

# 东兴宸祥量化混合型证券投资基金

## 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人:东兴基金管理有限公司

基金托管人:长江证券股份有限公司

送出日期:2023 年 03 月 31 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人长江证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年3月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为基金财务出具了标准无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自2022年1月28日（基金合同生效日）起至2022年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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	16
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 净资产（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	23
§8 投资组合报告	47
8.1 期末基金资产组合情况	47
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	68
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	73
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	74
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	74
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	74
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	74
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	74

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	74
8.12 投资组合报告附注.....	74
§9 基金份额持有人信息.....	75
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	75
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	76
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.....	76
§10 开放式基金份额变动.....	76
§11 重大事件揭示.....	77
11.1 基金份额持有人大会决议.....	77
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.....	77
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	77
11.4 基金投资策略的改变.....	77
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	77
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.....	77
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	78
11.8 其他重大事件.....	79
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	80
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.....	80
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	81
§13 备查文件目录.....	81
13.1 备查文件目录.....	81
13.2 存放地点.....	81
13.3 查阅方式.....	81

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	东兴宸祥量化混合型证券投资基金	
基金简称	东兴宸祥量化混合	
基金主代码	013166	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022年01月28日	
基金管理人	东兴基金管理有限公司	
基金托管人	长江证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	47,086,103.06份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	东兴宸祥量化混合A	东兴宸祥量化混合C
下属分级基金的交易代码	013166	013167
报告期末下属分级基金的份额总额	38,884,499.38份	8,201,603.68份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，力争实现达到或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	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金基于定量与定性相结合的方式跟踪国内外宏观经济数据及政策变化，密切关注市场流动性变化情况，动态评估不同资产的估值水平变化，合理确定组合中权益资产、债券资产及货币市场工具及其他金融工具的投资比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>(1) 多因子投资体系。因子涵盖估值、盈利、成长、财务质量、趋势、量价关系等，在底层大数据的基础上，通过多种形式计算形成不同种类的选股因子对每只股票进行打分形成股票组合。</p> <p>(2) 机器学习辅助投资体系。通过机器学习技术发现因子和收益之间潜在的隐含关系（如非线性关系），实现对因子进行动态预测，从而提供更强的投资信号。</p>

	<p>(3) 行业优化体系。在组合构建过程中,通过市场面、行业相对估值、资金流变动等一系列指标动态进行二级行业的小幅调整,将部分可能出现负贡献的行业配置进行一定程度降低。</p> <p>(4) 风险控制体系。在业绩比较基准--中证500指数的基础上,通过量化策略提升收益水平,控制股票组合与业绩比较基准的超额收益回撤风险。</p> <p>3、债券投资策略;4、资产支持证券投资策略;5、股指期货投资策略;</p> <p>6、股票期权投资策略;7、可转换债券投资策略;8、可交换债券投资策略;9、国债期货投资策略</p>
业绩比较基准	中证500指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	东兴基金管理有限公司	长江证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李宛霖
	联系电话	400-670-1800
	电子邮箱	kefu@dxamc.cn
客户服务电话	400-670-1800	027-65795980
传真	010-57307388	027-85481841
注册地址	北京市丰台区东管头1号院1号楼1-190室	湖北省武汉市江汉区淮海路88号
办公地址	北京市西城区平安里西大街28号中海国际中心6层	湖北省武汉市江汉区淮海路88号长江证券大厦36楼
邮政编码	100035	430023
法定代表人	牛南洁	金才玖

### 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	<a href="http://www.dxamc.cn">http://www.dxamc.cn</a>

基金年度报告备置地点	北京市西城区平安里西大街28号中海国际中心6层
------------	-------------------------

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心写字楼A座26楼
注册登记机构	东兴基金管理有限公司	北京市西城区平安里西大街28号中海国际中心6层

## §3 主要财务指标、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	本期2022年01月28日（基金合同生效日）- 2022年12月31日	
	东兴宸祥量化混合A	东兴宸祥量化混合C
本期已实现收益	1,306,066.09	252,809.04
本期利润	-316,851.52	257,587.82
加权平均基金份额本期利润	-0.0069	0.0106
本期加权平均净值利润率	-0.69%	1.07%
本期基金份额净值增长率	-1.23%	-1.33%
3.1.2 期末数据和指标	2022年末	
期末可供分配利润	-478,028.04	-109,478.52
期末可供分配基金份额利润	-0.0123	-0.0133
期末基金资产净值	38,406,471.34	8,092,125.16
期末基金份额净值	0.9877	0.9867
3.1.3 累计期末指标	2022年末	
基金份额累计净值增长率	-1.23%	-1.33%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

4、本基金基金合同于2022年1月28日生效，无期间可比数据，本报告实际报告期为2022年1月28日至2022年12月31日。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### 东兴宸祥量化混合A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.60%	1.12%	2.03%	0.82%	0.57%	0.30%
过去六个月	-6.99%	1.15%	-7.24%	0.88%	0.25%	0.27%
自基金合同生效起至今	-1.23%	1.15%	-8.78%	1.11%	7.55%	0.04%

##### 东兴宸祥量化混合C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.58%	1.12%	2.03%	0.82%	0.55%	0.30%
过去六个月	-7.03%	1.15%	-7.24%	0.88%	0.21%	0.27%
自基金合同生效起至今	-1.33%	1.15%	-8.78%	1.11%	7.45%	0.04%

注：本基金基金合同于2022年1月28日生效，截至本报告期末（2022年12月31日）不满一年。

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



东兴宸祥量化混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

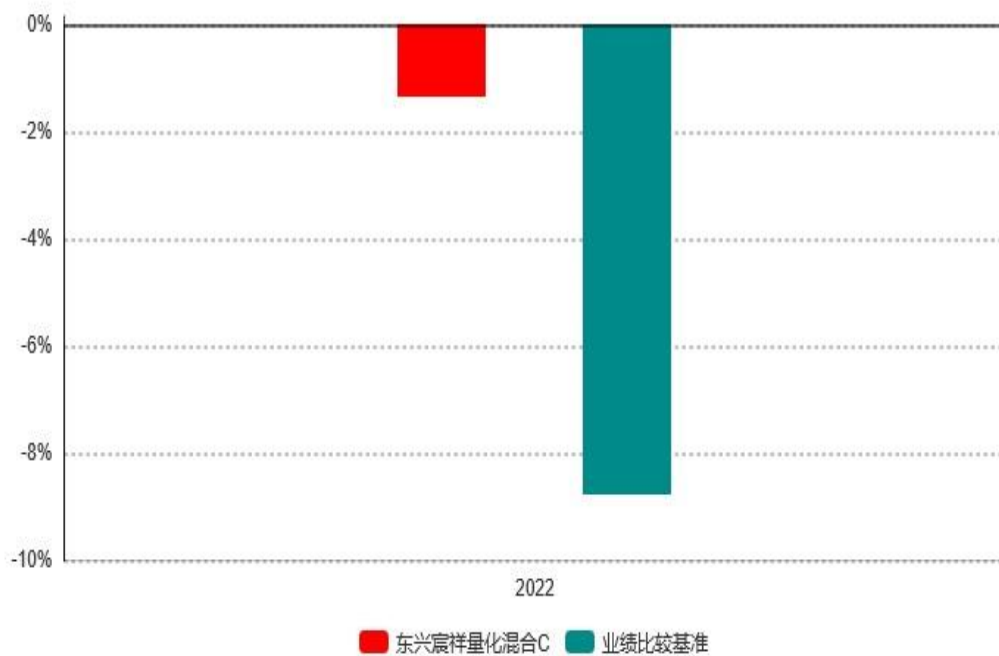
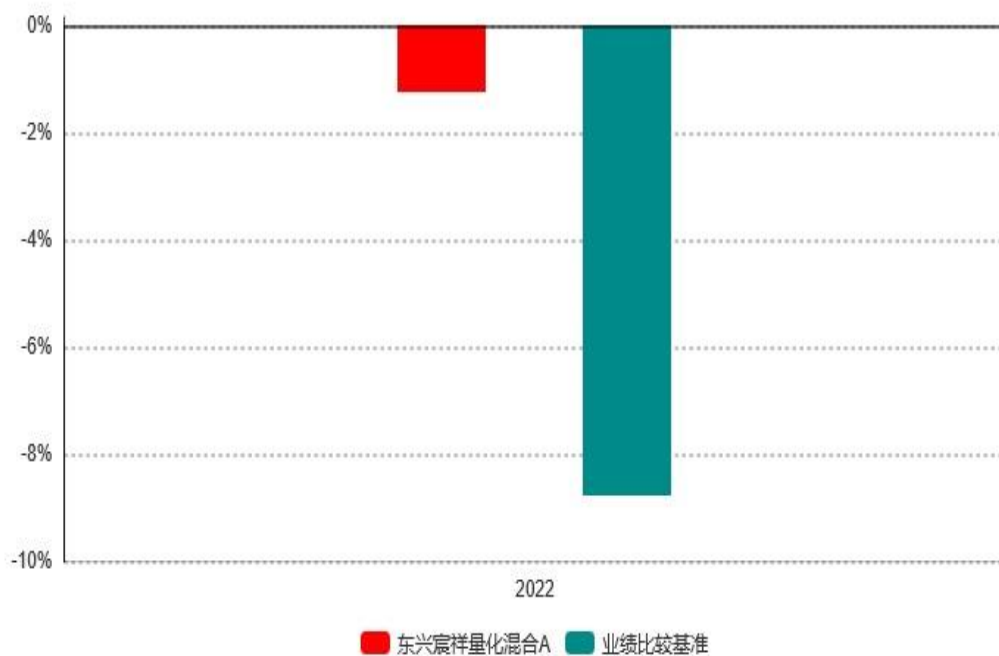


东兴宸祥量化混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：1、本基金基金合同生效日为2022年1月28日，根据相关法律法规和基金合同，本基金建仓期为基金合同生效之日起6个月内，截止本报告期末距建仓期结束不满一年；  
2、建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## 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：本基金基金合同于2022年1月28日生效,自合同生效以来未满五年。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 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2022年1月28日）至报告期截止日（2022年12月31日）未进行利润分配。

## §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

东兴基金管理有限公司（以下简称“东兴基金”）成立于2020年3月，注册地北京，注册资本2亿元。东兴证券股份有限公司（以下简称“东兴证券”）持有东兴基金100%股份，其控股股东为中国东方资产管理股份有限公司（以下简称“中国东方”），实际控制人为中国财政部。东兴基金系中国东方下属唯一公募基金业务经营主体，是中国东方金融服务平台的重要组成部分。

东兴基金前身为东兴证券基金业务部，先后在主动权益、固定收益、现金管理和指数类产品方面进行了大量布局，积累了丰富的投资运作经验：

特色指数类产品--在行业指数、量化增强方面进行深入研究设计，致力于打造特色精品指数类基金阵列；

主动管理类产品--以追求绝对收益为目标，贯彻自上而下和自下而上相结合的投研思路，坚持价值投资；

固定收益类产品--坚持守住价值、发现价值的原则，在严格把控信用风险的前提下，充分挖掘市场机会。

东兴基金拥有一支行业经验丰富、具备高度凝聚力、战斗力和专业性的优秀团队。公司大部分员工来自于基金、券商、投资、信评等各类金融机构，90%以上员工具有硕士及以上学历。公司承载中国东方的红色基因，践行诚信、创新、激情、专注、协作的企业文化，坚持以投资者利益为上的原则，致力为客户持续创造价值。

