桥	25,300	280,830.00	0.12
163	600502	安徽建工	58,500	280,800.00	0.12
164	000030	富奥股份	63,800	280,720.00	0.12
165	002807	江阴银行	70,700	280,679.00	0.12
166	688399	硕世生物	3,200	280,672.00	0.12
167	002293	罗莱生活	25,000	280,500.00	0.12
168	600810	神马股份	36,100	280,497.00	0.12

169	600273	嘉化能源	33,500	280,395.00	0.12
170	600750	江中药业	19,400	280,330.00	0.12
171	603132	金徽股份	23,400	280,098.00	0.12
172	002440	闰土股份	38,600	279,850.00	0.12
173	002267	陕天然气	38,800	279,748.00	0.12
174	600395	盘江股份	41,600	279,552.00	0.12
175	600210	紫江企业	55,900	279,500.00	0.12
176	603013	亚普股份	19,500	279,435.00	0.12
177	603565	中谷物流	19,196	279,109.84	0.12
178	000761	本钢板材	94,600	279,070.00	0.12
179	601515	东风股份	64,900	279,070.00	0.12
180	600569	安阳钢铁	134,800	279,036.00	0.12
181	000090	天健集团	51,100	279,006.00	0.12
182	600746	江苏索普	34,300	278,516.00	0.12
183	600123	兰花科创	20,800	277,472.00	0.12
184	301047	义翘神州	2,780	277,054.80	0.12
185	000989	九芝堂	31,400	276,634.00	0.11
186	688298	东方生物	3,539	272,892.29	0.11
187	002043	兔宝宝	24,900	270,414.00	0.11
188	300158	振东制药	36,000	268,200.00	0.11
189	600929	雪天盐业	29,900	239,499.00	0.10
190	688085	三友医疗	7,600	210,900.00	0.09
191	603105	芯能科技	14,200	209,166.00	0.09
192	002214	大立科技	15,920	208,870.40	0.09
193	002425	凯撒文化	43,641	207,294.75	0.09
194	605136	丽人丽妆	14,800	206,904.00	0.09
195	603258	电魂网络	9,400	205,578.00	0.09
196	300266	兴源环境	64,200	205,440.00	0.09
197	002344	海宁皮城	43,700	204,953.00	0.09
198	000006	深振业 A	32,300	203,490.00	0.08
199	300031	宝通科技	14,708	203,411.64	0.08
200	300657	弘信电子	18,500	203,315.00	0.08
201	300287	飞利信	58,400	202,648.00	0.08
202	002605	姚记科技	14,400	202,320.00	0.08
203	300791	仙乐健康	5,500	202,235.00	0.08
204	000601	韶能股份	43,000	202,100.00	0.08
205	002251	步步高	28,100	202,039.00	0.08
206	000507	珠海港	36,000	201,960.00	0.08
207	300423	昇辉科技	21,600	201,528.00	0.08
208	300846	首都在线	20,700	201,411.00	0.08
209	002232	启明信息	16,000	201,120.00	0.08
210	300215	电科院	36,500	201,115.00	0.08
211	300740	水羊股份	13,300	201,096.00	0.08

212	300355	蒙草生态	65,700	201,042.00	0.08
213	300867	圣元环保	11,800	200,954.00	0.08
214	000903	云内动力	78,600	200,430.00	0.08
215	300842	帝科股份	3,900	200,421.00	0.08
216	300219	鸿利智汇	30,000	200,400.00	0.08
217	300709	精研科技	7,100	200,149.00	0.08
218	300271	华宇软件	29,300	200,119.00	0.08
219	603018	华设集团	26,400	200,112.00	0.08
220	600103	青山纸业	88,800	199,800.00	0.08
221	000851	高鸿股份	41,500	199,615.00	0.08
222	002803	吉宏股份	12,600	199,584.00	0.08
223	300184	力源信息	46,400	199,520.00	0.08
224	603093	南华期货	21,900	199,509.00	0.08
225	002367	康力电梯	26,600	199,500.00	0.08
226	000910	大亚圣象	23,400	199,368.00	0.08
227	002222	福晶科技	12,600	199,332.00	0.08
228	600590	泰豪科技	34,300	199,283.00	0.08
229	002055	得润电子	23,100	199,122.00	0.08
230	300131	英唐智控	41,200	198,996.00	0.08
231	002611	东方精工	49,000	198,940.00	0.08
232	300191	潜能恒信	11,600	198,940.00	0.08
233	002106	莱宝高科	25,900	198,912.00	0.08
234	300477	合纵科技	39,300	198,858.00	0.08
235	000823	超声电子	21,400	198,806.00	0.08
236	300303	聚飞光电	50,700	198,744.00	0.08
237	002662	京威股份	60,400	198,716.00	0.08
238	300829	金丹科技	9,100	198,471.00	0.08
239	300091	金通灵	55,900	198,445.00	0.08
240	300276	三丰智能	59,400	198,396.00	0.08
241	300815	玉禾田	13,020	198,294.60	0.08
242	300900	广联航空	6,900	198,237.00	0.08
243	300397	天和防务	21,400	198,164.00	0.08
244	002215	诺普信	37,600	198,152.00	0.08
245	603610	麒盛科技	16,429	197,969.45	0.08
246	000710	贝瑞基因	17,300	197,393.00	0.08
247	688277	天智航	16,588	197,231.32	0.08
248	300123	亚光科技	33,300	196,803.00	0.08
249	603960	克来机电	11,100	196,803.00	0.08
250	300328	宜安科技	32,900	196,742.00	0.08
251	300326	凯利泰	27,300	196,560.00	0.08
252	603068	博通集成	6,900	196,374.00	0.08
253	003006	百亚股份	14,200	196,102.00	0.08
254	300007	汉威科技	11,600	196,040.00	0.08

255	300127	银河磁体	12,900	195,951.00	0.08
256	002449	国星光电	23,574	195,899.94	0.08
257	688788	科思科技	5,426	195,824.34	0.08
258	002733	雄韬股份	11,398	195,475.70	0.08
259	000058	深赛格	24,700	195,130.00	0.08
260	300659	中孚信息	7,300	194,691.00	0.08
261	002975	博杰股份	6,138	194,390.46	0.08
262	600114	东睦股份	22,692	192,882.00	0.08
263	000615	奥园美谷	23,100	190,806.00	0.08
264	002614	奥佳华	19,100	178,203.00	0.07
265	688516	奥特维	385	77,385.00	0.03
266	688200	华峰测控	248	68,564.56	0.03
267	688050	爱博医疗	200	46,140.00	0.02
268	688133	泰坦科技	317	43,894.99	0.02
269	688023	安恒信息	122	24,156.00	0.01
270	688598	金博股份	100	21,948.00	0.01
271	688696	极米科技	100	16,620.00	0.01
272	688639	华恒生物	100	15,525.00	0.01
273	688333	铂力特	100	14,275.00	0.01
274	688686	奥普特	100	13,200.00	0.01
275	688408	中信博	112	11,020.80	0.00
276	688568	中科星图	174	10,794.96	0.00
277	688198	佰仁医疗	73	9,417.00	0.00
278	688778	厦钨新能	100	7,768.00	0.00
279	688276	百克生物	100	6,911.00	0.00
280	688139	海尔生物	100	6,330.00	0.00
281	688520	神州细胞	100	6,060.00	0.00
282	688161	威高骨科	100	5,219.00	0.00
283	688699	明微电子	100	4,589.00	0.00
284	688707	振华新材	100	4,495.00	0.00
285	300596	利安隆	72	3,929.04	0.00
286	688127	蓝特光学	213	3,393.09	0.00
287	688739	成大生物	100	3,042.00	0.00
288	688575	亚辉龙	94	1,847.10	0.00
289	688389	普门科技	100	1,783.00	0.00
290	688128	中国电研	100	1,708.00	0.00
291	688158	优刻得	100	1,251.00	0.00
292	688660	电气风电	138	829.38	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量	公允价值	占基金资产净值比例
----	------	------	----	------	-----------

