

# 兴银中证 500 指数增强型证券投资基金

## 2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:兴银基金管理有限责任公司

基金托管人:浙商银行股份有限公司

报告送出日期:2023 年 08 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年8月29日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年1月1日起至6月30日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	9
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	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.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产(基金净值)变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	58
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	58
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	58
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	58

---

7.12 投资组合报告附注.....	58
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>59</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	60
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	60
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>60</b>
<b>§ 10 重大事件揭示.....</b>	<b>60</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	60
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	61
10.4 基金投资策略的改变.....	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	61
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	61
10.8 其他重大事件.....	62
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>63</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	63
<b>§ 12 备查文件目录.....</b>	<b>63</b>
12.1 备查文件目录.....	63
12.2 存放地点.....	63
12.3 查阅方式.....	63

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	兴银中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	兴银中证 500 指数增强	
基金主代码	010253	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 03 月 01 日	
基金管理人	兴银基金管理有限责任公司	
基金托管人	浙商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	101,067,235.04 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	兴银中证 500 指数增强 A	兴银中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	010253	011205
报告期末下属分级基金的份额总额	33,223,484.25 份	67,843,750.79 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型指数基金，在力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年化跟踪误差不超过 7.75%的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力求实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。	
投资策略	本基金为指数增强型股票基金，采取定量方法进行组合管理，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.75%的基础上，追求获得超越标的指数的回报。本基金主要投资于中证 500 指数的成份股及备选成份股，为了获得超越指数的投资回报，可以在被动跟踪指数的基础上进行一些优化调整，如在一定幅度内减少或增强成份股的权重、替换或者增加一些非成份股。	
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%	
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数类似的风险收益特征。	
下属分级基金的风险收益特征	风险收益特征同上。	风险收益特征同上。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		兴银基金管理有限责任公司	浙商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郑瑞健	朱巍
	联系电话	86-21-20296277	0571-87659806
	电子邮箱	zhengrj@hffunds.cn	zhuwei@czbank.com
客户服务电话		40000-96326	95527
传真		86-21-68630069	0571-88268688
注册地址		平潭综合实验区金井湾商务营运中心 6 号楼 11 层 03-3 房	浙江省杭州市萧山区鸿宁路 1788 号
办公地址		中国上海市浦东新区滨江大道 5129 号陆家嘴滨江中心 N1 幢三层、五层	杭州市拱墅区环城西路 76 号
邮政编码		200120	310006
法定代表人		吴若曼	陆建强

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.hffunds.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人办公场所

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2023 年 01 月 01 日-2023 年 06 月 30 日）	
	兴银中证 500 指数增强 A	兴银中证 500 指数增强 C
本期已实现收益	-188,295.25	-452,320.57
本期利润	681,354.82	1,420,123.86
加权平均基金份额本期利润	0.0199	0.0201
本期加权平均净值利润率	2.09%	2.13%
本期基金份额净值增长率	2.11%	2.02%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2023 年 06 月 30 日）	

期末可供分配利润	-2,291,207.07	-5,007,564.73
期末可供分配基金份额利润	-0.0690	-0.0738
期末基金资产净值	30,932,277.18	62,836,186.06
期末基金份额净值	0.9310	0.9262
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末（2023 年 06 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	-6.90%	-7.38%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额），即如果期末未分配利润（报表数，下同）的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

#### 兴银中证 500 指数增强 A 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.54%	0.85%	-0.77%	0.89%	1.31%	-0.04%
过去三个月	-2.81%	0.72%	-5.10%	0.78%	2.29%	-0.06%
过去六个月	2.11%	0.71%	2.20%	0.75%	-0.09%	-0.04%
过去一年	-9.43%	0.90%	-6.65%	0.91%	-2.78%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-6.90%	1.10%	-5.26%	1.07%	-1.64%	0.03%

#### 兴银中证 500 指数增强 C 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.52%	0.85%	-0.77%	0.89%	1.29%	-0.04%
过去三个月	-2.84%	0.72%	-5.10%	0.78%	2.26%	-0.06%
过去六个月	2.02%	0.71%	2.20%	0.75%	-0.18%	-0.04%

过去一年	-9.60%	0.90%	-6.65%	0.91%	-2.95%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-7.38%	1.10%	-5.26%	1.07%	-2.12%	0.03%

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

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

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  
(2021年03月01日-2023年06月30日)



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年03月01日-2023年06月30日)



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



率(税后)\*5%。

### 3.3 其他指标

注：无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

合型证券投资基金、兴银中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、兴银合泰债券型证券投资基金、兴银稳惠 180 天持有期混合型证券投资基金、兴银稳建 90 天持有期中短债债券型证券投资基金)，净值总规模超 800 亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（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	2021-03-01	2023-02-24	12 年	硕士研究生，具有基金从业资格。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，现任指数与量化投资部基金经理。
林学晨	本基金的基金经理	2021-07-16	-	9 年	硕士研究生，特许金融分析师（CFA），具有基金从业资格。曾任湘财证券研究所金融工程分析师。2015 年 7 月加入兴银基金管理有限责任公司，历任中央交易室衍生品交易员、衍生品业务部投资经理助理、投资经理；现任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。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴银中证 500 指数增强 A 基金份额净值为 0.9310 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 2.11%，同期业绩比较基准收益率为 2.20%；截至报告期末兴银中证 500 指数增强 C 基金份额净值为 0.9262 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 2.02%，同期业绩比较基准收益率为 2.20%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

根据证监会的相关规定，本公司为建立健全有效的估值政策和程序，成立估值小组，明确参与

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

#### 2、基金经理参与或决定估值的程度

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

3、本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

4、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息

无。

### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行利润分配，符合法律法规的规定及《基金合同》的约定。

本报告期本基金没有应分配但尚未分配的利润。

### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——兴银基金管理有限责任公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对兴银基金管理有限责任公司编制和披露的兴银中证 500 指数增强型证券投资基金 2023 年中期报告中财务指标、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复核，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：兴银中证 500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	7,098,651.77	9,211,826.00
结算备付金		2,302,170.26	4,743,451.77
存出保证金		479,842.45	1,398,548.44
交易性金融资产	6.4.7.2	84,327,937.60	83,057,935.12
其中：股票投资		84,327,937.60	83,057,935.12
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
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		84,194.75	44,560.04
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		94,292,796.83	98,456,321.37
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 06 月 30 日</b>	<b>上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		2,393.88	864.00
应付赎回款		135,817.90	76,753.96
应付管理人报酬		61,691.18	68,639.95
应付托管费		15,422.77	17,160.00
应付销售服务费		10,346.02	11,537.38
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	6.4.7.6	298,661.84	383,754.46
负债合计		524,333.59	558,709.75
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	101,067,235.04	107,675,480.76
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-7,298,771.80	-9,777,869.14
净资产合计		93,768,463.24	97,897,611.62
负债和净资产总计		94,292,796.83	98,456,321.37