截至2022年12月31日，本公司管理东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金、东兴蓝海财富灵活配置混合型证券投资基金、东兴安盈宝货币市场基金、东兴兴利债券型证券投资基金、东兴量化优享灵活配置混合型证券投资基金、东兴品牌精选灵活配置混合型证券投资基金、东兴兴福一年定期开放债券型证券投资基金、东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金、东兴兴瑞一年定期开放债券型证券投资基金、东兴兴财短债债券型证券投资基金、东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金、东兴中证消费50指数证券投资基金、东兴兴晟混合型证券投资基金、东兴宸瑞量化混合型证券投资基金、东兴鑫享6个月滚动持有债券型发起式证券投资基金、东兴兴盈三个月定期开放债券型证券投资基金、东兴兴源债券型证券投资基金、东兴宸祥量化混合型证券投资基金、东兴连裕6个月滚动持有债券型证券投资基金共19只开放式基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金 经理（助理） 期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
李兵伟 先生	本基金 基金经 理	2022- 01-28	-	12年	中央财经大学金融学硕士，12年以上证券行业从业经历，12年以上证券投研管理经验。2010年7月至2015年8月，任信达证券金融工程研究员、投资经理；2015年9月加入东兴证券股份有限公司基金业务部。现任东兴量化优享灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东兴中证消费50指数证券投资基金基金经理、东兴兴晟混合型证券投资基金基金经理、东兴宸瑞量化混合型证券投资基金基金经理、东兴宸祥量化混合型证券投资基金基金经理。

注：1、对基金的首任基金经理，其"任职日期"为基金合同生效日，"离任日期"为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证券监督管理委员会和《东兴宸祥量化混合型证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《东兴基金管理有限公司公平交易管理办法》。

基金管理人建立了投资决策的内部控制体系和客观的研究方法，各投资组合经理在授权范围内自主决策，各投资组合共享研究平台，在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

基金管理人实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于交易所公开竞价交易，基金管理人执行交易系统内的公平交易程序；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易，在参与申购之前，各基金经理应在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量。在获配额度确定后，按照价格优先的原则对交易结果进行分配；如果申购价格相同，则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配。债券一级市场申购分配不足最小单位的，可由基金经理协商分配，协商不一致则由投资总监决定；对于银行间市场交易，应按照场外交易流程执行，由各基金经理给出询价区间，交易部根据询价区间在银行间市场上应该按照价格优先、时间优先的原则进行询价并完成交易，并留存询价交易记录备查。

基金管理人定期对不同投资组合不同时间段同向交易价差、反向交易情况、异常交易情况进行统计分析，投资组合经理对相关交易情况进行合理性解释并留存记录。

本报告期内，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动中公平对待不同投资组合，未直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。本基金运作符合法律法规和公平交易管理制度规定。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

我们对本报告期内公司管理的不同投资组合在相同时间窗口下（日内、3日内和5日内）同向交易的价差进行了t分布假设检验，通过对检验结果进行分析，未发现旗下投资组合之间存在可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022年一季度，市场面临错综复杂的国内外环境，全球疫情反复、俄乌冲突爆发、美联储收紧流动性以及国内经济面临增长压力，A股市场持续震荡下行。二季度随着稳增长措施的持续发力及国内疫情边际好转，投资者对国内经济预期也转向积极，宏观流动性宽松，A股市场风险偏好从底部回升，个股活跃度显著上升。三季度国内稳增长政策持续发力，宏观流动性保持宽松，但受疫情反复、高温限电、地产疲弱等因素影响，经济修复趋缓，A股市场风险偏好依然不高，三季度整体呈现震荡下行走势。四季度国庆假期后，市场开始博弈疫情防控政策预期，叠加房地产宽松政策持续加码，风险偏好开始企稳改善，市场演绎超跌反弹。而随着11月以来疫情防控政策的逐步放松，金融地产和必选消费依次修复，大盘价值显著占优。

东兴宸祥在投资策略方面采用分散化投资的理念，重点关注兼具估值和成长的公司，从历史上看，目前的估值处于相对较低水平，具有较大投资价值。在选股层面，通过多方面筛选，重点选择成长性好，盈利能力强的公司，结合估值预期形成投资组合。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2022年1月28日（基金合同生效日）起至2022年12月31日，本基金A类份额净值增长率为-1.23%，业绩比较基准收益率为-8.78%，高于业绩比较基准7.55%；本基金C类份额净值增长率为-1.33%，业绩比较基准收益率为-8.78%，高于业绩比较基准7.45%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

往后看，国内宽松政策持续加码、疫情过后居民生活逐步正常化，都会推动经济持续复苏。随着市场回暖，机构投资者也将提供增量资金。我们观察到保险和私募仓位已从底部开始回升；公募基金方面，随着去年底以来净值回暖，后续基金发行也将加速。考虑到目前市场整体估值仍处于较低水平，投资者对经济信心持续修复，A股市场机会仍大于风险。

#### 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，本基金管理人严格遵守相关法律法规，坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，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。

本报告期内，本基金管理人进一步完善了公司的内控体系；对公司投研交易、市场销售、后台运营等业务开展了定期或专项稽核，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性；采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，加强对日常投资运作的管理和监控，督促投研交易业务的合规开展；针对新出台的法律法规和监管要求，积极组织

了多项法律法规和职业道德培训，不断提高从业人员的合规素质和职业道德修养；全面参与新产品设计、新业务拓展工作；严格审查基金宣传推介材料，及时检查基金销售业务的合法合规情况；完成各项信息披露工作，保证所披露信息的真实性、准确性和完整性；监督客户投诉处理，重视媒体监督和投资者关系管理。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，顺应“放松管制、加强监管”的监管形势，积极健全内部管理制度，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护基金资产的安全与利益。

#### **4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明**

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本基金本报告期未进行利润分配。

#### **4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

报告期内，受基金份额持有人赎回等影响，本基金存在基金资产净值连续二十个工作日低于五千万元的情况，但不存在连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形和基金资产净值连续六十个工作日低于五千万元的情况。

## **§5 托管人报告**

### **5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

本报告期内，本基金托管人在对东兴宸祥量化混合型证券投资基金托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和资产管理合同的有关规定，不存在任何损害投资人利益的行为，完全尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

### **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，东兴宸祥量化混合型证券投资基金的管理人--东兴基金管理有限公司在该基金的投资运作、净值计算、费用开支等问题上，托管人未发现其存在损害投资人利益的行为。

### 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

本托管人依法对东兴基金管理有限公司编制和披露的东兴宸祥量化混合型证券投资基金年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## §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	普华永道中天审字(2023)第28460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	东兴宸祥量化混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了东兴宸祥量化混合型证券投资基金(以下简称"东兴宸祥量化混合基金")的财务报表,包括2022年12月31日的资产负债表,2022年1月28日(基金合同生效日)至2022年12月31日止期间的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注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")、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了东兴宸祥量化混合基金2022年12月31日的财务状况以及2022年1月28日(基金合同生效日)至2022年12月31日止期间的经营成果和净资产变动情况。
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。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。按照中国



	注册会计师职业道德守则，我们独立于东兴宸祥量化混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	东兴宸祥量化混合基金的基金管理人东兴基金管理有限公司(以下简称"基金管理人")管理层对其他信息负责。其他信息包括东兴宸祥量化混合基金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。基于我们已经执行的工作，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和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，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东兴宸祥量化混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算东兴宸祥量化混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督东兴宸祥量化混合基金的财务报告过程。
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：(一)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。(二)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。(三)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。(四)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，就可能导致对东兴宸祥量化混合基金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东兴宸祥量化混合基金不能持续经营。(五)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	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	闫琳、宋昊礼
会计师事务所的地址	北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心写字楼A座26楼
审计报告日期	2023-03-28

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：东兴宸祥量化混合型证券投资基金

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	331,459.94
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	46,349,792.36
其中：股票投资		43,651,302.76
基金投资		-
债券投资		2,698,489.60
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		1,298.89
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-
资产总计		46,682,551.19
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022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	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-

应付清算款		-
应付赎回款		29,152.78
应付管理人报酬		61,022.18
应付托管费		4,068.16
应付销售服务费		711.57
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	89,000.00
负债合计		183,954.69
<b>净资产：</b>		
实收基金	7.4.7.7	47,086,103.06
其他综合收益		-
未分配利润	7.4.7.8	-587,506.56
净资产合计		46,498,596.50
负债和净资产总计		46,682,551.19

注：1、报告截止日2022年12月31日，东兴宸祥混合A基金份额净值0.9877元，基金份额总额38,884,499.38份，东兴宸祥混合C基金份额净值0.9867元，基金份额总额8,201,603.68份；

2、本基金基金合同于2022年1月28日生效，无可比期间数据。本报告实际报告期为2022年1月28日（基金合同生效日）至2022年12月31日，下同。

## 7.2 利润表

会计主体：东兴宸祥量化混合型证券投资基金

本报告期：2022年01月28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28日（基金合同生效日）至2022年12月31日
一、营业总收入		1,130,809.80

1.利息收入		288,125.36
其中：存款利息收入	7.4.7.9	202,143.56
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		85,981.80
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,275,097.69
其中：股票投资收益	7.4.7.10	1,379,626.07
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.11	68,050.09
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	827,421.53
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）	7.4.7.16	-1,618,138.83
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	185,725.58
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>1,190,073.50</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,008,887.17
2. 托管费	7.4.10.2.2	67,259.13
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	24,217.65
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		309.55

8. 其他费用	7.4.7.18	89,400.00
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-59,263.70
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-59,263.70
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-59,263.70

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：东兴宸祥量化混合型证券投资基金

本报告期：2022年01月28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28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）	232,895,020.01	-	-	232,895,020.01
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-185,808,916.95	-	-587,506.56	-186,396,423.51
（一）、综合收益总额	-	-	-59,263.70	-59,263.70
（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）	-185,808,916.95	-	-528,242.86	-186,337,159.81
其中：1.基金申购款	17,571,162.17	-	964,383.73	18,535,545.90
2.基金赎回款	-203,380,079.12	-	-1,492,626.59	-204,872,705.71
（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）	47,086,103.06	-	-587,506.56	46,498,596.50

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:

牛南洁

郝洁

王广辉

-----

-----

-----

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

东兴宸祥量化混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据2021年5月27日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予东兴宸祥量化混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2021]1832号）的批复，自2021年11月26日至2022年1月25日公开募集设立。本基金为混合型证券投资基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集232,847,454.05元人民币，经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）“普华永道中天验字(2022)第0065号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《东兴宸祥量化混合型证券投资基金基金合同》于2021年1月28日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为232,895,020.01份，其中认购资金利息折合47,565.96份。本基金基金管理人为东兴基金管理有限公司，基金托管人长江证券股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东兴宸祥量化混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、次级债、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债、企业债、公司债、可转换公司债券(含分离交易的可转换公司债券)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款等)、同业存单、货币市场工具、国债期货、股票期权、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的60%-95%，每个交易日日终在扣除国债期货合约、股票期权合约、股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资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。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的会计报表按照财政部2006年2月15日颁布的《企业会计准则--基本准则》(财政部令第33号发布、财政部令第76号修订)、于2006年2月15日及其后颁布和修订的42项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证券投资基金业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第2号-年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号-年度报告和中期报告》、《证券投资基金信息披露编报规则第3号-会计报表附注的编制及披露》及中国证监会颁布的其他相关规定编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合企业会计准则及其他有关规定要求,真实、完整地反映了本基金2022年12月31日的财务状况以及2022年1月28日(基金合同生效日)至2022年12月31日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