			(股)		(%)
1	600965	福成股份	240,600	1,994,574.00	0.83
2	000837	秦川机床	110,400	1,060,944.00	0.44
3	002709	天赐材料	23,714	1,040,096.04	0.43
4	688305	科德数控	8,851	783,313.50	0.33
5	603477	巨星农牧	30,600	746,334.00	0.31
6	300014	亿纬锂能	8,400	738,360.00	0.31
7	000863	三湘印象	118,400	504,384.00	0.21
8	601155	新城控股	23,200	475,600.00	0.20
9	002812	恩捷股份	3,600	472,644.00	0.20
10	300647	超频三	56,700	457,569.00	0.19
11	300595	欧普康视	11,200	399,840.00	0.17
12	300769	德方纳米	1,600	367,344.00	0.15
13	603527	众源新材	22,900	322,432.00	0.13
14	601865	福莱特	8,900	296,459.00	0.12
15	600879	航天电子	42,900	291,720.00	0.12
16	002922	伊戈尔	19,000	289,370.00	0.12
17	603667	五洲新春	21,500	286,165.00	0.12
18	688063	派能科技	900	284,085.00	0.12
19	688390	固德威	800	258,472.00	0.11
20	300763	锦浪科技	1,400	252,070.00	0.10
21	600032	浙江新能	21,600	248,184.00	0.10
22	001201	东瑞股份	8,600	246,992.00	0.10
23	002407	多氟多	7,300	243,236.00	0.10
24	002265	西仪股份	17,600	239,360.00	0.10
25	300210	森远股份	81,600	238,272.00	0.10
26	601500	通用股份	63,880	236,356.00	0.10
27	300421	力星股份	20,400	235,416.00	0.10
28	688005	容百科技	3,400	233,750.00	0.10
29	002765	蓝黛科技	26,000	233,740.00	0.10
30	603799	华友钴业	4,200	233,646.00	0.10
31	603659	璞泰来	4,500	233,505.00	0.10
32	600728	佳都科技	43,700	230,736.00	0.10
33	600298	安琪酵母	4,400	198,968.00	0.08
34	300581	晨曦航空	10,100	176,952.00	0.07
35	002360	同德化工	15,500	108,965.00	0.05
36	688351	微电生理	4,378	108,399.28	0.05
37	688403	汇成股份	9,895	100,137.40	0.04
38	300802	矩子科技	5,200	95,576.00	0.04
39	688301	奕瑞科技	200	91,576.00	0.04
40	300926	博俊科技	3,421	71,259.43	0.03
41	300464	星徽股份	11,600	70,064.00	0.03
42	603600	永艺股份	7,100	69,225.00	0.03

43	688203	海正生材	4,389	66,230.01	0.03
44	300157	恒泰艾普	18,700	59,840.00	0.02
45	688459	哈铁科技	6,883	56,922.41	0.02
46	688239	航宇科技	700	54,383.00	0.02
47	300129	泰胜风能	7,400	53,058.00	0.02
48	603725	天安新材	7,500	51,825.00	0.02
49	688455	科捷智能	3,815	50,052.80	0.02
50	300426	唐德影视	6,500	44,915.00	0.02
51	600792	云煤能源	12,900	44,763.00	0.02
52	600626	申达股份	12,200	43,920.00	0.02
53	603717	天域生态	6,000	41,280.00	0.02
54	603619	中曼石油	2,100	37,653.00	0.02
55	002667	鞍重股份	1,400	33,012.00	0.01
56	688156	路德环境	1,100	32,945.00	0.01
57	000531	穗恒运 A	5,300	32,754.00	0.01
58	002536	飞龙股份	4,300	32,207.00	0.01
59	000701	厦门信达	5,300	31,058.00	0.01
60	688188	柏楚电子	140	30,391.20	0.01
61	002886	沃特股份	1,800	29,844.00	0.01
62	601608	中信重工	8,400	29,316.00	0.01
63	688536	思瑞浦	100	27,541.00	0.01
64	301327	华宝新能	146	26,525.70	0.01
65	300275	梅安森	2,200	25,982.00	0.01
66	002109	兴化股份	4,500	22,770.00	0.01
67	002559	亚威股份	3,000	21,690.00	0.01
68	301239	普瑞眼科	294	20,535.60	0.01
69	601008	连云港	4,200	20,454.00	0.01
70	002672	东江环保	3,400	19,210.00	0.01
71	688012	中微公司	186	18,229.86	0.01
72	000050	深天马 A	2,100	18,186.00	0.01
73	603687	大胜达	2,100	17,997.00	0.01
74	301095	广立微	202	17,498.92	0.01
75	603398	沐邦高科	600	16,896.00	0.01
76	603458	勘设股份	1,500	14,160.00	0.01
77	301308	江波龙	239	13,612.58	0.01
78	301152	天力锂能	274	12,913.52	0.01
79	000505	京粮控股	1,500	12,150.00	0.01
80	301367	怡和嘉业	68	11,953.04	0.00
81	301121	紫建电子	237	11,907.63	0.00
82	301338	凯格精机	240	11,867.92	0.00
83	688357	建龙微纳	100	11,090.00	0.00
84	301230	泓博医药	226	11,088.62	0.00
85	688621	阳光诺和	100	10,240.00	0.00