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 101,067,235.04 份。其中兴银中证 500 指数增强 A 基金份额净值 0.9310 元，基金份额总额 33,223,484.25 份；兴银中证 500 指数增强 C 基金份额净值 0.9262 元，基金份额总额 67,843,750.79 份。

## 6.2 利润表

会计主体：兴银中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
一、营业总收入		2,819,490.59	-36,649,217.26

1. 利息收入		26,063.77	73,246.17
其中：存款利息收入	6.4.7.9	26,063.77	72,426.99
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	819.18
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		43,003.95	-43,296,231.47
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-1,290,517.61	-41,149,320.23
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	254,574.88	-3,470,991.17
股利收益	6.4.7.15	1,078,946.68	1,324,079.93
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）	6.4.7.16	2,742,094.50	6,520,736.19
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	8,328.37	53,031.85
<b>减：二、营业总支出</b>		718,011.91	1,376,416.62
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	394,090.65	825,127.75
2. 托管费	6.4.10.2.2	98,522.63	206,281.96
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	66,241.40	163,927.96
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		1,325.65	-
8. 其他费用	6.4.7.18	157,831.58	181,078.95
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		2,101,478.68	-38,025,633.88
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		2,101,478.68	-38,025,633.88
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	0
<b>六、综合收益总额</b>		2,101,478.68	-38,025,633.88

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：兴银中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	107,675,480.76	-	-9,777,869.14	97,897,611.62
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）	107,675,480.76	-	-9,777,869.14	97,897,611.62
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-6,608,245.72	-	2,479,097.34	-4,129,148.38
（一）、综合收益总额	-	-	2,101,478.68	2,101,478.68
（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）	-6,608,245.72	-	377,618.66	-6,230,627.06
其中：1. 基金申购款	13,827,310.81	-	-713,906.14	13,113,404.67
2. 基金赎回款	-20,435,556.53	-	1,091,524.80	-19,344,031.73
（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）	101,067,235.04	-	-7,298,771.80	93,768,463.24
项目	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	241,135,840.82	-	37,557,416.06	278,693,256.88
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	241,135,840.82	-	37,557,416.06	278,693,256.88
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-	-	-
	101,158,522.92		33,993,751.95	135,152,274.87



(一)、综合收益总额	-	-	-	-38,025,633.88
			38,025,633.88	
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	101,158,522.92	-	4,031,881.93	-97,126,640.99
其中: 1. 基金申购款	32,433,292.91	-	607,941.23	33,041,234.14
2. 基金赎回款	133,591,815.83	-	3,423,940.70	-
				130,167,875.13
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	139,977,317.90	-	3,563,664.11	143,540,982.01

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

赵建兴	刘钊	崔可
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

兴银中证 500 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会证监许可(2020)3444 号注册募集。《兴银中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2021 年 3 月 1 日生效。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集规模为 264,037,562.28 份基金份额。本基金的基金管理人为兴银基金管理有限责任公司,基金托管人为浙商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》相关规定以及《兴银中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》等法律文件约定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,以标的指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于其他股票(非标的指数成份股及其备选成份股,含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、银行存款、债券(包括国债、中央银行票据、地方政府债、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债、企业债、公司债、超短期融资券、短期融资券、中期票据、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券)、债券回购、股指期货、股票期权、资产支持证券、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金管理人根据相关法律法规可以参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当

程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终，在扣除股指期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 6 月 30 日的财务状况、2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通

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

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

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

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

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

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

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

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人

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

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

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日
活期存款	7,098,651.77
等于：本金	7,098,234.72
加：应计利息	417.05
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	7,098,651.77

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	84,295,939.44	-	84,327,937.60	31,998.16

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	84,295,939.44	-	84,327,937.60	31,998.16

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	3,651,480.00	0.00	-	-
—股指期货	3,651,480.00	0.00	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,651,480.00	-	-	-

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。

##### 6.4.7.3.2 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
IC2309	IC2309	3	3,582,000.00	-69,480.00
合计				-69,480.00
减：可抵销期货暂收款				-69,480.00
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。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

注：本基金本报告期末持有其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 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	140,890.26
其中：交易所市场	140,890.26
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	57,771.58
应付指数使用费	100,000.00
合计	298,661.84

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 兴银中证 500 指数增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	34,892,385.20	34,892,385.20
本期申购	2,449,839.82	2,449,839.82
本期赎回（以“-”号填列）	-4,118,740.77	-4,118,740.77
本期末	33,223,484.25	33,223,484.25

##### 兴银中证 500 指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	72,783,095.56	72,783,095.56
本期申购	11,377,470.99	11,377,470.99
本期赎回（以“-”号填列）	-16,316,815.76	-16,316,815.76
本期末	67,843,750.79	67,843,750.79

## 6.4.7.8 未分配利润

## 兴银中证 500 指数增强 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,653,645.45	-1,424,185.06	- 3,077,830.51
本期利润	-188,295.25	869,650.07	681,354.82
本期基金份额交易产生的变动数	52,996.34	52,272.28	105,268.62
其中：基金申购款	-75,005.98	-31,740.01	-106,745.99
基金赎回款	128,002.32	84,012.29	212,014.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,788,944.36	-502,262.71	- 2,291,207.07

## 兴银中证 500 指数增强 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-3,740,450.57	-2,959,588.06	- 6,700,038.63
本期利润	-452,320.57	1,872,444.43	1,420,123.86
本期基金份额交易产生的变动数	207,894.00	64,456.04	272,350.04
其中：基金申购款	-402,587.21	-204,572.94	-607,160.15
基金赎回款	610,481.21	269,028.98	879,510.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,984,877.14	-1,022,687.59	- 5,007,564.73

## 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	12,048.10
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	13,471.40
其他	544.27
合计	26,063.77

注：其他为存出保证金利息收入。

## 6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	730,425,500.18
减：卖出股票成本总额	730,543,029.87
减：交易费用	1,172,987.92
买卖股票差价收入	-1,290,517.61

**6.4.7.11 债券投资收益**

注：本基金本报告期无债券投资收益。

**6.4.7.12 资产支持证券投资收益**

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.13 贵金属投资收益**

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.14 衍生工具收益****6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

**6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益**

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
股指期货投资收益	271,300.00
减：其他衍生工具收益应缴纳增值税	13,256.51
减：交易费用	3,468.61
合计	254,574.88