本基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日。本期财务报表的实际编制期间为2022年1月28日(基金合同生效日)至2022年12月31日。首期年度财务报表的编制期间从基金合同生效日起至相关年度的12月31日止,末期年度财务报表的编制期间从相关年度的1月1日起至基金合同终止日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### 1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产。在通常情况下,本基金所持有的金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产。

基金持有的股票投资、债券投资、基金投资、资产支持证券投资等金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资



产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表以交易性金融资产列示。

基金持有的以摊余成本计量的、按照返售协议约定先买入再按固定价格返售的票据、证券等金融资产所融出的资金分类为买入返售金融资产。

基金采用买入并持有至到期策略的金融资产，即到期日固定、回收金额固定或可确定，且有明确意图和能力持有至到期的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产，在债权投资中核算。

基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

## 2、金融负债的分类

金融负债分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以及以摊余成本计量的金融负债两类。基金持有的未划分为以摊余成本计量的金融负债通常以公允价值计量且其变动计入当期损益，列示为交易性金融负债。基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按取得时的公允价值作为初始确认金额。取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，期间取得的利息或现金股利，确认为当期收益。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以成本进行后续计量，在摊销时产生的利得或损失，应当确认为当期收益。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产；金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

1、对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采

用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

3、如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### **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。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **7.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

#### **7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量**

##### **（1）利息收入**

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

分类为以摊余成本计量的金融资产利息收入在持有期内，按金融资产的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由金融资产发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认金融资产利息收入。其中：贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入；买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息收入。

## （2）投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本和对应投资品种产生的交易费用的差额确认。

债券、资产支持证券、同业存单等固定收益类金融资产的投资收益分为：

① 持有期间的利息收入：分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产利息收入在持有期内，按金融资产的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由金融资产发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认金融资产投资收益。其中：贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认投资收益；

② 交易日按卖出金融资产交易日的成交总额扣除应结转的投资成本与应计利息(若有)和对应投资品种产生的交易费用后的差额确认投资收益。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本和对应投资品种产生的交易费用后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

## （3）公允价值变动损益

公允价值变动损益系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失，并于相关金融资产或金融负债卖出或到期时转出计入投资收益。

## （4）其他收入

其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量时确认。

### 7.4.4.10 费用的确认和计量

（1）根据基金合同，基金管理费按前一日基金资产净值的1.50%的年费率逐日计提；

（2）根据基金合同，基金托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率逐日计提；

（3）根据基金合同，基金销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.10%的年费率计提；

(4) 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费用；基金份额持有人大会费用、基金的证券交易或结算费用；基金的银行汇划费用；证券账户开户费用、银行账户维护费用、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的30%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；选择采取红利再投资形式的，分红资金将按红利发放日的基金份额净值转成相应的基金份额，红利再投资的份额免收申购费。如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，则登记机构将以投资者在各销售机构最后一次选择的分红方式为准；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5、分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红，分红权益登记日申请赎回的基金份额享受当次分红；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且对现有基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人、登记机构可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

#### 7.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他需要披露的重要会计政策和会计估计。

### 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

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期无需说明的重大会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期无需说明的重大会计差错更正。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税【2004】78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税【2005】103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税【2008】1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年4月23日发布的《上海、深圳证券交易所关于做好交易相关系统印花税率参数调整的通知》、2008年9月18日发布的《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税【2012】85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税【2015】101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税【2016】36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税【2016】70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》、财税【2016】140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税【2017】2号《财政部、国家税务总局关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税【2017】56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作、财税【2017】90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》，主要税项列示如下：

1.于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。自2018年1月1日起，在基金运营过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

2.对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3.对基金取得的股票股息、红利收入，自2015年9月8日起，基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4.对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5.对于基金从事A股买卖，自2008年09月19日起，由出让方按0.1%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税。

6.基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免于缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

## 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	94,251.34
等于：本金	94,228.18
加：应计利息	23.16
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	237,208.60
等于：本金	237,199.42
加：应计利息	9.18
减：坏账准备	-
合计	331,459.94

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券资金账户的证券交易结算资金。

### 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	45,265,226.16	-	43,651,302.76	-1,613,923.40
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	50,920.50	2,698,489.60	-4,215.43
	银行间市场	-	-	-
	合计	50,920.50	2,698,489.60	-4,215.43
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	47,917,010.69	50,920.50	46,349,792.36	-1,618,138.83

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 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	-
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	89,000.00
合计	89,000.00

注：预提费用为按日计提的审计费和信息披露费。

#### 7.4.7.7 实收基金

##### 7.4.7.7.1 东兴宸祥量化混合A

金额单位：人民币元

项目 (东兴宸祥量化混合A)	本期 2022年01月28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	84,044,614.48	84,044,614.48
本期申购	13,588,746.02	13,588,746.02
本期赎回（以“-”号填列）	-58,748,861.12	-58,748,861.12
本期末	38,884,499.38	38,884,499.38

##### 7.4.7.7.2 东兴宸祥量化混合C

金额单位：人民币元

项目 (东兴宸祥量化混合C)	本期 2022年01月28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	148,850,405.53	148,850,405.53
本期申购	3,982,416.15	3,982,416.15
本期赎回（以“-”号填列）	-144,631,218.00	-144,631,218.00
本期末	8,201,603.68	8,201,603.68

注：本基金基金合同于2022年1月28日生效，基金合同生效日的基金份额总额为232,895,020.01份，A类基金份额总额为84,044,614.48份，其中：认购资金本金折算基金份额为：84,016,848.29份，利息折算基金份额为：27,766.19份；C类基金份额总额为



148,850,405.53份，其中：认购资金本金折算基金份额为：148,830,605.76份，利息折算基金份额为：19,799.77份。

#### 7.4.7.8 未分配利润

##### 7.4.7.8.1 东兴宸祥量化混合A

单位：人民币元

项目 (东兴宸祥量化混合A)	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	1,306,066.09	-1,622,917.61	-316,851.52
本期基金份额交易产生的变动数	425,923.69	-587,100.21	-161,176.52
其中：基金申购款	910,541.34	-89,349.70	821,191.64
基金赎回款	-484,617.65	-497,750.51	-982,368.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,731,989.78	-2,210,017.82	-478,028.04

##### 7.4.7.8.2 东兴宸祥量化混合C

单位：人民币元

项目 (东兴宸祥量化混合C)	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	252,809.04	4,778.78	257,587.82
本期基金份额交易产生的变动数	103,480.36	-470,546.70	-367,066.34
其中：基金申购款	240,559.45	-97,367.36	143,192.09
基金赎回款	-137,079.09	-373,179.34	-510,258.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	356,289.40	-465,767.92	-109,478.52

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月28日（基金合同生效日）至2022年12月31日
活期存款利息收入	46,218.41
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	11,480.71
结算备付金利息收入	144,444.44
其他	-
合计	202,143.56

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券资金账户的证券交易结算资金的利息收入。

#### 7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月28日（基金合同生效日）至2022年12月31日
卖出股票成交总额	267,908,633.60
减：卖出股票成本总额	265,786,064.58
减：交易费用	742,942.95
买卖股票差价收入	1,379,626.07

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月28日（基金合同生效日）至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	84,084.84
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-16,034.75
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	68,050.09

#### 7.4.7.11.2 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28日（基金合同生效日）至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	26,128,366.36
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	25,223,151.77
减：应计利息总额	915,020.35
减：交易费用	6,228.99
买卖债券差价收入	-16,034.75

#### 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月28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	827,421.53
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	827,421.53

**7.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年01月28日（基金合同生效日）至2022年12月31日
1.交易性金融资产	-1,618,138.83
——股票投资	-1,613,923.40
——债券投资	-4,215.43
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-1,618,138.83

**7.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月28日（基金合同生效日）至2022年12月31日
基金赎回费收入	183,081.83
转换费收入	2,643.75
合计	185,725.58

**7.4.7.18 信用减值损失**

本基金本报告期2022年1月28日（基金合同生效日）至2022年12月31日无信用减值损失。

**7.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月28日（基金合同生效日）至2022年12月31日
审计费用	19,000.00
信息披露费	70,000.00
证券出借违约金	-
其他	400.00
合计	89,400.00

注：其他为证券账户开户费。

#### 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

本基金本报告期末不存在需要说明的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本基金报告报出日，本基金不存在需要说明的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

关联方名称	与本基金的关系
中国东方资产管理股份有限公司	基金管理人的实际控制人
东兴证券股份有限公司	基金管理人的控股股东、基金销售机构
东兴基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
长江证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
大连银行股份有限公司	与基金管理人同一实际控制人的关联方、基金销售机构

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 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

本基金本报告期2022年1月28日（基金合同生效日）至2022年12月31日未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期2022年1月28日（基金合同生效日）至2022年12月31日未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期2022年1月28日（基金合同生效日）至2022年12月31日未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期2022年1月28日（基金合同生效日）至2022年12月31日未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期2022年1月28日（基金合同生效日）至2022年12月31日未发生与关联方的佣金费用，期末无应支付关联方的佣金。

### 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28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	1,008,887.17
其中：支付销售机构的客户维护费	349,788.73

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一

次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、本基金基金合同于2022年1月28日生效，无可比期间数据。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月28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	67,259.13

注：1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2、本基金基金合同生效日为2022年1月28日，无可比期间数据。

#### 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28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		
	东兴宸祥量化混合A	东兴宸祥量化混合C	合计
东兴基金管理有限公司	0.00	5,258.97	5,258.97
长江证券股份有限公司	0.00	929.60	929.60
大连银行股份有限公司	0.00	3.08	3.08
东兴证券股份有限公司	0.00	14,312.19	14,312.19
合计	0.00	20,503.84	20,503.84

注：1、本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.10%的年费率计提。C类基金份额销售服务费的计算方法如下：

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

H为C类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E为前一日的C类基金份额基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取，由基金管理人支付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2、本基金基金合同生效日为2022年1月28日，无可比期间数据。

#### 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

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 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

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

##### 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

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

#### 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

东兴宸祥量化混合A

份额单位：份

项目	本期 2022年01月28日（基金合同生效日）至2022年12月31日
基金合同生效日（2022年01月28日）持有的基金份额	14,999,000.00
报告期初持有的基金份额	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00



减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	14,999,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	38.57%

注：1、本基金基金合同生效日为2022年1月28日。

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

#### 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

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

#### 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

本报告期末，本基金无由关联方保管的银行存款；本报告期本基金无当期产生的利息收入。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项的说明。

#### 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

根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本基金本报告期2022年1月28日（基金合同生效日）至2022年12月31日未进行利润分配。

#### 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
600459	贵研铂业	2022-12-22	8个交易日	配股未上市	10.91	15.74	780	8,509.80	12,277.20	-