86	301363	美好医疗	262	10,140.00	0.00
87	301306	西测测试	234	9,958.86	0.00
88	688003	天准科技	300	9,480.00	0.00
89	301330	熵基科技	300	9,402.20	0.00
90	688068	热景生物	148	9,013.20	0.00
91	301132	满坤科技	358	8,822.12	0.00
92	301270	汉仪股份	295	8,524.70	0.00
93	301197	工大科雅	422	8,514.35	0.00
94	301115	建科股份	350	8,489.05	0.00
95	301313	凡拓数创	274	8,182.04	0.00
96	301233	盛帮股份	236	8,112.02	0.00
97	301227	森鹰窗业	266	7,880.88	0.00
98	301273	瑞晨环保	207	7,822.53	0.00
99	301161	唯万密封	346	7,518.58	0.00
100	301223	中荣股份	411	7,497.66	0.00
101	301139	元道通信	286	7,244.58	0.00
102	301176	逸豪新材	417	7,100.13	0.00
103	688201	信安世纪	122	6,927.16	0.00
104	301171	易点天下	377	6,699.25	0.00
105	688353	华盛锂电	100	6,472.00	0.00
106	301339	通行宝	413	6,438.67	0.00
107	301326	捷邦科技	175	6,422.57	0.00
108	301285	鸿日达	486	6,133.12	0.00
109	301282	金禄电子	227	5,731.75	0.00
110	301316	慧博云通	384	5,620.63	0.00
111	688020	方邦股份	100	5,277.00	0.00
112	301319	唯特偶	90	4,794.30	0.00
113	688097	博众精工	162	4,633.20	0.00
114	301318	维海德	108	4,513.24	0.00
115	688122	西部超导	47	4,450.43	0.00
116	688358	祥生医疗	100	3,440.00	0.00
117	688596	正帆科技	100	3,395.00	0.00
118	301309	万得凯	132	3,233.20	0.00
119	688567	孚能科技	100	2,703.00	0.00
120	688121	卓然股份	100	2,444.00	0.00
121	688186	广大特材	100	2,432.00	0.00
122	688088	虹软科技	100	2,251.00	0.00
123	688519	南亚新材	100	2,107.00	0.00
124	688698	伟创电气	98	2,029.58	0.00
125	688135	利扬芯片	65	1,770.60	0.00
126	688221	前沿生物	100	1,726.00	0.00
127	688081	兴图新科	100	1,656.00	0.00
128	003038	鑫铂股份	20	881.60	0.00

129	688585	上纬新材	100	801.00	0.00
130	688165	埃夫特	100	770.00	0.00
131	688086	*ST 紫晶	109	263.78	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	300568	星源材质	46,765,929.67	19.41
2	688388	嘉元科技	42,279,946.14	17.55
3	002182	云海金属	36,509,195.45	15.16
4	600929	雪天盐业	33,952,566.42	14.09
5	000155	川能动力	33,525,640.82	13.92
6	002245	蔚蓝锂芯	33,358,642.14	13.85
7	600596	新安股份	33,093,614.92	13.74
8	002539	云图控股	31,433,526.00	13.05
9	688598	金博股份	29,316,930.01	12.17
10	603313	梦百合	28,552,864.53	11.85
11	603906	龙蟠科技	28,437,884.65	11.81
12	603187	海容冷链	28,182,049.80	11.70
13	002597	金禾实业	27,983,676.06	11.62
14	600481	双良节能	27,737,096.00	11.51
15	300616	尚品宅配	26,281,031.25	10.91
16	002240	盛新锂能	25,869,796.00	10.74
17	603489	八方股份	25,252,603.78	10.48
18	300674	宇信科技	23,847,021.08	9.90
19	688037	芯源微	23,348,623.19	9.69
20	600328	中盐化工	23,007,391.00	9.55
21	603337	杰克股份	22,588,023.12	9.38
22	300083	创世纪	22,420,597.00	9.31
23	603713	密尔克卫	22,381,957.00	9.29
24	300171	东富龙	22,304,948.10	9.26
25	603169	兰石重装	22,281,965.64	9.25
26	600499	科达制造	22,043,439.72	9.15
27	002407	多氟多	21,773,901.85	9.04
28	002706	良信股份	21,739,186.20	9.02
29	002717	岭南股份	21,702,400.24	9.01
30	002738	中矿资源	21,154,406.20	8.78
31	002756	永兴材料	21,136,515.18	8.77
32	688508	芯朋微	21,057,908.07	8.74
33	600416	湘电股份	20,447,015.00	8.49
34	605111	新洁能	20,309,501.21	8.43

35	002176	江特电机	20,188,004.95	8.38
36	300118	东方日升	20,022,372.73	8.31
37	600873	梅花生物	19,956,385.00	8.28
38	300639	凯普生物	19,841,012.92	8.24
39	688033	天宜上佳	19,803,078.98	8.22
40	600305	恒顺醋业	19,753,842.00	8.20
41	300432	富临精工	19,738,560.43	8.19
42	002291	遥望科技	19,726,042.00	8.19
43	002895	川恒股份	19,607,250.53	8.14
44	300596	利安隆	19,269,015.79	8.00
45	600057	厦门象屿	19,233,763.26	7.98
46	000567	海德股份	18,923,402.74	7.86
47	603920	世运电路	18,804,444.00	7.81
48	600420	国药现代	18,757,226.86	7.79
49	002436	兴森科技	18,725,327.20	7.77
50	600711	盛屯矿业	18,627,404.53	7.73
51	300073	当升科技	18,581,650.12	7.71
52	003032	传智教育	18,431,923.31	7.65
53	002042	华孚时尚	18,298,399.88	7.60
54	002741	光华科技	18,238,860.10	7.57
55	603212	赛伍技术	18,140,424.83	7.53
56	000933	神火股份	18,111,366.74	7.52
57	000762	西藏矿业	18,054,302.00	7.49
58	600366	宁波韵升	17,793,298.00	7.39
59	603876	鼎胜新材	17,659,722.00	7.33
60	600888	新疆众和	17,533,240.00	7.28
61	300177	中海达	17,530,654.55	7.28
62	300803	指南针	17,390,324.84	7.22
63	300769	德方纳米	17,168,288.40	7.13
64	600330	天通股份	17,144,502.20	7.12
65	002833	弘亚数控	17,040,552.14	7.07
66	000683	远兴能源	16,413,733.04	6.81
67	601666	平煤股份	16,399,163.40	6.81
68	300548	博创科技	16,056,308.34	6.67
69	300590	移为通信	15,994,566.44	6.64
70	600395	盘江股份	15,980,690.00	6.63
71	002733	雄韬股份	15,962,324.20	6.63
72	002055	得润电子	15,858,348.00	6.58
73	603529	爱玛科技	15,849,221.60	6.58
74	688023	安恒信息	15,841,005.81	6.58
75	300604	长川科技	15,536,880.90	6.45
76	002573	清新环境	15,410,083.31	6.40
77	002446	盛路通信	15,163,776.50	6.29

78	300327	中颖电子	15,159,620.70	6.29
79	000810	创维数字	15,041,970.18	6.24
80	688019	安集科技	14,994,174.79	6.22
81	300222	科大智能	14,988,068.58	6.22
82	300726	宏达电子	14,962,432.10	6.21
83	688133	泰坦科技	14,951,906.83	6.21
84	002214	大立科技	14,949,556.80	6.21
85	600098	广州发展	14,921,234.00	6.19
86	300035	中科电气	14,752,936.62	6.12
87	605123	派克新材	14,724,647.75	6.11
88	002850	科达利	14,628,030.00	6.07
89	300054	鼎龙股份	14,585,566.00	6.05
90	002218	拓日新能	14,404,064.00	5.98
91	600063	皖维高新	14,258,242.64	5.92
92	300130	新国都	14,146,722.00	5.87
93	603025	大豪科技	14,141,036.91	5.87
94	002258	利尔化学	14,042,422.11	5.83
95	000966	长源电力	14,040,902.00	5.83
96	300573	兴齐眼药	13,927,313.58	5.78
97	300409	道氏技术	13,882,686.89	5.76
98	300366	创意信息	13,797,673.62	5.73
99	002928	华夏航空	13,707,204.25	5.69
100	600295	鄂尔多斯	13,644,573.10	5.66
101	002487	大金重工	13,634,319.22	5.66
102	605008	长鸿高科	13,454,592.48	5.59
103	300846	首都在线	13,432,983.00	5.58
104	300390	天华超净	13,388,811.00	5.56
105	002135	东南网架	13,369,310.72	5.55
106	600552	凯盛科技	13,265,217.36	5.51
107	603595	东尼电子	13,235,565.00	5.49
108	603565	中谷物流	13,169,240.23	5.47
109	603612	索通发展	13,097,111.81	5.44
110	601515	东风股份	13,079,201.44	5.43
111	688122	西部超导	12,937,659.34	5.37
112	300861	美畅股份	12,812,399.60	5.32
113	600123	兰花科创	12,711,683.97	5.28
114	300119	瑞普生物	12,618,077.00	5.24
115	601702	华峰铝业	12,399,626.00	5.15
116	603566	普莱柯	12,396,476.93	5.15
117	300224	正海磁材	12,166,169.85	5.05
118	002389	航天彩虹	12,153,602.00	5.05
119	002960	青鸟消防	12,062,503.42	5.01
120	300552	万集科技	11,972,868.00	4.97