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,078,946.68
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	1,078,946.68

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元



项目名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	2,661,514.50
——股票投资	2,661,514.50
——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	80,580.00
——权证投资	-
——期货投资	80,580.00
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	2,742,094.50

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	8,321.85
转换费收入	6.52
合计	8,328.37

#### 6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
审计费用	18,100.00
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
指数使用费	100,000.00
银行汇划费	60.00
合计	157,831.58

#### 6.4.7.19 分部报告

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

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

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期末不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：本基金与关联方的所有交易均是在正常业务中按照一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华福证券	266,974,048.58	18.29%	1,773,414,134.07	39.71%

###### 6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

注：本基金本报告期及上年可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的	成交金额	占当期债券回购成交总额的

		比例		比例
华福证券	-	-	10,000,000.00	100.00%

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华福证券	61,751.00	18.86%	61,751.00	43.83%
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华福证券	410,212.91	39.71%	0.00	0.00%

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

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

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	394,090.65	825,127.75
其中：支付销售机构的客户维护费	172,653.33	244,854.41

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	98,522.63	206,281.96

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

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴银中证 500 指数增强 A	兴银中证 500 指数增强 C	合计
华福证券	-	1,766.42	1,766.42
兴银基金	-	0.55	0.55
浙商银行	-	3,110.92	3,110.92
合计	-	4,877.89	4,877.89
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴银中证 500 指数增强 A	兴银中证 500 指数增强 C	合计
华福证券	-	1,761.59	1,761.59
兴银基金	-	60,911.75	60,911.75
浙商银行	-	3,689.95	3,689.95
合计	-	66,363.29	66,363.29

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

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期内无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。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：基金本报告期内无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。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本基金的管理人在本报告期内与上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浙商银行股份有限公司	7,098,651.77	12,048.10	14,998,117.51	38,770.35

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无其他需要说明的关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复牌 日期	复 牌 开 盘 单	数量 (股)	期末成本总 额	期末估值总 额	备注
------	------	------	------	----------------	----------	-----------------------	-----------	------------	------------	----

						价				
601298	青岛港	2023-06-28	-	6.97	2023-07-03	-	34,100	240,580.81	237,677.00	-

注：上述股票的复牌日期及复牌开盘单价更新截至本财务报表批准日。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

##### 6.4.13.2 信用风险

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

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

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金于本报告期末和上年度末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有需按短期信用评级列示的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有需按短期信用评级列示的同业存单。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金于本报告期末和上年度末未持有按长期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有需按长期信用评级列示的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有需按长期信用评级列示的同业存单。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短期内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 06 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年 以上	不计息	合计
资产							
银行存款	7,098,651.77	-	-	-	-	-	7,098,651.77
结算备付金	2,302,170.26	-	-	-	-	-	2,302,170.26
存出保证金	479,842.45	-	-	-	-	-	479,842.45
交易性金融资产	-	-	-	-	-	84,327,937.60	84,327,937.60
应收申购款	-	-	-	-	-	84,194.75	84,194.75
资产总计	9,880,664.48	-	-	-	-	84,412,132.35	94,292,796.83
负债							
应付清算	-	-	-	-	-	2,393.88	2,393.88



算款							
应付赎回款	-	-	-	-	-	135,817.90	135,817.90
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	61,691.18	61,691.18
应付托管费	-	-	-	-	-	15,422.77	15,422.77
应付销售服务费	-	-	-	-	-	10,346.02	10,346.02
其他负债	-	-	-	-	-	298,661.84	298,661.84
负债总计	-	-	-	-	-	524,333.59	524,333.59
利率敏感度缺口	9,880,664.48	-	-	-	-	83,887,798.76	93,768,463.24
上年度末 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	9,211,826.00	-	-	-	-	-	9,211,826.00
结算备付金	4,743,451.77	-	-	-	-	-	4,743,451.77
存出保证金	1,398,548.44	-	-	-	-	-	1,398,548.44
交易性金融资产	-	-	-	-	-	83,057,935.12	83,057,935.12
应收申购款	-	-	-	-	-	44,560.04	44,560.04
资产总计	15,353,826.21	-	-	-	-	83,102,495.16	98,456,321.37
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	864	864
应付赎回款	-	-	-	-	-	76,753.96	76,753.96
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	68,639.95	68,639.95

应付托管费	-	-	-	-	-	17,160.00	17,160.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-	11,537.38	11,537.38
其他负债	-	-	-	-	-	383,754.46	383,754.46
负债总计	-	-	-	-	-	558,709.75	558,709.75
利率敏感度缺口	15,353,826.21	-	-	-	-	82,543,785.41	97,897,611.62

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除利率之外的其他市场变量保持不变；	
	该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券与可交换债券。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		<table border="1"> <tr> <td>本期末 2023 年 06 月 30 日</td> <td>上年度末 2022 年 12 月 31 日</td> </tr> </table>
本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日	

注：于 6 月 30 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。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金为指数增强型股票基金，采取定量方法进行组合管理。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)

交易性金融资产—股票投资	84,327,937.60	89.93	83,057,935.12	84.84
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	84,327,937.60	89.93	83,057,935.12	84.84

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除下述市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上涨 5%	3,239,792.42	3,921,685.91
	沪深 300 指数下跌 5%	-3,239,792.42	-3,921,685.91

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

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

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	84,327,937.60	83,057,935.12
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	84,327,937.60	83,057,935.12

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

无。

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（2022 年 12 月 31 日：无）。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2023 年 6 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	84,327,937.60	89.43
	其中：股票	84,327,937.60	89.43
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	9,400,822.03	9.97
8	其他各项资产	564,037.20	0.60
9	合计	94,292,796.83	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	192,873.00	0.21
B	采矿业	3,590,830.90	3.83
C	制造业	42,301,918.40	45.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,426,289.00	2.59
E	建筑业	1,335,819.00	1.42
F	批发和零售业	1,795,276.80	1.91
G	交通运输、仓储和邮政业	2,402,545.00	2.56
H	住宿和餐饮业	130,755.00	0.14

I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,061,785.26	3.27
J	金融业	7,190,861.00	7.67
K	房地产业	1,432,076.00	1.53
L	租赁和商务服务业	848,689.00	0.91
M	科学研究和技术服务业	229,040.00	0.24
N	水利、环境和公共设施管理业	994,545.00	1.06
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	1,089,909.12	1.16
S	综合	175,635.00	0.19
	合计	69,198,847.48	73.80