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复牌日期	复牌 开盘 单价	数量 (股)	期末成本 总额	期末估值 总额	备注
000153	丰原药业	2022-12-20	重大事项 停牌	13.56	2023-01-04	12.20	2,200	18,742.72	29,832.00	-

#### 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

本基金本报告期末未持有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 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

本基金投资风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险和操作风险及其他不可抗拒的风险。其中在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

对于上述风险本基金管理人建立了系统化、流程化和数量化的风险管理体系，确保投资组合在获取较高收益的同时承受尽可能低的风险，从而实现本基金的投资目标。本基金设立了由风险控制委员会、投资决策委员会、风险管理部门组成的风险管理组织体系，该体系通过分工合作的制度对风险进行管理控制。本基金通过事前的风险识别，事中的风险测量和处理以及事后的风险评估和调整风险实行全程风险控制。

##### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金均投资于具有良好信用等级的证券；本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的百分之十，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的百分之十。

除通过上述投资限定控制相应信用风险外，本基金在交易所进行交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，发生违约风险的可能性很低；本基金也可在银行间同业市场进行交易，在交易前均会对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本基金本期末持有的债券均为国债，未包含在按短期信用评级列示的债券投资中。

#### **7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### **7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末未持有同业存单。

#### **7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本基金本期末持有的债券均为国债，未包含在按长期信用评级列示的债券投资中。

#### **7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### **7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末未持有同业存单。

### **7.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注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，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于2022年12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### **7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本报告所称流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险，风险管理的目标是确保基金组合资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。基金管理人在报告期内综合考虑投资标的流动性、投资策略、投资限制、销售渠道、潜在投资者类型与风险偏好、投资者结构等因素，综合进行流动性风险管理。

基金管理人坚持按照“组合管理、分散投资”的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制进行投资管理，通过灵活配置的二级市场投资策略、分散化的投资原则、严格的投资比例限制等投资安排，使基金组合资产的流动性安排与基金申赎安排相匹配，报告期内未发生流动性风险事件。

#### **7.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### **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。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金管理人在利率风险管理方面，定期监控本基金面临的利率风险敞口，并通过调整基金投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

#### 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	331,427.60	-	-	-	-	32.34	331,459.94
交易性金融资产	2,318,768.10	131,052.40	197,748.60	-	-	43,702,223.26	46,349,792.36
应收申购款	-	-	-	-	-	1,298.89	1,298.89
资产总计	2,650,195.70	131,052.40	197,748.60	-	-	43,703,554.49	46,682,551.19
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	29,152.78	29,152.78
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	61,022.18	61,022.18
应付托管费	-	-	-	-	-	4,068.16	4,068.16
应付销售服务费	-	-	-	-	-	711.57	711.57
其他负债	-	-	-	-	-	89,000.00	89,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	183,954.69	183,954.69
利率敏感度缺口	2,650,195.70	131,052.40	197,748.60	-	-	43,519,599.80	46,498,596.50

注：1、表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

2、本基金基金合同于2022年1月28日生效，无可比期间数据。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；2、所有期限的利率均以相同幅度变动25个基点，其他市场变量均不发生变化；3、银行存款、结算备付金、存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益、而对其本身的公允价值无重大影响；4、该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2022年12月31日
	1、市场利率上升25个基点	-408.40
	2、市场利率下降25个基点	408.70

注：本基金基金合同于2022年1月28日生效，无可比期间数据。

#### 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是市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 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	43,651,302.76	93.88
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	2,698,489.60	5.80
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	46,349,792.36	99.68

#### 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的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 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	43,651,302.76
第二层次	2,698,489.60
第三层次	-
合计	46,349,792.36

**7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动**

本基金本报告期内不存在持有的金融工具公允价值所属层次间发生重大变动的情况。

**7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

本基金本报告期内不存在持有非持续以公允价值计量的金融工具的情况。

**7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明**

本基金本报告期内不存在持有不以公允价值计量的金融工具的情况。

**7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

截至本报告报出日，本基金无需要披露的有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

**§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	43,651,302.76	93.51
	其中：股票	43,651,302.76	93.51
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,698,489.60	5.78
	其中：债券	2,698,489.60	5.78

	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	331,459.94	0.71
8	其他各项资产	1,298.89	0.00
9	合计	46,682,551.19	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	21,930.00	0.05
B	采矿业	2,274,880.40	4.89
C	制造业	30,018,005.48	64.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	535,465.02	1.15
E	建筑业	513,997.55	1.11
F	批发和零售业	1,525,426.70	3.28
G	交通运输、仓储和邮政业	729,345.41	1.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,980,991.40	6.41
J	金融业	2,322,788.60	5.00
K	房地产业	479,110.60	1.03
L	租赁和商务服务业	762,001.88	1.64
M	科学研究和技术服务业	784,036.06	1.69
N	水利、环境和公共设施管理业	233,201.66	0.50
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	35,136.00	0.08
Q	卫生和社会工作	253,813.00	0.55
R	文化、体育和娱乐业	146,125.00	0.31



S	综合	35,048.00	0.08
	合计	43,651,302.76	93.88

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	601009	南京银行	68,100	709,602.00	1.53
2	605088	冠盛股份	36,800	632,224.00	1.36
3	603676	卫信康	35,800	569,936.00	1.23
4	603681	永冠新材	24,400	521,672.00	1.12
5	688122	西部超导	5,507	521,457.83	1.12
6	002929	润建股份	12,900	506,454.00	1.09
7	603611	诺力股份	31,000	501,890.00	1.08
8	300908	仲景食品	12,800	490,880.00	1.06
9	688819	天能股份	13,310	489,009.40	1.05
10	603993	洛阳钼业	104,700	476,385.00	1.02
11	688589	力合微	14,073	475,948.86	1.02
12	000906	浙商中拓	52,300	471,223.00	1.01
13	300777	中简科技	9,500	466,925.00	1.00
14	600150	中国船舶	20,500	456,740.00	0.98
15	000550	江铃汽车	33,800	453,934.00	0.98
16	688616	西力科技	43,387	453,828.02	0.98
17	003020	立方制药	13,970	451,231.00	0.97
18	002560	通达股份	65,600	447,392.00	0.96
19	603300	华铁应急	69,840	442,785.60	0.95
20	002391	长青股份	61,100	429,533.00	0.92
21	300453	三鑫医疗	49,300	424,966.00	0.91
22	002661	克明食品	35,600	419,368.00	0.90
23	688682	霍莱沃	5,147	408,980.62	0.88

24	600985	淮北矿业	31,800	407,040.00	0.88
25	300514	友讯达	39,500	404,875.00	0.87
26	603855	华荣股份	16,800	388,080.00	0.83
27	600967	内蒙一机	44,900	370,874.00	0.80
28	300775	三角防务	9,700	368,600.00	0.79
29	002768	国恩股份	12,500	362,750.00	0.78
30	300570	太辰光	25,033	361,977.18	0.78
31	688093	世华科技	20,213	356,961.58	0.77
32	688559	海目星	6,144	355,368.96	0.76
33	603878	武进不锈	32,900	354,004.00	0.76
34	601908	京运通	52,100	342,297.00	0.74
35	603890	春秋电子	37,200	340,008.00	0.73
36	002594	比亚迪	1,300	334,061.00	0.72
37	600438	通威股份	8,300	320,214.00	0.69
38	000975	银泰黄金	28,600	315,744.00	0.68
39	300705	九典制药	12,720	309,096.00	0.66
40	600784	鲁银投资	48,300	292,698.00	0.63
41	688621	阳光诺和	2,836	290,406.40	0.62
42	000728	国元证券	44,600	282,318.00	0.61
43	002649	博彦科技	27,200	279,888.00	0.60
44	000567	海德股份	19,500	271,440.00	0.58
45	603896	寿仙谷	6,700	265,722.00	0.57
46	300532	今天国际	17,700	256,296.00	0.55
47	605166	聚合顺	20,800	253,968.00	0.55
48	300244	迪安诊断	10,100	253,813.00	0.55
49	601518	吉林高速	86,700	252,297.00	0.54
50	002955	鸿合科技	10,700	251,985.00	0.54
51	000915	华特达因	5,400	245,700.00	0.53
52	300801	泰和科技	11,600	245,688.00	0.53
53	688518	联赢激光	8,249	240,953.29	0.52
54	688658	悦康药业	12,400	239,568.00	0.52

55	003033	征和工业	5,200	230,880.00	0.50
56	300059	东方财富	11,580	224,652.00	0.48
57	000568	泸州老窖	1,000	224,280.00	0.48
58	601668	中国建筑	41,300	224,259.00	0.48
59	605266	健之佳	2,710	216,989.70	0.47
60	300639	凯普生物	12,550	211,467.50	0.45
61	601899	紫金矿业	21,100	211,000.00	0.45
62	000878	云南铜业	17,900	210,325.00	0.45
63	003019	宸展光电	9,795	208,731.45	0.45
64	600098	广州发展	37,600	208,680.00	0.45
65	002777	久远银海	13,710	205,650.00	0.44
66	002478	常宝股份	35,500	199,865.00	0.43
67	600888	新疆众和	24,400	199,836.00	0.43
68	688335	复洁环保	9,565	199,047.65	0.43
69	688138	清溢光电	10,863	197,706.60	0.43
70	002801	微光股份	7,900	195,999.00	0.42
71	688597	煜邦电力	12,734	191,519.36	0.41
72	600919	江苏银行	26,200	190,998.00	0.41
73	300129	泰胜风能	26,400	189,288.00	0.41
74	300916	朗特智能	4,400	189,200.00	0.41
75	300693	盛弘股份	3,400	184,552.00	0.40
76	600057	厦门象屿	17,900	183,833.00	0.40
77	603966	法兰泰克	16,100	182,735.00	0.39
78	688196	卓越新能	3,135	181,892.70	0.39
79	300358	楚天科技	11,800	174,050.00	0.37
80	688278	特宝生物	4,463	173,744.59	0.37
81	601898	中煤能源	18,800	162,056.00	0.35
82	688096	京源环保	13,340	161,013.80	0.35
83	688123	聚辰股份	1,562	158,074.40	0.34
84	300856	科思股份	2,800	146,020.00	0.31
85	688345	博力威	2,779	145,814.13	0.31