121	688516	奥特维	11,913,347.34	4.95
122	688050	爱博医疗	11,872,442.55	4.93
123	002100	天康生物	11,847,036.75	4.92
124	300476	胜宏科技	11,751,784.00	4.88
125	603328	依顿电子	11,723,486.00	4.87
126	002254	泰和新材	11,692,442.61	4.85
127	002993	奥海科技	11,661,864.80	4.84
128	300768	迪普科技	11,636,862.40	4.83
129	300102	乾照光电	11,586,296.00	4.81
130	300666	江丰电子	11,567,413.53	4.80
131	000758	中色股份	11,390,077.00	4.73
132	603129	春风动力	11,333,730.68	4.71
133	688202	美迪西	11,323,222.72	4.70
134	300132	青松股份	11,303,947.00	4.69
135	300373	扬杰科技	11,270,566.00	4.68
136	002550	千红制药	11,173,531.00	4.64
137	600032	浙江新能	11,122,881.95	4.62
138	002041	登海种业	10,978,915.00	4.56
139	002267	陕天然气	10,898,204.00	4.52
140	600742	一汽富维	10,875,383.00	4.51
141	300602	飞荣达	10,818,416.77	4.49
142	688368	晶丰明源	10,811,081.98	4.49
143	002847	盐津铺子	10,755,168.79	4.46
144	688018	乐鑫科技	10,672,184.86	4.43
145	300055	万邦达	10,558,810.90	4.38
146	002025	航天电器	10,502,673.00	4.36
147	688106	金宏气体	10,387,142.10	4.31
148	600821	金开新能	10,385,375.00	4.31
149	688016	心脉医疗	10,332,824.39	4.29
150	688158	优刻得	10,251,276.65	4.26
151	000712	锦龙股份	10,238,390.88	4.25
152	000893	亚钾国际	10,093,934.00	4.19
153	605117	德业股份	10,082,788.00	4.19
154	002425	凯撒文化	10,080,291.98	4.18
155	002292	奥飞娱乐	10,005,864.00	4.15
156	000913	钱江摩托	9,847,327.90	4.09
157	300428	立中集团	9,835,821.00	4.08
158	603229	奥翔药业	9,782,674.60	4.06
159	300748	金力永磁	9,781,801.68	4.06
160	002837	英维克	9,745,346.80	4.05
161	000032	深桑达 A	9,709,784.40	4.03
162	002639	雪人股份	9,425,038.00	3.91
163	300401	花园生物	9,422,456.00	3.91

164	002859	洁美科技	9,420,274.00	3.91
165	688518	联赢激光	9,342,957.14	3.88
166	002043	兔宝宝	9,324,101.01	3.87
167	600452	涪陵电力	9,277,003.38	3.85
168	000597	东北制药	9,225,237.98	3.83
169	300767	震安科技	9,219,229.40	3.83
170	300671	富满微	9,189,954.81	3.82
171	600876	凯盛新能	9,152,842.30	3.80
172	300397	天和防务	9,126,305.00	3.79
173	600456	宝钛股份	9,117,819.00	3.79
174	300393	中来股份	9,101,461.00	3.78
175	600777	新潮能源	9,098,206.00	3.78
176	600449	宁夏建材	9,059,869.77	3.76
177	002324	普利特	9,037,148.28	3.75
178	002497	雅化集团	8,961,312.29	3.72
179	300775	三角防务	8,959,465.00	3.72
180	688116	天奈科技	8,899,525.71	3.69
181	002402	和而泰	8,884,628.00	3.69
182	603995	甬金股份	8,869,980.75	3.68
183	002192	融捷股份	8,802,038.24	3.65
184	601908	京运通	8,801,497.00	3.65
185	002635	安洁科技	8,797,549.00	3.65
186	300123	亚光科技	8,792,585.86	3.65
187	603896	寿仙谷	8,725,186.83	3.62
188	603688	石英股份	8,658,998.00	3.59
189	002312	川发龙蟒	8,525,909.65	3.54
190	688301	奕瑞科技	8,454,762.26	3.51
191	603301	振德医疗	8,446,183.72	3.51
192	300633	开立医疗	8,431,784.00	3.50
193	000423	东阿阿胶	8,393,407.00	3.48
194	000851	高鸿股份	8,378,829.84	3.48
195	300679	电连技术	8,348,011.03	3.47
196	603588	高能环境	8,244,752.80	3.42
197	002261	拓维信息	8,205,487.66	3.41
198	300755	华致酒行	8,137,165.64	3.38
199	688680	海优新材	8,018,413.68	3.33
200	600477	杭萧钢构	7,982,144.90	3.31
201	300627	华测导航	7,852,240.37	3.26
202	002463	沪电股份	7,850,003.20	3.26
203	300738	奥飞数据	7,777,361.40	3.23
204	300377	赢时胜	7,762,953.52	3.22
205	300323	华灿光电	7,715,429.43	3.20
206	600882	妙可蓝多	7,698,119.61	3.20

207	002215	诺普信	7,622,433.81	3.16
208	688339	亿华通	7,583,422.99	3.15
209	300856	科思股份	7,566,524.50	3.14
210	600116	三峡水利	7,530,362.52	3.13
211	002344	海宁皮城	7,524,777.00	3.12
212	002139	拓邦股份	7,480,371.88	3.11
213	600480	凌云股份	7,468,183.00	3.10
214	002792	通宇通讯	7,449,827.00	3.09
215	600850	电科数字	7,409,010.49	3.08
216	002782	可立克	7,340,763.00	3.05
217	600389	江山股份	7,329,072.00	3.04
218	605589	圣泉集团	7,307,567.00	3.03
219	002541	鸿路钢构	7,255,364.70	3.01
220	002472	双环传动	7,248,097.63	3.01
221	605365	立达信	7,224,636.46	3.00
222	603222	济民医疗	7,209,808.40	2.99
223	002807	江阴银行	7,189,095.20	2.98
224	688166	博瑞医药	7,169,551.69	2.98
225	000885	城发环境	7,145,788.00	2.97
226	688568	中科星图	7,131,473.15	2.96
227	300502	新易盛	7,121,010.58	2.96
228	300655	晶瑞电材	7,114,283.12	2.95
229	300485	赛升药业	7,097,605.00	2.95
230	603236	移远通信	7,025,133.00	2.92
231	300791	仙乐健康	7,006,304.00	2.91
232	000560	我爱我家	6,979,610.00	2.90
233	002567	唐人神	6,951,946.00	2.89
234	300857	协创数据	6,940,049.00	2.88
235	003040	楚天龙	6,896,388.00	2.86
236	688408	中信博	6,896,250.55	2.86
237	002378	章源钨业	6,818,154.00	2.83
238	002421	达实智能	6,769,384.00	2.81
239	688277	天智航	6,675,176.23	2.77
240	600750	江中药业	6,543,430.80	2.72
241	688278	特宝生物	6,541,327.94	2.72
242	300458	全志科技	6,503,204.00	2.70
243	600422	昆药集团	6,502,861.00	2.70
244	300487	蓝晓科技	6,499,649.50	2.70
245	600096	云天化	6,499,567.00	2.70
246	603279	景津装备	6,476,877.10	2.69
247	002108	沧州明珠	6,469,600.42	2.69
248	002017	东信和平	6,451,370.00	2.68
249	600618	氯碱化工	6,406,011.00	2.66