### 7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	27,645.00	0.03
B	采矿业	620,935.40	0.66
C	制造业	9,990,726.27	10.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	513,493.00	0.55
E	建筑业	163,620.60	0.17
F	批发和零售业	733,077.88	0.78
G	交通运输、仓储和邮政业	535,885.00	0.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,155,949.37	1.23
J	金融业	276,964.60	0.30
K	房地产业	454,240.00	0.48
L	租赁和商务服务业	176,915.00	0.19
M	科学研究和技术服务业	230,330.00	0.25
N	水利、环境和公共设施管理业	88,614.00	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	38,592.00	0.04
Q	卫生和社会工作	38,556.00	0.04
R	文化、体育和娱乐业	83,546.00	0.09
S	综合	-	-
	合计	15,129,090.12	16.13

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	600066	宇通客车	58,800	866,712.00	0.92
2	601958	金铂股份	73,300	817,295.00	0.87
3	000988	华工科技	20,900	794,409.00	0.85
4	600582	天地科技	131,200	764,896.00	0.82
5	603225	新凤鸣	67,400	744,770.00	0.79
6	600060	海信视像	29,200	722,700.00	0.77
7	000739	普洛药业	39,400	698,956.00	0.75
8	600623	华谊集团	108,200	674,086.00	0.72
9	300146	汤臣倍健	27,100	649,858.00	0.69
10	002500	山西证券	113,700	634,446.00	0.68
11	600642	申能股份	87,700	613,023.00	0.65
12	600315	上海家化	21,100	612,111.00	0.65
13	000400	许继电气	25,700	592,385.00	0.63
14	600377	宁沪高速	58,400	574,072.00	0.61
15	000060	中金岭南	120,021	570,099.75	0.61
16	600839	四川长虹	112,800	569,640.00	0.61
17	600109	国金证券	65,300	566,151.00	0.60
18	002429	兆驰股份	101,900	560,450.00	0.60
19	000050	深天马 A	58,300	535,194.00	0.57
20	600879	航天电子	62,000	526,380.00	0.56
21	002223	鱼跃医疗	14,600	525,454.00	0.56
22	000937	冀中能源	82,100	523,798.00	0.56
23	002266	浙富控股	126,700	523,271.00	0.56
24	300308	中际旭创	3,500	516,075.00	0.55
25	002056	横店东磁	28,000	509,880.00	0.54
26	002867	周大生	28,600	508,508.00	0.54
27	603156	养元饮品	20,500	506,350.00	0.54
28	600271	航天信息	36,400	498,316.00	0.53
29	600597	光明乳业	47,200	490,880.00	0.52
30	600161	天坛生物	17,300	469,695.00	0.50
31	600985	淮北矿业	40,600	467,712.00	0.50
32	601198	东兴证券	57,500	461,150.00	0.49
33	002240	盛新锂能	14,400	458,928.00	0.49
34	000623	吉林敖东	27,900	447,516.00	0.48
35	600909	华安证券	95,600	446,452.00	0.48
36	600970	中材国际	33,800	430,950.00	0.46
37	000967	盈峰环境	85,000	429,250.00	0.46
38	002600	领益智造	61,500	424,965.00	0.45
39	002518	科士达	10,400	416,104.00	0.44

40	600967	内蒙一机	40,000	404,000.00	0.43
41	600131	国网信通	20,000	403,800.00	0.43
42	000559	万向钱潮	74,000	403,300.00	0.43
43	300866	安克创新	4,600	402,500.00	0.43
44	002372	伟星新材	19,400	398,476.00	0.42
45	000783	长江证券	68,500	397,300.00	0.42
46	000728	国元证券	60,100	391,852.00	0.42
47	600398	海澜之家	56,900	391,472.00	0.42
48	688390	固德威	2,341	390,619.26	0.42
49	002152	广电运通	32,600	382,072.00	0.41
50	600820	隧道股份	63,100	379,231.00	0.40
51	600867	通化东宝	36,200	377,928.00	0.40
52	601997	贵阳银行	70,400	363,264.00	0.39
53	002203	海亮股份	29,600	355,496.00	0.38
54	600481	双良节能	25,300	353,694.00	0.38
55	000537	广宇发展	30,300	353,601.00	0.38
56	600580	卧龙电驱	24,100	352,101.00	0.38
57	300136	信维通信	17,400	349,392.00	0.37
58	600707	彩虹股份	73,200	348,432.00	0.37
59	002028	思源电气	7,400	345,728.00	0.37
60	600329	达仁堂	7,700	345,653.00	0.37
61	002531	天顺风能	22,400	341,152.00	0.36
62	002690	美亚光电	12,950	333,462.50	0.36
63	000598	兴蓉环境	61,300	332,859.00	0.35
64	601717	郑煤机	26,700	332,415.00	0.35
65	600566	济川药业	10,806	313,806.24	0.33
66	600995	南网储能	28,500	313,785.00	0.33
67	600528	中铁工业	31,400	310,232.00	0.33
68	601000	唐山港	86,600	305,698.00	0.33
69	600998	九州通	28,820	299,151.60	0.32
70	600415	小商品城	34,800	296,844.00	0.32
71	002745	木林森	32,000	294,400.00	0.31
72	600968	海油发展	95,700	293,799.00	0.31
73	002563	森马服饰	46,800	291,096.00	0.31
74	600928	西安银行	82,200	289,344.00	0.31
75	002273	水晶光电	24,200	288,948.00	0.31
76	002468	申通快递	26,500	286,730.00	0.31
77	300438	鹏辉能源	5,900	283,436.00	0.30
78	300009	安科生物	28,100	281,000.00	0.30
79	600699	均胜电子	15,900	280,476.00	0.30
80	300296	利亚德	42,700	278,831.00	0.30
81	000709	河钢股份	122,400	276,624.00	0.30
82	603885	吉祥航空	17,600	271,568.00	0.29