86	600582	天地科技	27,200	141,440.00	0.30
87	600064	南京高科	20,580	136,033.80	0.29
88	002422	科伦药业	5,000	133,050.00	0.29
89	603018	华设集团	16,700	126,586.00	0.27
90	300494	盛天网络	8,300	123,919.00	0.27
91	002824	和胜股份	4,000	118,080.00	0.25
92	600481	双良节能	8,900	115,166.00	0.25
93	688499	利元亨	723	113,785.74	0.24
94	600419	天润乳业	7,200	112,896.00	0.24
95	601108	财通证券	15,700	111,784.00	0.24
96	600073	上海梅林	13,800	109,710.00	0.24
97	600976	健民集团	2,200	109,318.00	0.24
98	301026	浩通科技	2,600	109,200.00	0.23
99	603506	南都物业	8,700	107,619.00	0.23
100	600741	华域汽车	6,200	107,446.00	0.23
101	000895	双汇发展	4,100	106,313.00	0.23
102	603898	好莱客	9,300	105,276.00	0.23
103	300861	美畅股份	2,140	105,202.40	0.23
104	600285	羚锐制药	7,400	96,496.00	0.21
105	300394	天孚通信	3,700	93,795.00	0.20
106	300696	爱乐达	3,420	90,732.60	0.20
107	002949	华阳国际	6,800	89,352.00	0.19
108	601965	中国汽研	4,400	85,272.00	0.18
109	300870	欧陆通	1,900	84,284.00	0.18
110	603712	七一二	2,400	83,808.00	0.18
111	300138	晨光生物	4,600	81,558.00	0.18
112	000733	振华科技	700	79,961.00	0.17
113	601995	中金公司	2,000	76,260.00	0.16
114	002847	盐津铺子	700	75,803.00	0.16
115	603667	五洲新春	5,600	74,536.00	0.16
116	603876	鼎胜新材	1,700	69,768.00	0.15

117	603968	醋化股份	3,100	67,363.00	0.14
118	600508	上海能源	4,600	65,918.00	0.14
119	603368	柳药集团	3,500	65,345.00	0.14
120	688006	杭可科技	1,487	65,085.99	0.14
121	603613	国联股份	735	65,003.40	0.14
122	600583	海油工程	10,700	64,842.00	0.14
123	002225	濮耐股份	15,900	61,215.00	0.13
124	300890	翔丰华	1,500	60,750.00	0.13
125	300811	铂科新材	700	60,529.00	0.13
126	002132	恒星科技	13,300	59,052.00	0.13
127	300447	全信股份	3,600	55,440.00	0.12
128	300873	海晨股份	2,020	54,843.00	0.12
129	600284	浦东建设	8,100	54,594.00	0.12
130	300231	银信科技	7,300	53,217.00	0.11
131	603527	众源新材	3,700	52,096.00	0.11
132	603019	中科曙光	2,300	50,922.00	0.11
133	688556	高测股份	658	49,363.16	0.11
134	300596	利安隆	900	49,113.00	0.11
135	600489	中金黄金	5,900	48,321.00	0.10
136	688350	富淼科技	2,938	48,300.72	0.10
137	603713	密尔克卫	400	46,664.00	0.10
138	000885	城发环境	4,903	46,431.41	0.10
139	300121	阳谷华泰	4,400	45,584.00	0.10
140	300791	仙乐健康	1,200	44,124.00	0.09
141	603871	嘉友国际	1,900	42,940.00	0.09
142	300833	浩洋股份	500	41,920.00	0.09
143	002946	新乳业	3,100	41,013.00	0.09
144	600229	城市传媒	5,800	41,006.00	0.09
145	688456	有研粉材	1,189	40,426.00	0.09
146	002073	软控股份	6,500	39,975.00	0.09
147	688166	博瑞医药	1,769	39,926.33	0.09

148	300130	新国都	3,300	39,831.00	0.09
149	003038	鑫铂股份	900	39,672.00	0.09
150	603233	大参林	1,000	39,600.00	0.09
151	002039	黔源电力	2,600	39,572.00	0.09
152	600368	五洲交通	10,500	39,480.00	0.08
153	600879	航天电子	5,800	39,440.00	0.08
154	300750	宁德时代	100	39,342.00	0.08
155	000519	中兵红箭	2,000	39,280.00	0.08
156	601857	中国石油	7,900	39,263.00	0.08
157	002111	威海广泰	3,900	38,883.00	0.08
158	002878	元隆雅图	2,500	38,850.00	0.08
159	000027	深圳能源	6,100	38,796.00	0.08
160	688239	航宇科技	499	38,767.31	0.08
161	002401	中远海科	3,500	38,500.00	0.08
162	603067	振华股份	3,000	38,490.00	0.08
163	600101	明星电力	4,500	38,250.00	0.08
164	605287	德才股份	1,700	38,063.00	0.08
165	300723	一品红	1,100	38,038.00	0.08
166	300601	康泰生物	1,200	37,836.00	0.08
167	300852	四会富仕	1,200	37,764.00	0.08
168	605168	三人行	424	37,723.28	0.08
169	603198	迎驾贡酒	600	37,668.00	0.08
170	600757	长江传媒	6,600	37,620.00	0.08
171	603535	嘉诚国际	2,100	37,527.00	0.08
172	300597	吉大通信	5,000	37,500.00	0.08
173	601872	招商轮船	6,700	37,453.00	0.08
174	002961	瑞达期货	2,800	37,324.00	0.08
175	002749	国光股份	4,200	37,254.00	0.08
176	002105	信隆健康	5,200	37,128.00	0.08
177	300298	三诺生物	1,100	37,103.00	0.08
178	002216	三全食品	2,000	37,020.00	0.08

179	002088	鲁阳节能	1,600	36,992.00	0.08
180	300630	普利制药	1,500	36,990.00	0.08
181	002049	紫光国微	280	36,909.60	0.08
182	300378	鼎捷软件	2,400	36,792.00	0.08
183	300363	博腾股份	900	36,765.00	0.08
184	600850	电科数字	1,830	36,746.40	0.08
185	603365	水星家纺	2,800	36,736.00	0.08
186	002705	新宝股份	2,200	36,630.00	0.08
187	600028	中国石化	8,400	36,624.00	0.08
188	603228	景旺电子	1,800	36,432.00	0.08
189	600618	氯碱化工	3,700	36,371.00	0.08
190	688378	奥来德	720	36,360.00	0.08
191	002180	纳思达	700	36,323.00	0.08
192	002899	英派斯	2,900	36,308.00	0.08
193	603755	日辰股份	900	36,243.00	0.08
194	300719	安达维尔	3,200	36,192.00	0.08
195	002412	汉森制药	5,900	36,167.00	0.08
196	603663	三祥新材	2,840	36,096.40	0.08
197	300826	测绘股份	3,200	36,000.00	0.08
198	688558	国盛智科	1,026	35,981.82	0.08
199	002410	广联达	600	35,970.00	0.08
200	002556	辉隆股份	4,100	35,875.00	0.08
201	603040	新坐标	2,100	35,868.00	0.08
202	300430	诚益通	3,100	35,836.00	0.08
203	300711	广哈通信	3,200	35,776.00	0.08
204	002449	国星光电	4,300	35,733.00	0.08
205	603369	今世缘	700	35,630.00	0.08
206	600557	康缘药业	1,900	35,625.00	0.08
207	600479	千金药业	3,700	35,520.00	0.08
208	000898	鞍钢股份	13,300	35,511.00	0.08
209	600210	紫江企业	7,100	35,500.00	0.08

210	002841	视源股份	600	35,424.00	0.08
211	688668	鼎通科技	536	35,376.00	0.08
211	002014	永新股份	4,400	35,376.00	0.08
213	003000	劲仔食品	3,000	35,370.00	0.08
214	601609	金田股份	5,200	35,152.00	0.08
215	605098	行动教育	1,200	35,136.00	0.08
215	300211	亿通科技	4,800	35,136.00	0.08
217	601101	昊华能源	5,680	35,102.40	0.08
218	000833	粤桂股份	5,200	35,048.00	0.08
219	000629	钒钛股份	7,400	35,002.00	0.08
220	300360	炬华科技	2,400	34,920.00	0.08
221	000762	西藏矿业	900	34,749.00	0.07
222	000830	鲁西化工	2,800	34,692.00	0.07
223	002518	科士达	600	34,560.00	0.07
224	600901	江苏金租	6,300	34,524.00	0.07
225	000989	九芝堂	3,900	34,359.00	0.07
226	301006	迈拓股份	2,200	34,342.00	0.07
227	688329	艾隆科技	900	34,299.00	0.07
228	000921	海信家电	2,600	34,242.00	0.07
229	688202	美迪西	160	34,222.40	0.07
230	600173	卧龙地产	6,600	34,188.00	0.07
231	300772	运达股份	2,296	34,141.52	0.07
232	601618	中国中冶	10,700	34,026.00	0.07
233	300955	嘉亨家化	1,400	33,964.00	0.07
234	600030	中信证券	1,700	33,847.00	0.07
235	688067	爱威科技	1,805	33,807.65	0.07
236	603129	春风动力	300	33,756.00	0.07
237	002056	横店东磁	1,800	33,732.00	0.07
238	002057	中钢天源	3,200	33,600.00	0.07
239	300232	洲明科技	6,100	33,489.00	0.07
240	002085	万丰奥威	5,600	33,320.00	0.07



241	688106	金宏气体	1,775	33,299.00	0.07
242	000661	长春高新	200	33,290.00	0.07
243	603192	汇得科技	1,470	33,207.30	0.07
244	300953	震裕科技	400	33,060.00	0.07
245	603317	天味食品	1,200	32,976.00	0.07
246	603586	金麒麟	2,500	32,950.00	0.07
247	600971	恒源煤电	4,600	32,936.00	0.07
248	002938	鹏鼎控股	1,200	32,928.00	0.07
249	601456	国联证券	2,900	32,625.00	0.07
250	002821	凯莱英	220	32,560.00	0.07
251	600067	冠城大通	10,500	32,550.00	0.07
251	002497	雅化集团	1,400	32,550.00	0.07
253	605398	新炬网络	1,160	32,538.00	0.07
254	600883	博闻科技	4,500	32,535.00	0.07
255	688008	澜起科技	517	32,364.20	0.07
256	601717	郑煤机	2,900	32,364.00	0.07
257	603668	天马科技	1,800	32,256.00	0.07
258	600600	青岛啤酒	300	32,250.00	0.07
259	000090	天健集团	5,900	32,214.00	0.07
260	600392	盛和资源	2,300	32,200.00	0.07
261	603600	永艺股份	3,300	32,175.00	0.07
262	688312	燕麦科技	2,073	32,152.23	0.07
263	300769	德方纳米	140	32,142.60	0.07
264	603529	爱玛科技	700	32,109.00	0.07
265	002304	洋河股份	200	32,100.00	0.07
266	300566	激智科技	1,200	32,040.00	0.07
267	600621	华鑫股份	3,100	32,023.00	0.07
268	601512	中新集团	4,000	31,960.00	0.07
269	002637	赞宇科技	2,600	31,928.00	0.07
270	603657	春光科技	2,000	31,840.00	0.07
271	603279	景津装备	1,080	31,838.40	0.07