250	601677	明泰铝业	6,391,240.64	2.65
251	600114	东睦股份	6,375,643.00	2.65
252	601137	博威合金	6,366,700.00	2.64
253	603936	博敏电子	6,319,965.00	2.62
254	300188	美亚柏科	6,306,575.00	2.62
255	301071	力量钻石	6,282,940.00	2.61
256	688200	华峰测控	6,275,827.57	2.61
257	300158	振东制药	6,246,150.00	2.59
258	603690	至纯科技	6,180,882.48	2.57
259	002880	卫光生物	6,159,667.92	2.56
260	002906	华阳集团	6,135,327.00	2.55
261	688333	铂力特	6,133,176.98	2.55
262	603027	千禾味业	6,126,467.68	2.54
263	002695	煌上煌	6,076,946.86	2.52
264	300215	电科院	6,067,903.00	2.52
265	300682	朗新科技	6,050,419.50	2.51
266	603348	文灿股份	6,050,309.00	2.51
267	301035	润丰股份	6,037,340.53	2.51
268	002226	江南化工	6,025,717.40	2.50
269	002664	信质集团	6,022,376.00	2.50
270	601528	瑞丰银行	6,011,261.01	2.50
271	600583	海油工程	5,990,889.00	2.49
272	300457	赢合科技	5,980,411.12	2.48
273	300068	南都电源	5,958,609.00	2.47
274	603026	胜华新材	5,946,547.00	2.47
275	002091	江苏国泰	5,943,907.86	2.47
276	300842	帝科股份	5,941,352.00	2.47
277	300456	赛微电子	5,934,237.00	2.46
278	300672	国科微	5,922,179.00	2.46
279	603826	坤彩科技	5,902,663.00	2.45
280	002585	双星新材	5,888,032.00	2.44
281	002518	科士达	5,876,519.00	2.44
282	688520	神州细胞	5,849,103.91	2.43
283	688586	江航装备	5,812,477.84	2.41
284	600662	外服控股	5,811,747.00	2.41
285	603299	苏盐井神	5,802,317.00	2.41
286	000025	特力 A	5,788,052.00	2.40
287	600557	康缘药业	5,754,286.34	2.39
288	603363	傲农生物	5,745,648.80	2.39
289	002838	道恩股份	5,745,606.00	2.39
290	600855	航天长峰	5,736,713.51	2.38
291	000034	神州数码	5,720,698.00	2.37
292	002967	广电计量	5,710,726.00	2.37

293	600172	黄河旋风	5,708,822.00	2.37
294	688399	硕世生物	5,686,733.43	2.36
295	601011	宝泰隆	5,659,958.00	2.35
296	002643	万润股份	5,633,526.00	2.34
297	002145	中核钛白	5,629,641.00	2.34
298	600810	神马股份	5,628,843.00	2.34
299	605376	博迁新材	5,608,909.00	2.33
300	600986	浙文互联	5,604,872.00	2.33
301	605090	九丰能源	5,581,862.46	2.32
302	300204	舒泰神	5,550,490.99	2.30
303	300788	中信出版	5,533,357.00	2.30
304	601882	海天精工	5,498,052.00	2.28
305	603530	神马电力	5,433,053.00	2.26
306	300007	汉威科技	5,431,350.00	2.25
307	000811	冰轮环境	5,428,676.54	2.25
308	601279	英利汽车	5,428,510.00	2.25
309	300346	南大光电	5,427,126.48	2.25
310	605009	豪悦护理	5,395,901.67	2.24
311	605168	三人行	5,380,894.00	2.23
312	300662	科锐国际	5,322,987.00	2.21
313	002832	比音勒芬	5,313,002.81	2.21
314	002262	恩华药业	5,279,703.86	2.19
315	600550	保变电气	5,219,198.00	2.17
316	002545	东方铁塔	5,205,101.76	2.16
317	300229	拓尔思	5,157,403.00	2.14
318	600710	苏美达	5,146,522.00	2.14
319	002609	捷顺科技	5,125,049.12	2.13
320	002484	江海股份	5,123,847.00	2.13
321	600210	紫江企业	5,114,785.00	2.12
322	600284	浦东建设	5,057,108.00	2.10
323	600273	嘉化能源	5,011,718.59	2.08
324	600548	深高速	4,992,648.24	2.07
325	000591	太阳能	4,989,166.49	2.07
326	300368	汇金股份	4,940,900.00	2.05
327	600562	国睿科技	4,929,038.00	2.05
328	300696	爱乐达	4,870,142.23	2.02
329	300777	中简科技	4,861,394.00	2.02
330	603387	基蛋生物	4,857,192.12	2.02
331	002605	姚记科技	4,839,548.49	2.01
332	688020	方邦股份	4,835,932.02	2.01

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	300568	星源材质	49,730,097.61	20.64
2	688388	嘉元科技	40,371,734.18	16.76
3	002182	云海金属	35,115,607.13	14.58
4	600596	新安股份	33,592,064.42	13.95
5	002245	蔚蓝锂芯	33,382,299.67	13.86
6	600929	雪天盐业	33,351,185.75	13.85
7	000155	川能动力	32,575,799.31	13.52
8	002539	云图控股	31,768,423.22	13.19
9	688598	金博股份	30,372,199.61	12.61
10	600481	双良节能	28,353,087.00	11.77
11	603187	海容冷链	27,754,084.45	11.52
12	603906	龙蟠科技	27,439,004.40	11.39
13	603313	梦百合	27,302,434.40	11.33
14	002597	金禾实业	26,820,189.57	11.13
15	002240	盛新锂能	25,061,936.00	10.40
16	600328	中盐化工	23,778,431.12	9.87
17	300616	尚品宅配	23,462,020.65	9.74
18	300674	宇信科技	23,090,557.43	9.59
19	002407	多氟多	22,963,101.00	9.53
20	002706	良信股份	22,842,986.70	9.48
21	603713	密尔克卫	22,146,453.00	9.19
22	600499	科达制造	22,016,170.04	9.14
23	002738	中矿资源	22,015,875.23	9.14
24	603337	杰克股份	21,972,173.89	9.12
25	605111	新洁能	21,880,384.40	9.08
26	603169	兰石重装	21,841,201.72	9.07
27	002717	岭南股份	21,813,668.10	9.06
28	002756	永兴材料	21,790,925.24	9.05
29	603489	八方股份	21,706,904.75	9.01
30	600416	湘电股份	21,607,149.22	8.97
31	300083	创世纪	21,577,880.26	8.96
32	300171	东富龙	21,306,558.00	8.85
33	688037	芯源微	21,178,242.63	8.79
34	300432	富临精工	20,794,021.00	8.63
35	300639	凯普生物	19,927,115.85	8.27
36	002436	兴森科技	19,806,221.18	8.22
37	600873	梅花生物	19,778,115.00	8.21
38	688508	芯朋微	19,726,642.15	8.19
39	002176	江特电机	19,438,258.20	8.07
40	000567	海德股份	19,373,753.33	8.04
41	002291	遥望科技	19,364,089.16	8.04