83	002373	千方科技	19,900	271,436.00	0.29
84	002966	苏州银行	41,200	269,860.00	0.29
85	002511	中顺洁柔	24,100	268,715.00	0.29
86	603786	科博达	4,060	266,742.00	0.28
87	002568	百润股份	7,300	265,355.00	0.28
88	300861	美畅股份	6,100	264,557.00	0.28
89	301029	怡合达	5,900	263,612.00	0.28
90	002595	豪迈科技	7,500	263,475.00	0.28
91	300073	当升科技	5,200	261,716.00	0.28
92	002353	杰瑞股份	10,400	261,352.00	0.28
93	603317	天味食品	17,832	260,525.52	0.28
94	002444	巨星科技	11,900	260,372.00	0.28
95	688301	奕瑞科技	920	259,835.60	0.28
96	000031	大悦城	70,700	258,762.00	0.28
97	002244	滨江集团	29,200	257,544.00	0.27
98	601928	凤凰传媒	22,501	256,511.40	0.27
99	603233	大参林	9,020	252,650.20	0.27
100	601187	厦门银行	50,100	251,502.00	0.27
101	000423	东阿阿胶	4,700	251,215.00	0.27
102	603927	中科软	6,500	250,640.00	0.27
103	600373	中文传媒	18,696	249,030.72	0.27
104	688029	南微医学	3,044	248,268.64	0.26
105	603338	浙江鼎力	4,400	246,444.00	0.26
106	002465	海格通信	23,400	241,956.00	0.26
107	601298	青岛港	34,100	237,677.00	0.25
108	002423	中粮资本	29,400	235,200.00	0.25
109	688289	圣湘生物	13,900	234,076.00	0.25
110	688002	睿创微纳	5,200	232,960.00	0.25
111	600535	天士力	15,900	230,709.00	0.25
112	300001	特锐德	11,100	230,658.00	0.25
113	600177	雅戈尔	36,400	229,684.00	0.24
114	603127	昭衍新药	5,600	229,040.00	0.24
115	002572	索菲亚	13,100	228,202.00	0.24
116	002739	万达电影	17,800	223,212.00	0.24
117	600755	厦门国贸	28,800	222,912.00	0.24
118	002249	大洋电机	38,800	221,160.00	0.24
119	603939	益丰药房	5,960	220,520.00	0.24
120	600435	北方导航	19,100	219,459.00	0.23
121	688006	杭可科技	7,182	218,835.54	0.23
122	002939	长城证券	26,700	217,071.00	0.23
123	001914	招商积余	14,400	216,720.00	0.23
124	600008	首创环保	74,500	214,560.00	0.23
125	002926	华西证券	25,800	214,398.00	0.23



126	300724	捷佳伟创	1,900	213,465.00	0.23
127	002985	北摩高科	4,800	211,776.00	0.23
128	600517	国网英大	36,900	210,330.00	0.22
129	600895	张江高科	14,900	207,408.00	0.22
130	601611	中国核建	24,200	204,490.00	0.22
131	000930	中粮科技	25,200	204,120.00	0.22
132	601577	长沙银行	26,100	202,536.00	0.22
133	300144	宋城演艺	16,300	202,120.00	0.22
134	601990	南京证券	24,700	202,046.00	0.22
135	601108	财通证券	27,800	201,272.00	0.21
136	600143	金发科技	23,000	200,790.00	0.21
137	002010	传化智联	37,600	200,032.00	0.21
138	000869	张裕 A	6,500	199,290.00	0.21
139	000581	威孚高科	12,600	198,450.00	0.21
140	002221	东华能源	22,800	197,220.00	0.21
141	600126	杭钢股份	45,100	195,734.00	0.21
142	002507	涪陵榨菜	10,590	193,902.90	0.21
143	000932	华菱钢铁	40,000	190,800.00	0.20
144	600282	南钢股份	56,000	188,720.00	0.20
145	601568	北元集团	35,800	188,666.00	0.20
146	002195	二三四五	64,600	186,694.00	0.20
147	600901	江苏金租	45,200	186,676.00	0.20
148	002065	东华软件	26,300	185,678.00	0.20
149	600655	豫园股份	27,000	185,220.00	0.20
150	600637	东方明珠	23,600	184,552.00	0.20
151	601139	深圳燃气	25,300	184,437.00	0.20
152	603868	飞科电器	2,900	182,961.00	0.20
153	600348	华阳股份	22,950	181,534.50	0.19
154	600516	方大炭素	28,700	177,940.00	0.19
155	001872	招商港口	10,300	177,881.00	0.19
156	688009	中国通号	29,759	172,602.20	0.18
157	688819	天能股份	4,550	167,622.00	0.18
158	603883	老百姓	5,600	167,160.00	0.18
159	603056	德邦股份	10,800	166,536.00	0.18
160	300677	英科医疗	7,200	158,400.00	0.17
161	600167	联美控股	22,700	158,219.00	0.17
162	000027	深圳能源	23,900	157,501.00	0.17
163	000878	云南铜业	14,200	156,910.00	0.17
164	603858	步长制药	7,600	156,484.00	0.17
165	600667	太极实业	21,500	156,090.00	0.17
166	000547	航天发展	15,600	156,000.00	0.17
167	002128	电投能源	11,800	155,996.00	0.17
168	300682	朗新科技	6,700	155,976.00	0.17

169	000012	南玻 A	26,100	155,556.00	0.17
170	601869	长飞光纤	4,200	155,442.00	0.17
171	688516	奥特维	825	155,430.00	0.17
172	300088	长信科技	25,600	154,368.00	0.16
173	688188	柏楚电子	816	153,864.96	0.16
174	600380	健康元	12,100	153,791.00	0.16
175	600339	中油工程	37,600	153,032.00	0.16
176	600497	驰宏锌锗	30,300	152,106.00	0.16
177	000636	风华高科	9,900	151,866.00	0.16
178	600704	物产中大	30,200	149,188.00	0.16
179	002850	科达利	1,100	145,475.00	0.16
180	300568	星源材质	8,400	144,396.00	0.15
181	600885	宏发股份	4,500	143,325.00	0.15
182	000021	深科技	7,000	139,930.00	0.15
183	002299	圣农发展	7,300	139,795.00	0.15
184	688208	道通科技	4,600	139,426.00	0.15
185	600862	中航高科	5,500	139,205.00	0.15
186	000738	航发控制	5,700	139,080.00	0.15
187	002409	雅克科技	1,900	138,472.00	0.15
188	600563	法拉电子	1,000	137,300.00	0.15
189	000089	深圳机场	19,700	136,915.00	0.15
190	000513	丽珠集团	3,500	136,185.00	0.15
191	600863	内蒙华电	32,800	136,120.00	0.15
192	603228	景旺电子	5,300	135,945.00	0.14
193	002683	广东宏大	4,600	135,424.00	0.14
194	600166	福田汽车	39,800	135,320.00	0.14
195	002025	航天电器	2,100	133,980.00	0.14
196	300373	扬杰科技	3,300	133,881.00	0.14
197	600259	广晟有色	3,700	133,718.00	0.14
198	000997	新大陆	7,000	132,300.00	0.14
199	688536	思瑞浦	600	130,800.00	0.14
200	600258	首旅酒店	6,900	130,755.00	0.14
201	600906	财达证券	18,100	130,320.00	0.14
202	000553	安道麦 A	15,400	129,976.00	0.14
203	600416	湘电股份	6,800	129,812.00	0.14
204	601665	齐鲁银行	32,600	127,792.00	0.14
205	002183	怡亚通	24,900	126,990.00	0.14
206	300251	光线传媒	15,500	125,395.00	0.13
207	603688	石英股份	1,100	125,224.00	0.13
208	601168	西部矿业	11,900	125,069.00	0.13
209	603650	彤程新材	3,800	124,640.00	0.13
210	300383	光环新网	11,500	123,625.00	0.13
211	600170	上海建工	45,600	122,664.00	0.13