272	300797	钢研纳克	2,100	31,752.00	0.07
273	600708	光明地产	12,900	31,734.00	0.07
274	002937	兴瑞科技	1,400	31,710.00	0.07
275	002889	东方嘉盛	1,400	31,668.00	0.07
275	002020	京新药业	2,600	31,668.00	0.07
277	300373	扬杰科技	600	31,560.00	0.07
278	603995	甬金股份	1,130	31,447.90	0.07
279	600926	杭州银行	2,400	31,392.00	0.07
280	002940	昂利康	1,160	31,389.60	0.07
281	600590	泰豪科技	5,400	31,374.00	0.07
282	000099	中信海直	4,300	31,304.00	0.07
283	603856	东宏股份	2,700	31,293.00	0.07
284	600997	开滦股份	4,600	31,188.00	0.07
285	688260	昀冢科技	2,242	31,186.22	0.07
286	600486	扬农化工	300	31,170.00	0.07
287	688596	正帆科技	915	31,064.25	0.07
288	688659	元琛科技	1,811	31,022.43	0.07
289	000960	锡业股份	2,200	31,020.00	0.07
290	688090	瑞松科技	1,266	30,890.40	0.07
291	601066	中信建投	1,300	30,875.00	0.07
292	300571	平治信息	1,100	30,800.00	0.07
293	002643	万润股份	2,100	30,786.00	0.07
294	000552	靖远煤电	9,800	30,772.00	0.07
295	600475	华光环能	3,500	30,765.00	0.07
296	002709	天赐材料	700	30,702.00	0.07
297	300692	中环环保	4,800	30,624.00	0.07
298	002091	江苏国泰	3,600	30,600.00	0.07
299	300593	新雷能	720	30,585.60	0.07
300	601088	中国神华	1,100	30,382.00	0.07
301	603267	鸿远电子	300	30,348.00	0.07
302	601615	明阳智能	1,200	30,312.00	0.07

303	603236	移远通信	300	30,246.00	0.07
304	002133	广宇集团	8,600	30,186.00	0.06
305	000767	晋控电力	8,900	30,171.00	0.06
306	300621	维业股份	3,800	30,096.00	0.06
307	688685	迈信林	1,300	30,082.00	0.06
308	000778	新兴铸管	8,200	29,930.00	0.06
309	601166	兴业银行	1,700	29,903.00	0.06
310	688199	久日新材	948	29,899.92	0.06
311	300709	精研科技	1,060	29,881.40	0.06
312	002973	侨银股份	2,800	29,848.00	0.06
313	000153	丰原药业	2,200	29,832.00	0.06
314	600036	招商银行	800	29,808.00	0.06
315	688314	康拓医疗	620	29,741.40	0.06
316	300656	民德电子	960	29,683.20	0.06
317	601137	博威合金	2,000	29,620.00	0.06
317	300305	裕兴股份	2,000	29,620.00	0.06
319	601012	隆基绿能	700	29,582.00	0.06
320	002262	恩华药业	1,200	29,460.00	0.06
321	002988	豪美新材	2,200	29,370.00	0.06
322	002833	弘亚数控	2,380	29,345.40	0.06
323	002997	瑞鹄模具	1,200	29,280.00	0.06
324	600297	广汇汽车	13,900	29,190.00	0.06
325	002965	祥鑫科技	500	29,105.00	0.06
326	300762	上海瀚讯	2,200	28,996.00	0.06
327	600969	郴电国际	3,900	28,938.00	0.06
328	688550	瑞联新材	620	28,898.20	0.06
329	300547	川环科技	2,000	28,880.00	0.06
330	603699	纽威股份	2,600	28,860.00	0.06
330	002916	深南电路	400	28,860.00	0.06
332	601881	中国银河	3,100	28,799.00	0.06
333	603086	先达股份	2,200	28,798.00	0.06

334	002968	新大正	1,320	28,762.80	0.06
335	603380	易德龙	1,100	28,754.00	0.06
336	002158	汉钟精机	1,200	28,740.00	0.06
337	688669	聚石化学	1,339	28,708.16	0.06
338	600642	申能股份	5,200	28,548.00	0.06
339	000541	佛山照明	5,800	28,536.00	0.06
340	603212	赛伍技术	900	28,530.00	0.06
341	002054	德美化工	3,800	28,500.00	0.06
342	688128	中国电研	1,657	28,301.56	0.06
343	688069	德林海	1,094	28,225.20	0.06
344	002368	太极股份	1,000	28,130.00	0.06
345	300556	丝路视觉	1,600	28,112.00	0.06
346	688330	宏力达	441	28,082.88	0.06
347	600459	贵研铂业	1,780	28,017.20	0.06
348	300218	安利股份	2,800	28,000.00	0.06
349	603579	荣泰健康	1,400	27,986.00	0.06
350	603277	银都股份	1,700	27,931.00	0.06
351	603128	华贸物流	2,600	27,924.00	0.06
352	002737	葵花药业	1,200	27,816.00	0.06
353	688680	海优新材	150	27,795.00	0.06
353	600309	万华化学	300	27,795.00	0.06
355	002807	江阴银行	7,000	27,790.00	0.06
356	601958	金钼股份	2,400	27,720.00	0.06
357	605006	山东玻纤	3,400	27,710.00	0.06
358	603938	三孚股份	800	27,600.00	0.06
359	300395	菲利华	500	27,500.00	0.06
360	000803	山高环能	2,400	27,288.00	0.06
361	002384	东山精密	1,100	27,203.00	0.06
362	002155	湖南黄金	2,100	27,195.00	0.06
363	603416	信捷电气	600	27,192.00	0.06
364	300947	德必集团	2,050	27,142.00	0.06

365	002623	亚玛顿	900	27,126.00	0.06
366	002985	北摩高科	600	27,060.00	0.06
367	300785	值得买	800	27,040.00	0.06
368	002315	焦点科技	1,500	27,015.00	0.06
369	000521	长虹美菱	6,400	26,944.00	0.06
370	603825	华扬联众	1,900	26,942.00	0.06
371	688367	工大高科	1,700	26,894.00	0.06
372	605158	华达新材	4,200	26,880.00	0.06
373	688181	八亿时空	733	26,827.80	0.06
374	601975	招商南油	6,800	26,792.00	0.06
375	002655	共达电声	2,400	26,784.00	0.06
376	300040	九洲集团	4,600	26,772.00	0.06
377	688233	神工股份	654	26,683.20	0.06
378	002738	中矿资源	400	26,664.00	0.06
379	002452	长高电新	4,300	26,660.00	0.06
380	600639	浦东金桥	2,400	26,640.00	0.06
381	605123	派克新材	200	26,580.00	0.06
382	688299	长阳科技	1,621	26,503.35	0.06
383	002947	恒铭达	1,340	26,465.00	0.06
384	002797	第一创业	4,700	26,461.00	0.06
385	688618	三旺通信	331	26,446.90	0.06
386	601985	中国核电	4,400	26,400.00	0.06
387	002129	TCL中环	700	26,362.00	0.06
388	600513	联环药业	2,800	26,292.00	0.06
389	002812	恩捷股份	200	26,258.00	0.06
390	600968	海油发展	9,100	26,208.00	0.06
391	688389	普门科技	1,466	26,138.78	0.06
392	300634	彩讯股份	1,700	25,925.00	0.06
393	002957	科瑞技术	1,700	25,721.00	0.06
394	300820	英杰电气	350	25,718.00	0.06
395	300881	盛德鑫泰	800	25,672.00	0.06

396	002276	万马股份	3,100	25,575.00	0.06
397	300629	新劲刚	1,000	25,560.00	0.05
398	603639	海利尔	1,000	25,540.00	0.05
399	002392	北京利尔	7,300	25,477.00	0.05
400	000933	神火股份	1,700	25,432.00	0.05
401	300316	晶盛机电	400	25,424.00	0.05
402	000060	中金岭南	6,200	25,420.00	0.05
403	688586	江航装备	1,555	25,346.50	0.05
404	603392	万泰生物	200	25,340.00	0.05
405	300416	苏试试验	840	25,326.00	0.05
406	002237	恒邦股份	2,400	25,296.00	0.05
407	600988	赤峰黄金	1,400	25,270.00	0.05
408	002459	晶澳科技	420	25,237.80	0.05
409	002765	蓝黛科技	2,800	25,172.00	0.05
410	603050	科林电气	1,600	25,168.00	0.05
411	603115	海星股份	1,600	25,104.00	0.05
412	002460	赣锋锂业	360	25,023.60	0.05
413	300573	兴齐眼药	200	25,016.00	0.05
414	600328	中盐化工	1,700	24,973.00	0.05
415	002396	星网锐捷	1,300	24,908.00	0.05
416	002332	仙琚制药	2,200	24,860.00	0.05
417	688100	威胜信息	1,076	24,844.84	0.05
418	300982	苏文电能	500	24,650.00	0.05
419	688687	凯因科技	1,083	24,638.25	0.05
420	002484	江海股份	1,100	24,607.00	0.05
421	688131	皓元医药	227	24,602.26	0.05
422	603093	南华期货	2,700	24,597.00	0.05
423	600863	内蒙华电	7,000	24,430.00	0.05
424	002913	奥士康	1,000	24,370.00	0.05
425	600425	青松建化	6,600	24,354.00	0.05
426	600089	特变电工	1,200	24,096.00	0.05

427	000719	中原传媒	3,000	24,090.00	0.05
428	601918	新集能源	5,700	23,883.00	0.05
429	603507	振江股份	800	23,848.00	0.05
430	600686	金龙汽车	4,000	23,800.00	0.05
431	002850	科达利	200	23,762.00	0.05
432	603901	永创智能	1,500	23,700.00	0.05
433	002466	天齐锂业	300	23,697.00	0.05
434	000888	峨眉山 A	2,500	23,675.00	0.05
435	000977	浪潮信息	1,100	23,672.00	0.05
436	605080	浙江自然	500	23,600.00	0.05
437	003004	声迅股份	900	23,589.00	0.05
438	603516	淳中科技	1,800	23,580.00	0.05
439	000553	安道麦A	2,600	23,530.00	0.05
440	603859	能科科技	900	23,517.00	0.05
441	688077	大地熊	472	23,434.80	0.05
442	688679	通源环境	2,166	23,414.46	0.05
443	600063	皖维高新	4,000	23,400.00	0.05
444	000729	燕京啤酒	2,200	23,364.00	0.05
445	601390	中国中铁	4,200	23,352.00	0.05
446	603728	鸣志电器	700	23,331.00	0.05
446	002254	泰和新材	1,100	23,331.00	0.05
448	002407	多氟多	700	23,324.00	0.05
449	600059	古越龙山	2,400	23,304.00	0.05
450	002318	久立特材	1,400	23,296.00	0.05
451	002627	三峡旅游	3,900	23,244.00	0.05
452	600426	华鲁恒升	700	23,205.00	0.05
453	688521	芯原股份	525	23,136.75	0.05
454	603589	口子窖	400	23,068.00	0.05
455	300401	花园生物	1,600	23,024.00	0.05
456	601838	成都银行	1,500	22,950.00	0.05
457	300354	东华测试	600	22,926.00	0.05

458	002845	同兴达	1,680	22,898.40	0.05
459	603556	海兴电力	1,300	22,880.00	0.05
460	300643	万通智控	1,600	22,752.00	0.05
461	600380	健康元	2,000	22,580.00	0.05
462	688059	华锐精密	140	22,540.00	0.05
463	688005	容百科技	327	22,481.25	0.05
464	601900	南方传媒	2,700	22,437.00	0.05
465	600873	梅花生物	2,200	22,396.00	0.05
466	600831	广电网络	3,800	22,344.00	0.05
467	688358	祥生医疗	649	22,325.60	0.05
468	300604	长川科技	500	22,290.00	0.05
469	002036	联创电子	1,800	22,266.00	0.05
470	601500	通用股份	6,000	22,200.00	0.05
471	688356	键凯科技	141	22,073.55	0.05
472	300409	道氏技术	1,500	22,035.00	0.05
473	300511	雪榕生物	3,400	21,930.00	0.05
474	601699	潞安环能	1,300	21,905.00	0.05
475	600295	鄂尔多斯	1,440	21,873.60	0.05
476	002687	乔治白	4,495	21,845.70	0.05
477	002876	三利谱	600	21,840.00	0.05
478	300474	景嘉微	400	21,828.00	0.05
479	002286	保龄宝	2,400	21,816.00	0.05
480	601677	明泰铝业	1,200	21,768.00	0.05
481	300699	光威复材	300	21,675.00	0.05
482	002788	鹭燕医药	2,600	21,658.00	0.05
483	002881	美格智能	810	21,651.30	0.05
484	600256	广汇能源	2,400	21,648.00	0.05
485	600929	雪天盐业	2,700	21,627.00	0.05
486	300695	兆丰股份	500	21,610.00	0.05
487	002120	韵达股份	1,500	21,570.00	0.05
488	002236	大华股份	1,900	21,489.00	0.05