42	688033	天宜上佳	19,342,612.25	8.03
43	300073	当升科技	19,341,682.66	8.03
44	300596	利安隆	19,293,484.95	8.01
45	003032	传智教育	18,852,142.00	7.83
46	300118	东方日升	18,813,624.02	7.81
47	600420	国药现代	18,713,676.68	7.77
48	600305	恒顺醋业	18,524,928.78	7.69
49	603920	世运电路	18,209,478.41	7.56
50	002741	光华科技	18,164,351.00	7.54
51	603212	赛伍技术	18,029,437.24	7.48
52	000933	神火股份	17,950,650.94	7.45
53	600711	盛屯矿业	17,932,644.25	7.44
54	000762	西藏矿业	17,880,785.39	7.42
55	600057	厦门象屿	17,862,118.99	7.42
56	002895	川恒股份	17,624,131.48	7.32
57	600888	新疆众和	17,498,946.20	7.26
58	300769	德方纳米	17,378,062.80	7.21
59	002042	华孚时尚	17,292,909.36	7.18
60	300177	中海达	17,205,651.00	7.14
61	603876	鼎胜新材	17,160,205.00	7.12
62	600330	天通股份	17,082,464.48	7.09
63	600366	宁波韵升	17,026,398.00	7.07
64	300803	指南针	16,982,809.62	7.05
65	000683	远兴能源	16,680,193.00	6.92
66	002055	得润电子	16,335,845.00	6.78
67	601666	平煤股份	16,000,953.82	6.64
68	600395	盘江股份	15,961,905.00	6.63
69	603529	爱玛科技	15,561,802.73	6.46
70	300548	博创科技	15,527,239.50	6.45
71	002850	科达利	15,488,335.49	6.43
72	002446	盛路通信	15,404,315.89	6.39
73	002733	雄韬股份	15,340,092.50	6.37
74	688023	安恒信息	15,299,440.29	6.35
75	000810	创维数字	15,195,921.25	6.31
76	002573	清新环境	15,127,038.13	6.28
77	300604	长川科技	14,796,817.31	6.14
78	002214	大立科技	14,743,591.72	6.12
79	688133	泰坦科技	14,732,848.44	6.12
80	300054	鼎龙股份	14,584,706.17	6.05
81	300726	宏达电子	14,506,952.19	6.02
82	600063	皖维高新	14,496,042.79	6.02
83	300366	创意信息	14,489,862.54	6.02
84	605123	派克新材	14,402,337.00	5.98

85	600098	广州发展	14,373,165.06	5.97
86	300573	兴齐眼药	14,061,168.00	5.84
87	002292	奥飞娱乐	13,960,009.00	5.80
88	300590	移为通信	13,819,928.64	5.74
89	300035	中科电气	13,726,978.00	5.70
90	002928	华夏航空	13,725,934.42	5.70
91	300222	科大智能	13,591,221.38	5.64
92	000966	长源电力	13,578,653.61	5.64
93	300409	道氏技术	13,557,047.00	5.63
94	300130	新国都	13,399,951.09	5.56
95	605008	长鸿高科	13,321,981.32	5.53
96	002258	利尔化学	13,284,954.61	5.52
97	600552	凯盛科技	13,195,882.73	5.48
98	002833	弘亚数控	13,140,661.87	5.46
99	688122	西部超导	13,088,462.74	5.43
100	300390	天华超净	13,083,858.89	5.43
101	002487	大金重工	13,068,006.75	5.42
102	300861	美畅股份	12,893,847.18	5.35
103	600295	鄂尔多斯	12,868,320.00	5.34
104	603595	东尼电子	12,853,755.00	5.34
105	300666	江丰电子	12,844,669.03	5.33
106	002218	拓日新能	12,810,519.00	5.32
107	603025	大豪科技	12,731,291.62	5.29
108	603566	普莱柯	12,656,544.55	5.25
109	300846	首都在线	12,590,593.00	5.23
110	002135	东南网架	12,590,543.00	5.23
111	603565	中谷物流	12,573,458.26	5.22
112	002100	天康生物	12,549,152.90	5.21
113	002993	奥海科技	12,538,836.51	5.21
114	601515	东风股份	12,505,884.82	5.19
115	300119	瑞普生物	12,505,396.07	5.19
116	002389	航天彩虹	12,195,433.18	5.06
117	002960	青鸟消防	12,165,493.40	5.05
118	600123	兰花科创	12,161,387.00	5.05
119	688050	爱博医疗	11,973,240.32	4.97
120	300552	万集科技	11,953,039.00	4.96
121	300102	乾照光电	11,936,389.70	4.96
122	300476	胜宏科技	11,898,600.28	4.94
123	688516	奥特维	11,851,926.52	4.92
124	603612	索通发展	11,653,757.88	4.84
125	601702	华峰铝业	11,564,207.00	4.80
126	002254	泰和新材	11,483,023.72	4.77
127	603328	依顿电子	11,448,523.00	4.75

128	000758	中色股份	11,443,905.00	4.75
129	688202	美迪西	11,337,418.35	4.71
130	300132	青松股份	11,331,747.00	4.70
131	300224	正海磁材	11,137,241.00	4.62
132	300373	扬杰科技	11,001,787.50	4.57
133	688019	安集科技	10,847,814.04	4.50
134	002847	盐津铺子	10,785,436.45	4.48
135	002041	登海种业	10,771,570.00	4.47
136	688368	晶丰明源	10,758,934.24	4.47
137	002550	千红制药	10,708,442.00	4.45
138	002025	航天电器	10,522,573.00	4.37
139	600032	浙江新能	10,459,683.00	4.34
140	300055	万邦达	10,403,338.01	4.32
141	000712	锦龙股份	10,401,791.00	4.32
142	300768	迪普科技	10,377,733.00	4.31
143	300327	中颖电子	10,343,723.00	4.29
144	688018	乐鑫科技	10,280,106.46	4.27
145	002267	陕天然气	10,205,918.00	4.24
146	605117	德业股份	10,185,648.00	4.23
147	600742	一汽富维	10,166,641.48	4.22
148	603129	春风动力	10,114,345.36	4.20
149	002425	凯撒文化	9,954,752.00	4.13
150	000893	亚钾国际	9,936,989.49	4.13
151	002837	英维克	9,891,083.50	4.11
152	600821	金开新能	9,824,773.00	4.08
153	000032	深桑达 A	9,756,951.48	4.05
154	300748	金力永磁	9,694,236.80	4.02
155	688016	心脉医疗	9,510,804.07	3.95
156	688158	优刻得	9,479,296.99	3.94
157	600452	涪陵电力	9,406,401.34	3.90
158	002639	雪人股份	9,376,796.00	3.89
159	000597	东北制药	9,356,360.62	3.88
160	002859	洁美科技	9,325,789.20	3.87
161	688106	金宏气体	9,302,366.28	3.86
162	300602	飞荣达	9,163,905.50	3.80
163	000913	钱江摩托	9,108,915.00	3.78
164	300393	中来股份	9,108,704.00	3.78
165	300767	震安科技	9,038,687.49	3.75
166	603995	甬金股份	8,963,613.70	3.72
167	600456	宝钛股份	8,912,675.00	3.70
168	002402	和而泰	8,889,667.00	3.69
169	300633	开立医疗	8,867,937.68	3.68
170	002043	兔宝宝	8,857,159.00	3.68