212	300003	乐普医疗	5,400	122,094.00	0.13
213	603218	日月股份	6,400	121,536.00	0.13
214	002153	石基信息	8,680	121,520.00	0.13
215	000729	燕京啤酒	9,600	119,712.00	0.13
216	600521	华海药业	6,500	119,665.00	0.13
217	002368	太极股份	2,900	119,393.00	0.13
218	600871	石化油服	59,000	116,820.00	0.12
219	002384	东山精密	4,500	116,550.00	0.12
220	603529	爱玛科技	3,600	115,992.00	0.12
221	002422	科伦药业	3,900	115,752.00	0.12
222	600489	中金黄金	11,180	115,489.40	0.12
223	603456	九洲药业	4,200	114,996.00	0.12
224	600390	五矿资本	21,300	114,594.00	0.12
225	002670	国盛金控	13,000	114,140.00	0.12
226	601555	东吴证券	16,300	113,122.00	0.12
227	300888	稳健医疗	2,700	112,509.00	0.12
228	000629	钒钛股份	28,700	112,217.00	0.12
229	600399	抚顺特钢	10,700	109,140.00	0.12
230	600352	浙江龙盛	11,600	108,460.00	0.12
231	000958	电投产融	24,800	107,384.00	0.11
232	002738	中矿资源	2,100	106,974.00	0.11
233	300442	润泽科技	3,400	104,584.00	0.11
234	000415	渤海租赁	49,700	104,370.00	0.11
235	601058	赛轮轮胎	9,000	102,510.00	0.11
236	600155	华创云信	16,300	101,386.00	0.11
237	600739	辽宁成大	7,700	101,255.00	0.11
238	300017	网宿科技	13,900	98,829.00	0.11
239	603444	吉比特	200	98,222.00	0.10
240	000009	中国宝安	8,100	97,767.00	0.10
241	600848	上海临港	8,000	95,600.00	0.10
242	600079	人福医药	3,500	94,290.00	0.10
243	600959	江苏有线	27,000	91,260.00	0.10
244	600038	中直股份	2,281	90,829.42	0.10
245	000960	锡业股份	5,800	90,190.00	0.10
246	002439	启明星辰	3,000	89,280.00	0.10
247	600171	上海贝岭	4,800	87,600.00	0.09
248	600095	湘财股份	11,200	87,360.00	0.09
249	601162	天风证券	29,200	87,016.00	0.09
250	601128	常熟银行	12,700	86,614.00	0.09
251	300253	卫宁健康	8,000	86,560.00	0.09
252	000155	川能动力	6,000	86,400.00	0.09
253	002673	西部证券	13,600	86,360.00	0.09
254	601106	中国一重	25,700	86,352.00	0.09

255	601666	平煤股份	11,400	85,956.00	0.09
256	000987	越秀资本	13,500	85,725.00	0.09
257	600418	江淮汽车	6,800	85,612.00	0.09
258	002958	青农商行	31,300	85,136.00	0.09
259	688777	中控技术	1,345	84,439.10	0.09
260	601636	旗滨集团	9,700	83,614.00	0.09
261	300037	新宙邦	1,600	83,024.00	0.09
262	600737	中粮糖业	10,000	80,500.00	0.09
263	601077	渝农商行	22,300	80,057.00	0.09
264	601158	重庆水务	14,300	79,508.00	0.08
265	600673	东阳光	10,800	77,868.00	0.08
266	000785	居然之家	20,300	77,343.00	0.08
267	600873	梅花生物	8,600	76,798.00	0.08
268	000039	中集集团	11,100	76,479.00	0.08
269	000883	湖北能源	16,500	75,240.00	0.08
270	300487	蓝晓科技	1,200	74,904.00	0.08
271	600350	山东高速	11,400	72,618.00	0.08
272	002268	电科网安	2,600	72,462.00	0.08
273	603826	坤彩科技	1,400	70,000.00	0.07
274	603026	胜华新材	1,100	65,175.00	0.07
275	600378	昊华科技	1,700	63,988.00	0.07
276	002080	中材科技	2,600	53,352.00	0.06
277	000703	恒逸石化	7,800	52,884.00	0.06
278	601866	中远海发	21,200	52,364.00	0.06
279	603355	莱克电气	1,817	46,169.97	0.05
280	603707	健友股份	3,300	44,550.00	0.05
281	300257	开山股份	2,900	43,993.00	0.05
282	600486	扬农化工	500	43,710.00	0.05
283	002901	大博医疗	1,400	43,512.00	0.05
284	600500	中化国际	7,800	43,368.00	0.05
285	601608	中信重工	10,300	43,363.00	0.05
286	600195	中牧股份	3,700	43,216.00	0.05
287	002399	海普瑞	3,760	43,127.20	0.05
288	601828	美凯龙	9,000	43,110.00	0.05
289	603638	艾迪精密	2,100	43,092.00	0.05
290	000563	陕国投 A	14,100	43,005.00	0.05
291	601156	东航物流	3,300	42,900.00	0.05
292	300741	华宝股份	2,000	42,840.00	0.05
293	601969	海南矿业	6,500	42,770.00	0.05
294	601228	广州港	13,200	42,636.00	0.05
295	600507	方大特钢	9,200	42,596.00	0.05
296	002653	海思科	1,800	42,480.00	0.05
297	600663	陆家嘴	4,300	42,441.00	0.05