489	300509	新美星	3,900	21,450.00	0.05
490	603489	八方股份	200	21,398.00	0.05
491	300481	濮阳惠成	800	21,384.00	0.05
492	300219	鸿利智汇	3,200	21,376.00	0.05
493	300815	玉禾田	1,400	21,322.00	0.05
494	301000	肇民科技	800	21,304.00	0.05
495	300196	长海股份	1,500	21,195.00	0.05
496	000869	张裕 A	700	21,168.00	0.05
497	688080	映翰通	515	21,156.20	0.05
498	601598	中国外运	5,500	21,120.00	0.05
499	600761	安徽合力	1,600	21,040.00	0.05
500	000156	华数传媒	2,800	20,972.00	0.05
501	300504	天邑股份	1,300	20,865.00	0.04
502	002179	中航光电	360	20,793.60	0.04
503	300703	创源股份	2,100	20,769.00	0.04
504	002851	麦格米特	800	20,768.00	0.04
505	300666	江丰电子	300	20,760.00	0.04
506	688707	振华新材	460	20,677.00	0.04
506	600846	同济科技	2,300	20,677.00	0.04
508	603043	广州酒家	800	20,656.00	0.04
509	603203	快克股份	700	20,643.00	0.04
510	600886	国投电力	1,900	20,577.00	0.04
511	601666	平煤股份	1,900	20,539.00	0.04
512	603986	兆易创新	200	20,494.00	0.04
513	002993	奥海科技	600	20,406.00	0.04
514	000913	钱江摩托	1,100	20,328.00	0.04
515	002728	特一药业	900	20,295.00	0.04
516	688013	天臣医疗	1,041	20,184.99	0.04
517	300260	新莱应材	300	20,130.00	0.04
517	002301	齐心集团	3,000	20,130.00	0.04
519	300389	艾比森	2,300	20,079.00	0.04

520	600795	国电电力	4,700	20,069.00	0.04
521	300496	中科创达	200	20,060.00	0.04
522	603599	广信股份	680	19,992.00	0.04
523	002212	天融信	2,000	19,980.00	0.04
524	002365	永安药业	1,900	19,950.00	0.04
525	603388	元成股份	2,300	19,941.00	0.04
526	688360	德马科技	805	19,794.95	0.04
527	600548	深高速	2,200	19,756.00	0.04
528	002206	海利得	3,300	19,701.00	0.04
529	300786	国林科技	1,280	19,699.20	0.04
530	002867	周大生	1,400	19,642.00	0.04
531	002790	瑞尔特	2,300	19,619.00	0.04
532	000301	东方盛虹	1,500	19,560.00	0.04
533	603585	苏利股份	1,100	19,503.00	0.04
534	002597	金禾实业	600	19,500.00	0.04
535	688099	晶晨股份	276	19,460.76	0.04
536	600386	北巴传媒	4,900	19,453.00	0.04
537	600692	亚通股份	3,300	19,437.00	0.04
538	002953	日丰股份	1,350	19,264.50	0.04
539	600372	中航电子	1,200	19,164.00	0.04
540	300835	龙磁科技	530	19,080.00	0.04
541	600566	济川药业	700	19,054.00	0.04
542	002896	中大力德	840	18,992.40	0.04
543	600458	时代新材	2,100	18,942.00	0.04
544	688118	普元信息	1,065	18,839.85	0.04
545	600066	宇通客车	2,500	18,775.00	0.04
546	601238	广汽集团	1,700	18,751.00	0.04
547	600497	驰宏锌锗	3,700	18,722.00	0.04
548	002787	华源控股	3,100	18,693.00	0.04
549	600123	兰花科创	1,400	18,676.00	0.04
550	000880	潍柴重机	2,000	18,660.00	0.04

551	002128	电投能源	1,500	18,510.00	0.04
552	601138	工业富联	2,000	18,360.00	0.04
553	688092	爱科科技	788	18,297.36	0.04
554	600837	海通证券	2,100	18,249.00	0.04
555	002203	海亮股份	1,600	18,080.00	0.04
556	002034	旺能环境	1,000	18,040.00	0.04
557	688087	英科再生	507	17,618.25	0.04
558	000753	漳州发展	4,400	17,556.00	0.04
559	600765	中航重机	560	17,410.40	0.04
560	603305	旭升集团	540	17,409.60	0.04
561	600546	山煤国际	1,200	17,388.00	0.04
562	600219	南山铝业	5,300	17,331.00	0.04
563	688004	博汇科技	836	17,321.92	0.04
564	002648	卫星化学	1,103	17,096.50	0.04
565	300759	康龙化成	250	17,000.00	0.04
566	600188	兖矿能源	500	16,790.00	0.04
567	002978	安宁股份	500	16,680.00	0.04
568	300327	中颖电子	470	16,623.90	0.04
569	688200	华峰测控	60	16,588.20	0.04
570	603799	华友钴业	290	16,132.70	0.03
571	600116	三峡水利	1,856	15,905.92	0.03
572	603386	骏亚科技	1,540	15,754.20	0.03
573	002825	纳尔股份	1,320	15,734.40	0.03
574	688636	智明达	149	15,722.48	0.03
575	300636	同和药业	1,050	15,550.50	0.03
576	002436	兴森科技	1,600	15,488.00	0.03
577	603319	湘油泵	1,030	15,377.90	0.03
578	688590	新致软件	1,603	15,356.74	0.03
579	603693	江苏新能	1,170	15,128.10	0.03
580	300681	英搏尔	370	14,655.70	0.03
581	002839	张家港行	3,160	14,567.60	0.03

582	002001	新和成	760	14,250.00	0.03
583	002009	天奇股份	1,000	14,160.00	0.03
584	603926	铁流股份	1,560	14,133.60	0.03
585	300613	富瀚微	270	13,535.10	0.03
586	000498	山东路桥	1,765	12,125.55	0.03
587	600596	新安股份	780	11,809.20	0.03
588	603738	泰晶科技	580	11,762.40	0.03
589	002810	山东赫达	500	11,210.00	0.02
590	688516	奥特维	39	7,839.00	0.02
591	300181	佐力药业	700	7,469.00	0.02
592	605003	众望布艺	300	5,331.00	0.01
593	603822	嘉澳环保	100	3,422.00	0.01
594	600096	云天化	100	2,104.00	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	000906	浙商中拓	2,113,557.00	4.55
2	601166	兴业银行	1,877,223.00	4.04
3	003019	宸展光电	1,727,939.00	3.72
4	601009	南京银行	1,703,472.00	3.66
5	600123	兰花科创	1,649,943.00	3.55
6	002020	京新药业	1,600,748.00	3.44
7	002988	豪美新材	1,587,555.00	3.41
8	600919	江苏银行	1,584,965.00	3.41
9	600089	特变电工	1,583,207.00	3.40
10	003020	立方制药	1,559,542.00	3.35
11	688658	悦康药业	1,554,966.40	3.34
12	300696	爱乐达	1,545,204.58	3.32

13	300059	东方财富	1,522,471.00	3.27
14	600285	羚锐制药	1,450,192.70	3.12
15	300772	运达股份	1,435,539.72	3.09
16	600030	中信证券	1,394,512.00	3.00
17	603300	华铁应急	1,375,902.00	2.96
18	300514	友讯达	1,368,547.00	2.94
19	002929	润建股份	1,363,489.00	2.93
20	601898	中煤能源	1,341,713.00	2.89
21	603115	海星股份	1,302,820.00	2.80
22	300775	三角防务	1,299,138.00	2.79
23	688687	凯因科技	1,294,542.06	2.78
24	603995	甬金股份	1,254,587.00	2.70
25	000915	华特达因	1,254,336.00	2.70
26	002955	鸿合科技	1,230,335.00	2.65
27	300777	中简科技	1,227,985.00	2.64
28	300453	三鑫医疗	1,227,016.00	2.64
29	002129	TCL中环	1,212,991.00	2.61
30	688589	力合微	1,187,375.68	2.55
31	601666	平煤股份	1,185,381.00	2.55
32	601985	中国核电	1,184,427.00	2.55
33	000778	新兴铸管	1,175,313.00	2.53
34	002709	天赐材料	1,161,037.00	2.50
35	603579	荣泰健康	1,160,068.00	2.49
36	603681	永冠新材	1,128,415.00	2.43
37	300593	新雷能	1,127,408.00	2.42
38	002801	微光股份	1,127,361.00	2.42
39	002850	科达利	1,126,640.00	2.42
40	605266	健之佳	1,113,910.00	2.40
41	603890	春秋电子	1,113,392.00	2.39
42	002648	卫星化学	1,113,146.47	2.39
43	688278	特宝生物	1,101,161.99	2.37

44	600985	淮北矿业	1,087,124.00	2.34
45	300138	晨光生物	1,078,144.00	2.32
46	002237	恒邦股份	1,075,983.00	2.31
47	605088	冠盛股份	1,074,692.00	2.31
48	002661	克明食品	1,064,080.00	2.29
49	000733	振华科技	1,063,774.00	2.29
50	603018	华设集团	1,059,750.00	2.28
51	002649	博彦科技	1,051,664.00	2.26
52	000833	粤桂股份	1,050,127.00	2.26
53	603506	南都物业	1,047,706.00	2.25
54	002768	国恩股份	1,038,112.00	2.23
55	603267	鸿远电子	1,032,321.00	2.22
56	688559	海目星	1,029,933.68	2.21
57	300121	阳谷华泰	1,026,216.00	2.21
58	002876	三利谱	1,021,267.00	2.20
59	000975	银泰黄金	1,018,628.00	2.19
60	688181	八亿时空	1,014,311.90	2.18
61	688360	德马科技	1,012,658.91	2.18
62	601609	金田股份	1,001,346.00	2.15
63	688586	江航装备	995,771.84	2.14
64	300244	迪安诊断	991,619.00	2.13
65	600188	兖矿能源	991,590.00	2.13
66	002039	黔源电力	983,681.00	2.12
67	600438	通威股份	980,660.00	2.11
68	600926	杭州银行	974,412.00	2.10
69	300630	普利制药	973,221.00	2.09
70	688556	高测股份	966,091.05	2.08
71	600489	中金黄金	954,333.00	2.05
72	002276	万马股份	952,441.00	2.05
73	300231	银信科技	949,075.00	2.04
74	603712	七一二	943,533.00	2.03