171	002192	融捷股份	8,813,675.27	3.66
172	688116	天奈科技	8,812,242.04	3.66
173	002324	普利特	8,789,768.00	3.65
174	600449	宁夏建材	8,785,399.47	3.65
175	300775	三角防务	8,780,625.00	3.65
176	603688	石英股份	8,773,253.00	3.64
177	300123	亚光科技	8,767,465.00	3.64
178	603896	寿仙谷	8,750,471.08	3.63
179	300671	富满微	8,700,992.55	3.61
180	002497	雅化集团	8,692,493.00	3.61
181	300397	天和防务	8,617,270.50	3.58
182	002635	安洁科技	8,586,926.94	3.56
183	300401	花园生物	8,581,291.17	3.56
184	601908	京运通	8,538,413.00	3.54
185	002312	川发龙蟒	8,480,824.80	3.52
186	300428	立中集团	8,388,129.21	3.48
187	300679	电连技术	8,374,736.00	3.48
188	603301	振德医疗	8,358,462.00	3.47
189	000423	东阿阿胶	8,321,683.72	3.45
190	603588	高能环境	8,310,338.20	3.45
191	000851	高鸿股份	8,166,261.68	3.39
192	603229	奥翔药业	8,153,817.20	3.38
193	688301	奕瑞科技	8,081,051.56	3.35
194	300755	华致酒行	8,055,796.56	3.34
195	600876	凯盛新能	7,973,225.45	3.31
196	002261	拓维信息	7,943,909.64	3.30
197	600777	新潮能源	7,929,610.00	3.29
198	300738	奥飞数据	7,807,781.44	3.24
199	605589	圣泉集团	7,736,217.28	3.21
200	300627	华测导航	7,723,321.80	3.21
201	300377	赢时胜	7,696,136.00	3.19
202	600480	凌云股份	7,662,827.55	3.18
203	300485	赛升药业	7,627,367.42	3.17
204	300323	华灿光电	7,621,021.00	3.16
205	688339	亿华通	7,610,236.23	3.16
206	002792	通宇通讯	7,402,056.00	3.07
207	002215	诺普信	7,381,511.01	3.06
208	600116	三峡水利	7,373,609.00	3.06
209	688166	博瑞医药	7,306,846.22	3.03
210	002344	海宁皮城	7,291,826.00	3.03
211	600882	妙可蓝多	7,253,499.13	3.01
212	688568	中科星图	7,150,880.64	2.97
213	605365	立达信	7,141,559.00	2.96

214	002472	双环传动	7,050,359.86	2.93
215	603236	移远通信	7,047,965.52	2.93
216	300857	协创数据	7,026,498.00	2.92
217	600477	杭萧钢构	7,025,809.00	2.92
218	000885	城发环境	6,990,835.28	2.90
219	600850	电科数字	6,939,708.66	2.88
220	300791	仙乐健康	6,850,906.36	2.84
221	002463	沪电股份	6,847,637.50	2.84
222	002807	江阴银行	6,840,705.00	2.84
223	601137	博威合金	6,817,628.00	2.83
224	600096	云天化	6,803,615.00	2.82
225	002567	唐人神	6,801,156.00	2.82
226	603222	济民医疗	6,788,736.00	2.82
227	300458	全志科技	6,783,605.00	2.82
228	000560	我爱我家	6,760,812.00	2.81
229	300856	科思股份	6,685,474.50	2.78
230	002421	达实智能	6,671,131.00	2.77
231	002017	东信和平	6,617,232.00	2.75
232	002518	科士达	6,592,320.00	2.74
233	002378	章源钨业	6,582,479.11	2.73
234	002139	拓邦股份	6,572,610.00	2.73
235	688680	海优新材	6,550,945.92	2.72
236	300487	蓝晓科技	6,528,203.00	2.71
237	603936	博敏电子	6,476,126.50	2.69
238	300655	晶瑞电材	6,472,594.20	2.69
239	300158	振东制药	6,469,592.00	2.69
240	688200	华峰测控	6,414,588.14	2.66
241	601677	明泰铝业	6,410,819.02	2.66
242	688408	中信博	6,360,569.24	2.64
243	600750	江中药业	6,335,096.00	2.63
244	688277	天智航	6,278,017.39	2.61
245	301071	力量钻石	6,246,963.00	2.59
246	002108	沧州明珠	6,221,518.10	2.58
247	600557	康缘药业	6,215,680.00	2.58
248	002880	卫光生物	6,174,555.78	2.56
249	300188	美亚柏科	6,152,142.31	2.55
250	603027	千禾味业	6,145,925.80	2.55
251	002226	江南化工	6,142,369.20	2.55
252	600114	东睦股份	6,128,233.08	2.54
253	300502	新易盛	6,123,009.58	2.54
254	603348	文灿股份	6,110,662.00	2.54
255	600389	江山股份	6,062,016.00	2.52
256	002664	信质集团	6,044,482.54	2.51