298	002081	金螳螂	9,400	42,394.00	0.05
299	603379	三美股份	1,800	42,318.00	0.05
300	600782	新钢股份	11,400	42,294.00	0.05
301	600299	安迪苏	5,300	42,241.00	0.05
302	001203	大中矿业	3,800	42,218.00	0.05
303	603568	伟明环保	2,400	42,024.00	0.04
304	600801	华新水泥	3,400	41,990.00	0.04
305	600956	新天绿能	4,800	41,856.00	0.04
306	603866	桃李面包	4,100	41,492.00	0.04
307	002831	裕同科技	1,700	41,463.00	0.04
308	300832	新产业	600	35,400.00	0.04
309	601598	中国外运	7,500	34,950.00	0.04
310	600598	北大荒	2,600	34,658.00	0.04
311	601233	桐昆股份	2,600	34,450.00	0.04
312	002430	杭氧股份	1,000	34,360.00	0.04
313	002294	信立泰	1,100	34,309.00	0.04
314	688538	和辉光电	13,400	34,036.00	0.04
315	601992	金隅集团	15,600	34,008.00	0.04
316	000959	首钢股份	9,700	33,950.00	0.04
317	601098	中南传媒	2,900	33,640.00	0.04
318	600372	中航电子	2,200	33,396.00	0.04
319	600027	华电国际	4,900	32,781.00	0.03
320	688200	华峰测控	197	30,141.00	0.03
321	000975	银泰黄金	2,500	29,250.00	0.03
322	300604	长川科技	600	28,494.00	0.03
323	000970	中科三环	1,600	20,512.00	0.02
324	002625	光启技术	1,300	19,838.00	0.02
325	002340	格林美	2,800	19,348.00	0.02
326	600392	盛和资源	1,500	19,305.00	0.02
327	600988	赤峰黄金	1,400	18,844.00	0.02
328	000630	铜陵有色	6,500	18,785.00	0.02
329	002624	完美世界	1,100	18,579.00	0.02
330	000998	隆平高科	1,200	18,420.00	0.02
331	002508	老板电器	700	17,703.00	0.02
332	600022	山东钢铁	11,500	16,330.00	0.02
333	688185	康希诺	100	8,150.00	0.01
334	688778	厦钨新能	140	6,930.00	0.01
335	600536	中国软件	40	1,875.20	0.00
336	603737	三棵树	20	1,308.40	0.00
337	601179	中国西电	86	465.26	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	000528	柳工	19,900	157,210.00	0.17
2	000688	国城矿业	10,100	153,217.00	0.16
3	688297	中无人机	2,681	137,508.49	0.15
4	000885	城发环境	9,200	122,452.00	0.13
5	300440	运达科技	17,200	121,604.00	0.13
6	601699	潞安环能	7,300	119,136.00	0.13
7	601766	中国中车	18,300	118,950.00	0.13
8	601319	中国人保	20,300	118,552.00	0.13
9	600572	康恩贝	17,300	118,505.00	0.13
10	600362	江西铜业	6,200	117,676.00	0.13
11	601600	中国铝业	21,300	116,937.00	0.12
12	001979	招商蛇口	8,800	114,664.00	0.12
13	300763	锦浪科技	1,100	114,510.00	0.12
14	000333	美的集团	1,800	106,056.00	0.11
15	600633	浙数文化	6,200	100,502.00	0.11
16	000062	深圳华强	8,742	99,833.64	0.11
17	600312	平高电气	8,000	99,120.00	0.11
18	300382	斯莱克	7,200	94,968.00	0.10
19	603730	岱美股份	5,800	91,640.00	0.10
20	000552	甘肃能化	27,000	89,910.00	0.10
21	603027	千禾味业	4,100	86,592.00	0.09
22	002489	浙江永强	21,300	86,265.00	0.09
23	000921	海信家电	3,200	86,240.00	0.09
24	600007	中国国贸	4,600	85,192.00	0.09
25	002402	和而泰	5,000	84,900.00	0.09
26	002446	盛路通信	8,900	84,105.00	0.09
27	000028	国药一致	1,850	80,678.50	0.09
28	600933	爱柯迪	3,400	79,186.00	0.08
29	002027	分众传媒	11,600	78,996.00	0.08
30	600742	一汽富维	9,400	76,986.00	0.08
31	300065	海兰信	6,200	76,818.00	0.08
32	300206	理邦仪器	5,000	75,400.00	0.08
33	002701	奥瑞金	16,700	75,317.00	0.08
34	300767	震安科技	2,900	73,544.00	0.08
35	002698	博实股份	4,100	71,709.00	0.08
36	600419	天润乳业	4,400	71,368.00	0.08
37	002727	一心堂	2,700	71,280.00	0.08
38	003006	百亚股份	4,100	70,848.00	0.08
39	002484	江海股份	3,300	70,257.00	0.07
40	600583	海油工程	12,000	70,200.00	0.07

41	002105	信隆健康	11,500	68,425.00	0.07
42	600483	福能股份	5,900	68,145.00	0.07
43	300996	普联软件	2,200	67,540.00	0.07
44	002582	好想你	8,500	66,385.00	0.07
45	300609	汇纳科技	2,300	64,400.00	0.07
46	603368	柳药集团	2,600	64,246.00	0.07
47	603679	华体科技	4,300	64,156.00	0.07
48	300563	神宇股份	3,800	62,092.00	0.07
49	688676	金盘科技	2,000	60,580.00	0.06
50	002459	晶澳科技	1,440	60,048.00	0.06
51	603719	良品铺子	2,400	60,024.00	0.06
52	002351	漫步者	2,900	59,972.00	0.06
53	300925	法本信息	4,200	59,346.00	0.06
54	300128	锦富技术	14,200	59,214.00	0.06
55	002675	东诚药业	3,900	57,369.00	0.06
56	002334	英威腾	4,500	57,330.00	0.06
57	603328	依顿电子	6,900	57,132.00	0.06
58	300036	超图软件	2,400	56,904.00	0.06
59	001696	宗申动力	8,000	56,640.00	0.06
60	300185	通裕重工	20,300	56,637.00	0.06
61	600792	云煤能源	16,600	55,942.00	0.06
62	000969	安泰科技	5,900	55,873.00	0.06
63	601965	中国汽研	2,700	55,755.00	0.06
64	300860	锋尚文化	1,000	55,440.00	0.06
65	300075	数字政通	2,200	54,736.00	0.06
66	002276	万马股份	4,500	54,495.00	0.06
67	688556	高测股份	1,020	54,202.80	0.06
68	300636	同和药业	4,400	53,944.00	0.06
69	002833	弘亚数控	2,700	53,082.00	0.06
70	300265	通光线缆	5,100	52,938.00	0.06
71	002320	海峡股份	8,700	52,548.00	0.06
72	002875	安奈儿	3,900	52,455.00	0.06
73	605499	东鹏饮料	300	51,870.00	0.06
74	300501	海顺新材	3,100	51,646.00	0.06
75	600929	雪天盐业	6,500	51,610.00	0.06
76	603002	宏昌电子	10,000	51,500.00	0.05
77	300750	宁德时代	220	50,333.80	0.05
78	300759	康龙化成	1,300	49,764.00	0.05
79	600587	新华医疗	1,400	49,462.00	0.05
80	603033	三维股份	2,400	48,840.00	0.05
81	000544	中原环保	6,800	48,824.00	0.05
82	688689	银河微电	1,891	48,787.80	0.05
83	603660	苏州科达	7,100	48,777.00	0.05