75	003033	征和工业	936,903.00	2.01
76	600256	广汇能源	935,284.00	2.01
77	300705	九典制药	930,482.00	2.00

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

2、“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 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	601166	兴业银行	1,763,341.00	3.79
2	600089	特变电工	1,650,510.00	3.55
3	002020	京新药业	1,649,658.28	3.55
4	002988	豪美新材	1,553,000.00	3.34
5	600123	兰花科创	1,547,568.00	3.33
6	000906	浙商中拓	1,541,151.00	3.31
7	003019	宸展光电	1,534,521.50	3.30
8	300772	运达股份	1,432,938.00	3.08
9	300696	爱乐达	1,374,423.00	2.96
10	600919	江苏银行	1,360,262.00	2.93
11	688687	凯因科技	1,331,356.36	2.86
12	600030	中信证券	1,317,093.00	2.83
13	300593	新雷能	1,316,601.00	2.83
14	600285	羚锐制药	1,307,120.00	2.81
15	300059	东方财富	1,254,261.00	2.70
16	601666	平煤股份	1,233,897.00	2.65
17	002709	天赐材料	1,223,893.00	2.63
18	002129	TCL中环	1,210,378.00	2.60
19	688556	高测股份	1,208,134.12	2.60
20	603115	海星股份	1,195,452.00	2.57

21	688658	悦康药业	1,188,746.52	2.56
22	002648	卫星化学	1,117,032.00	2.40
23	601985	中国核电	1,112,566.00	2.39
24	601898	中煤能源	1,099,269.00	2.36
25	603995	甬金股份	1,086,390.00	2.34
26	000778	新兴铸管	1,076,766.00	2.32
27	603579	荣泰健康	1,076,591.00	2.32
28	000915	华特达因	1,067,202.00	2.30
29	688278	特宝生物	1,052,730.33	2.26
30	600929	雪天盐业	1,049,022.00	2.26
31	300138	晨光生物	1,042,460.00	2.24
32	002237	恒邦股份	1,038,529.00	2.23
33	003020	立方制药	1,034,289.00	2.22
34	600188	兖矿能源	1,034,036.00	2.22
35	002955	鸿合科技	1,026,491.00	2.21
36	688360	德马科技	1,019,128.16	2.19
37	600873	梅花生物	1,015,410.00	2.18
38	300630	普利制药	1,010,484.00	2.17
39	002276	万马股份	1,006,766.00	2.17
40	002738	中矿资源	1,005,345.00	2.16
41	002039	黔源电力	1,005,263.00	2.16
42	601009	南京银行	1,004,324.00	2.16
43	603267	鸿远电子	1,002,431.00	2.16
44	300121	阳谷华泰	994,628.00	2.14
45	300514	友讯达	987,303.00	2.12
46	000833	粤桂股份	978,839.00	2.11
47	603018	华设集团	977,213.00	2.10
48	002876	三利谱	973,339.00	2.09
49	000733	振华科技	968,613.00	2.08
50	002801	微光股份	967,204.00	2.08
51	002850	科达利	966,654.00	2.08



52	601609	金田股份	964,514.00	2.07
53	605123	派克新材	964,229.00	2.07
54	600926	杭州银行	957,097.00	2.06
55	300775	三角防务	955,102.52	2.05
56	688586	江航装备	939,766.72	2.02
57	605266	健之佳	935,292.00	2.01
58	002262	恩华药业	934,184.00	2.01

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

2、“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 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	311,051,290.74
卖出股票收入（成交）总额	267,908,633.60

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

2、“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	2,698,489.60	5.80
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-

7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,698,489.60	5.80

### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019666	22国债01	23,190	2,365,866.04	5.09
2	010303	03国债(3)	1,970	199,143.25	0.43
3	019629	20国债03	1,310	133,480.31	0.29
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

### 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

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

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

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 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中，本期未出现被监管部门立案调查的情形；南京银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情

况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

### 8.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,298.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,298.89

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## §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
东兴宸祥量化混合A	285	136,436.84	24,382,445.95	62.70%	14,502,053.43	37.30%

东兴宸祥量化混合C	155	52,913.57	0.00	0.00%	8,201,603.68	100.00%
合计	440	107,013.87	24,382,445.95	51.78%	22,703,657.11	48.22%

### 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	东兴宸祥量化混合A	0.99	0.00%
	东兴宸祥量化混合C	4,785.75	0.06%
	合计	4,786.74	0.01%

### 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	东兴宸祥量化混合A	0
	东兴宸祥量化混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放 式基金	东兴宸祥量化混合A	0
	东兴宸祥量化混合C	0
	合计	0

### §10 开放式基金份额变动

单位：份

	东兴宸祥量化混合A	东兴宸祥量化混合C
基金合同生效日(2022年01月28日)基金份额总额	84,044,614.48	148,850,405.53
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	13,588,746.02	3,982,416.15
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	58,748,861.12	144,631,218.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	38,884,499.38	8,201,603.68

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 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

本基金管理人督察长王微于2022年3月16日离任，同日起由董事长银国宏代任督察长；本基金管理人财务负责人于2022年11月25日由王青变更为郝洁；本基金管理人董事长银国宏于2022年12月29日离任，同日起牛南洁任董事长；2022年12月29日，李宛霖任本基金管理人督察长。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未更换会计师事务所。本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用19,000.00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

措施1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	东兴基金管理有限公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2022-11-24
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局
受到的具体措施类型	被采取责令改正的行政监管措施
受到稽查或处罚等措施的原因	因董事长代行合规负责人职务时间超过6个月，相关情况违反了《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》、《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的有关规定，北京证监局决定对公司采取责令改

	正的行政监管措施，要求公司在30天内聘任符合条件的人员担任合规负责人，并向北京证监局备案。
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	针对监管函中的问题，公司已实质进行了整改，并于11月25日向北京证监局报送了《关于东兴基金管理有限公司督察长任职的备案报告》。
其他	无

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 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	
长江证券股份有限公司	2	578,959,924.34	100.00%	446,191.79	100.00%	-
东方财富证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

注：1、此处的佣金指本基金通过券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

#### 2、交易单元的选择标准和程序

券商选择标准：财务状况良好、经营行为规范、研究实力较强的证券公司。其中财务状况良好、经营行为规范以最近一年证券公司分类评介在C类或C类以上，且近一年内无重大违法违规事件为主要判断依据。研究实力较强以公司的评价意见为主要判断依据。

券商选择程序：①对符合选择标准的券商的服务进行评价；②拟定租用对象：由投研部门根据以上评价结果拟定备选的券商；③签约：拟定备选的券商后，按公司签约程序与备选券商签约。签约时，要明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等。

3、本基金本报告期内新增租用4个交易单元，分别为长江证券股份有限公司上海交

易所交易单元及深圳交易所交易单元、东方财富证券股份有限公司上海交易所交易单元及深圳交易所交易单元。

### 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
长江证券股份有限公司	31,145,072.67	100.00%	527,868,000.00	100.00%	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-

### 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	关于东兴宸祥量化混合型证券投资基金提前结束募集的公告	指定报刊、指定网站	2022-01-25
2	东兴宸祥量化混合型证券投资基金基金合同生效公告	指定报刊、指定网站	2022-01-29
3	东兴宸祥量化混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资业务的公告	指定报刊、指定网站	2022-02-22
4	东兴基金管理有限公司高级管理人员变更公告	指定报刊、指定网站	2022-03-17
5	东兴宸祥量化混合型证券投资基金2022年第一季度报告	指定网站	2022-04-22
6	东兴基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的停牌股票估值调整的提示性公告	指定报刊、指定网站	2022-06-03
7	东兴宸祥量化混合型证券投资基金半年度最后一个市场交易日净值公告	指定网站	2022-07-01
8	东兴宸祥量化混合型证券投资基金2022年第2季度报告	指定网站	2022-07-21
9	关于增加上海中正达广基金销售有限公司为东兴基金管理有限公司公开募集证券投资基金的销售机构的公告	指定网站	2022-07-25
10	东兴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通转换业务的公告	指定网站	2022-08-02

11	东兴宸祥量化混合型证券投资基金2022年中期报告	指定网站	2022-08-31
12	东兴宸祥量化混合型证券投资基金2022年第3季度报告	指定网站	2022-10-26
13	东兴基金管理有限公司高级管理人员变更公告	指定报刊、指定网站	2022-11-26
14	东兴基金管理有限公司高级管理人员变更公告	指定报刊、指定网站	2022-12-30
15	东兴基金管理有限公司关于董事长变更的公告	指定报刊、指定网站	2022-12-30

## §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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2022年3月24日至2022年12月31日	14,999,000.00	-	-	14,999,000.00	31.85%

#### 产品特有风险

1、本基金为混合型基金，基金资产主要投资于股票市场与债券市场，因此股市、债市的变化将影响到基金业绩表现。在调整资产配置比例时，不能完全抵御市场整体下跌风险，基金净值表现因此可能受到影响。本基金管理人将发挥专业研究优势，加强对市场、上市公司基本面和固定收益类产品的深入研究，持续优化组合配置，以控制特定风险。此外，由于本基金还可以投资其他品种，这些品种的价格也可能因市场中的各类变化而出现一定幅度的波动，产生特定的风险，并影响到整体基金的投资收益。

2、本基金可投资国债期货，可能引发如下风险：国债期货交易采用保证金交易方式，基金资产可能由于无法及时筹措资金满足建立或者维持国债期货头寸所要求的保证金而面临保证金风险。同时，该潜在损失可能成倍放大，具有杠杆性风险。另外，期货在对冲市场风险的使用过程中，基金资产可能因为国债期货合约与合约标的价格波动不一致而面临基差风险。

3、本基金可投资股指期货，股指期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，指数微小的变动就可能使投资人权益遭受较大损失。股指期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来重大损失。

4、本基金可投资于在全国银行间债券市场或证券交易所交易的资产支持证券，基金管理人将本着谨慎和控制风险的原则进行资产支持证券投资，但由于资产支持证券具有一定的信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿还风险等风险，可能导致包括基金净值波动在内的各项风险。

5、本基金投资股票期权，可能引发如下风险：股票期权作为一种金融衍生品，具备一些特有的风险点。投资股票期权所面临的主要风险是衍生品价格波动带来的市场风险；衍生品基础资产交易量大于市场可报价的交易量而产生的流动性风险；衍生品合约价格和标的指数价格之间的价格差的波动而造成基差风险；无法及时筹措资金满足建立或者维持衍生品合约头寸所要求的保证金而带来的保证金风险；交易对手不愿或无法



履行契约而产生的信用风险以及各类操作风险。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 一、中国证监会核准东兴宸祥量化混合型证券投资基金募集的文件
- 二、《东兴宸祥量化混合型证券投资基金基金合同》
- 三、《东兴宸祥量化混合型证券投资基金托管协议》
- 四、《东兴宸祥量化混合型证券投资基金招募说明书》
- 五、中国证监会颁发的经营证券期货业务许可证、营业执照、公司章程

### 13.2 存放地点

北京市西城区平安里西大街28号中海国际中心6层

### 13.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（[www.dxamc.cn](http://www.dxamc.cn)）查阅。

东兴基金管理有限公司  
二〇二三年三月三十一日