257	002585	双星新材	5,986,529.00	2.49
258	603363	傲农生物	5,982,600.00	2.48
259	600583	海油工程	5,970,832.00	2.48
260	600618	氯碱化工	5,948,662.00	2.47
261	601528	瑞丰银行	5,947,130.86	2.47
262	688333	铂力特	5,945,495.79	2.47
263	003040	楚天龙	5,911,402.00	2.45
264	300456	赛微电子	5,877,187.00	2.44
265	300682	朗新科技	5,871,824.00	2.44
266	605376	博迁新材	5,863,227.34	2.43
267	603826	坤彩科技	5,801,796.00	2.41
268	002782	可立克	5,786,824.18	2.40
269	002838	道恩股份	5,784,978.00	2.40
270	002967	广电计量	5,784,977.68	2.40
271	600662	外服控股	5,759,423.00	2.39
272	300068	南都电源	5,727,637.69	2.38
273	600422	昆药集团	5,727,624.80	2.38
274	000025	特力 A	5,724,989.00	2.38
275	300842	帝科股份	5,712,220.00	2.37
276	603026	胜华新材	5,701,582.00	2.37
277	002541	鸿路钢构	5,675,372.50	2.36
278	600855	航天长峰	5,670,828.90	2.35
279	002091	江苏国泰	5,665,251.04	2.35
280	300215	电科院	5,655,163.00	2.35
281	300457	赢合科技	5,649,312.50	2.35
282	688520	神州细胞	5,605,800.14	2.33
283	300788	中信出版	5,597,575.92	2.32
284	688518	联赢激光	5,597,404.48	2.32
285	603299	苏盐井神	5,589,169.16	2.32
286	688278	特宝生物	5,579,945.66	2.32
287	605090	九丰能源	5,424,241.20	2.25
288	600810	神马股份	5,419,212.00	2.25
289	600986	浙文互联	5,412,827.36	2.25
290	600172	黄河旋风	5,399,305.00	2.24
291	300346	南大光电	5,394,347.00	2.24
292	605009	豪悦护理	5,389,128.30	2.24
293	688399	硕世生物	5,387,911.41	2.24
294	601279	英利汽车	5,383,765.00	2.23
295	601011	宝泰隆	5,356,247.00	2.22
296	002643	万润股份	5,348,273.00	2.22
297	605168	三人行	5,339,239.00	2.22
298	002145	中核钛白	5,319,942.41	2.21
299	603279	景津装备	5,299,803.00	2.20

300	603690	至纯科技	5,291,723.00	2.20
301	300662	科锐国际	5,266,317.00	2.19
302	300229	拓尔思	5,235,052.50	2.17
303	300672	国科微	5,211,282.00	2.16
304	002262	恩华药业	5,199,878.81	2.16
305	600550	保变电气	5,137,659.88	2.13
306	000591	太阳能	5,116,446.00	2.12
307	300007	汉威科技	5,097,989.08	2.12
308	603530	神马电力	5,091,793.70	2.11
309	002609	捷顺科技	5,035,051.00	2.09
310	300368	汇金股份	4,998,219.00	2.07
311	688586	江航装备	4,993,062.89	2.07
312	300777	中简科技	4,981,978.16	2.07
313	002906	华阳集团	4,966,154.00	2.06
314	301035	润丰股份	4,953,208.32	2.06
315	600562	国睿科技	4,950,494.00	2.06
316	000034	神州数码	4,907,034.00	2.04
317	300109	新开源	4,858,458.00	2.02
318	002545	东方铁塔	4,845,067.00	2.01
319	600273	嘉化能源	4,829,745.75	2.00

8.4.3 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	5,695,726,032.39
卖出股票收入（成交）总额	5,463,115,191.41

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

运用衍生品捕捉利率变动的波段交易机会，并通过期现套利、跨期套利和跨品种套利等择机增厚收益，同时灵活调整组合敞口，控制回撤。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包含国债期货，无相关投资政策。

8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

无。

8.12.3 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	3,204,228.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	848,870.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,053,098.87

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
兴银中证 1000 指数增强 A	2,994	55,258.34	8,086,753.52	4.89%	157,356,703.98	95.11%
兴银中证 1000 指数增强 C	3,589	33,202.18	2,641,169.54	2.22%	116,521,457.91	97.78%
合计	6,583	43,233.49	10,727,923.06	3.77%	273,878,161.89	96.23%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	兴银中证 1000 指数增强 A	34,143.22	0.0206%
	兴银中证 1000 指数增强 C	511.28	0.0004%
	合计	34,654.50	0.0122%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万)
----	------	-------------------

		份)
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	兴银中证 1000 指 数增强 A	0
	兴银中证 1000 指 数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	兴银中证 1000 指 数增强 A	0
	兴银中证 1000 指 数增强 C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	兴银中证 1000 指数 增强 A	兴银中证 1000 指数 增强 C
基金合同生效日（2022 年 01 月 26 日）基金份额 总额	170,524,346.65	97,896,229.17
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	98,642,113.51	146,132,892.52
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份 额	103,723,002.66	124,866,494.24
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额 （份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	165,443,457.50	119,162,627.45

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

无。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自合同生效日（2022 年 01 月 26 日）起聘请毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。本报告期内本基金应付审计费 43500.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内，基金管理人及其相关高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华福证券	2	11,148,068,039.83	100.00%	3,085,773.78	100.00%	-

注：基金租用证券公司交易单元的选择标准是：

- （1）内部管理规范、严谨；具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- （2）研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能够针对基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；
- （3）能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动资源，协助基金投资；
- （4）其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

选择程序：本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选证券公司的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的证券公司。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华福证券	-	-	120,000,000.00	100.00%	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金基金份额发售公告、兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	证券时报	2022-01-07
2	兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同、兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金托管协议、兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书、兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金基金份额发售公告、兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金基金产品资料概要	指定网站	2022-01-07
3	关于《兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金基金份额发售公告》的更正公告	证券时报	2022-01-08
4	兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	证券时报、指定网站	2022-01-27
5	兴银基金管理有限责任公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、指定网站	2022-01-29
6	关于旗下基金参与中信建投费	上海证券报、证券日报、证券	2022-02-15

	率优惠活动并开通定期定额投资的公告	时报、中国证券报、指定网站	
7	兴银基金管理有限责任公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、指定网站	2022-03-01
8	关于旗下基金在部分代销渠道开通转换、定期定额投资并参与费率优惠活动的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、指定网站	2022-03-31
9	兴银基金管理有限责任公司关于旗下全资子公司固有资金申购公司旗下基金的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报	2022-04-06
10	兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	证券时报、指定网站	2022-04-20
11	关于旗下部分基金在华福证券开通基金转换业务的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、指定网站	2022-04-22
12	兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	指定网站	2022-04-22
13	兴银基金管理有限责任公司旗下部分基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报	2022-04-22
14	兴银基金关于面向特定投资者通过直销柜台认、申购旗下所有基金实施费率优惠的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、指定网站	2022-07-02
15	关于旗下基金参与浦发银行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	2022-07-07
16	兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金 2022 年第 2 季度报告	指定网站	2022-07-21
17	兴银基金管理有限责任公司旗下部分基金 2022 年第 2 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	2022-07-21
18	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	2022-08-26
19	兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金 2022 年中期报告	指定网站	2022-08-31
20	兴银基金管理有限责任公司旗下部分基金 2022 年中期报告提示性公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报	2022-08-31
21	关于旗下基金参与创金启富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	2022-09-02

22	关于旗下基金参与玄元保险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	2022-09-15
23	关于旗下部分基金在兴银基金直销柜台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	2022-09-17
24	关于旗下基金参与九州证券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	2022-09-19
25	兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金 2022 年第 3 季度报告	指定网站	2022-10-26
26	兴银基金管理有限责任公司旗下部分基金 2022 年第 3 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	2022-10-26
27	兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）（2022 年第 1 号）、兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金基金产品资料概要（兴银中证 1000 指数增强 A 份额）（更新）、兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金基金产品资料概要（兴银中证 1000 指数增强 C 份额）（更新）	指定网站、中数平台	2022-12-20

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金变更注册的文件
2. 《兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》

3. 《兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金托管协议》
4. 《兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书》
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照
6. 报告期内在指定信息披露媒体上公开披露的各项公告

13.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处。

13.3 查阅方式

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

兴银基金管理有限责任公司

二〇二三年三月三十日