84	688166	博瑞医药	2,190	48,158.10	0.05
85	002154	报喜鸟	8,700	48,024.00	0.05
86	603717	天域生态	6,900	46,851.00	0.05
87	000702	正虹科技	8,500	46,580.00	0.05
88	600420	国药现代	4,100	46,289.00	0.05
89	600061	国投资本	6,500	46,280.00	0.05
90	601865	福莱特	1,200	46,212.00	0.05
91	300664	鹏鹞环保	8,100	45,846.00	0.05
92	300353	东土科技	3,500	45,535.00	0.05
93	000900	现代投资	11,200	45,136.00	0.05
94	301057	汇隆新材	2,600	44,824.00	0.05
95	601607	上海医药	2,000	44,820.00	0.05
96	600039	四川路桥	4,560	44,733.60	0.05
97	600717	天津港	10,000	44,300.00	0.05
98	300537	广信材料	2,700	44,118.00	0.05
99	600557	康缘药业	1,600	43,936.00	0.05
100	002649	博彦科技	3,100	43,803.00	0.05
101	603901	永创智能	3,000	43,680.00	0.05
102	300131	英唐智控	8,300	43,575.00	0.05
103	002416	爱施德	5,900	43,542.00	0.05
104	002116	中国海诚	3,400	43,452.00	0.05
105	002242	九阳股份	2,900	43,355.00	0.05
106	600267	海正药业	3,800	43,244.00	0.05
107	002262	恩华药业	1,400	43,162.00	0.05
108	603697	有友食品	4,700	43,099.00	0.05
109	000949	新乡化纤	13,400	43,014.00	0.05
110	600648	外高桥	3,800	42,978.00	0.05
111	002048	宁波华翔	3,200	42,880.00	0.05
112	300197	节能铁汉	17,600	42,768.00	0.05
113	600216	浙江医药	3,900	42,705.00	0.05
114	300779	惠城环保	800	42,632.00	0.05
115	003816	中国广核	13,700	42,607.00	0.05
116	600006	东风汽车	7,200	42,552.00	0.05
117	002379	宏创控股	9,800	41,454.00	0.04
118	600028	中国石化	6,500	41,340.00	0.04
119	600180	瑞茂通	6,900	41,262.00	0.04
120	000063	中兴通讯	900	40,986.00	0.04
121	603367	辰欣药业	2,700	40,986.00	0.04
122	300940	南极光	2,400	40,824.00	0.04
123	301031	中熔电气	300	40,713.00	0.04
124	002536	飞龙股份	2,700	40,500.00	0.04
125	600886	国投电力	3,200	40,480.00	0.04
126	688526	科前生物	1,700	40,443.00	0.04



127	002007	华兰生物	1,800	40,338.00	0.04
128	002011	盾安环境	2,900	40,107.00	0.04
129	688707	振华新材	1,300	40,027.00	0.04
130	300700	岱勒新材	2,100	40,005.00	0.04
131	600776	东方通信	2,800	39,900.00	0.04
132	300406	九强生物	1,700	39,661.00	0.04
133	300747	锐科激光	1,300	39,624.00	0.04
134	301071	力量钻石	900	39,600.00	0.04
135	300005	探路者	4,700	39,480.00	0.04
136	300708	聚灿光电	4,000	39,480.00	0.04
137	601107	四川成渝	9,700	39,479.00	0.04
138	300002	神州泰岳	2,800	39,200.00	0.04
139	603998	方盛制药	3,100	39,091.00	0.04
140	002252	上海莱士	5,200	39,052.00	0.04
141	601199	江南水务	5,700	38,874.00	0.04
142	301015	百洋医药	1,400	38,864.00	0.04
143	002922	伊戈尔	2,700	38,745.00	0.04
144	002635	安洁科技	2,800	38,640.00	0.04
145	002815	崇达技术	3,100	38,595.00	0.04
146	603377	东方时尚	4,800	38,592.00	0.04
147	300143	盈康生命	3,400	38,556.00	0.04
148	002886	沃特股份	1,900	38,532.00	0.04
149	002324	普利特	2,700	38,529.00	0.04
150	300319	麦捷科技	4,500	38,520.00	0.04
151	300035	中科电气	3,200	38,464.00	0.04
152	601628	中国人寿	1,100	38,456.00	0.04
153	300091	金通灵	12,900	38,442.00	0.04
154	300683	海特生物	1,000	38,310.00	0.04
155	002782	可立克	2,500	38,225.00	0.04
156	002176	江特电机	3,200	38,144.00	0.04
157	603915	国茂股份	1,800	38,124.00	0.04
158	300567	精测电子	400	38,060.00	0.04
159	002612	朗姿股份	1,600	38,048.00	0.04
160	603032	德新科技	1,100	37,994.00	0.04
161	603197	保隆科技	700	37,975.00	0.04
162	300183	东软载波	2,300	37,973.00	0.04
163	000425	徐工机械	5,600	37,912.00	0.04
164	603599	广信股份	1,400	37,912.00	0.04
165	603989	艾华集团	1,800	37,908.00	0.04
166	603678	火炬电子	1,100	37,906.00	0.04
167	002636	金安国纪	4,100	37,843.00	0.04
168	000811	冰轮环境	2,400	37,824.00	0.04
169	605167	利柏特	3,900	37,752.00	0.04

170	605376	博迁新材	1,200	37,656.00	0.04
171	603279	景津装备	1,200	37,632.00	0.04
172	002434	万里扬	4,200	37,590.00	0.04
173	603393	新天然气	1,400	37,576.00	0.04
174	603508	思维列控	2,200	37,510.00	0.04
175	601677	明泰铝业	2,700	37,476.00	0.04
176	603768	常青股份	2,100	37,317.00	0.04
177	002651	利君股份	4,800	37,296.00	0.04
178	600750	江中药业	1,700	37,281.00	0.04
179	300377	赢时胜	4,600	37,260.00	0.04
180	002283	天润工业	5,800	37,236.00	0.04
181	002020	京新药业	2,900	37,178.00	0.04
182	002605	姚记科技	800	37,144.00	0.04
183	000576	甘化科工	3,500	37,100.00	0.04
184	002332	仙琚制药	2,800	37,100.00	0.04
185	300054	鼎龙股份	1,500	37,095.00	0.04
186	000951	中国重汽	2,200	37,070.00	0.04
187	300164	通源石油	8,500	37,060.00	0.04
188	002233	塔牌集团	4,800	37,056.00	0.04
189	688425	铁建重工	7,700	37,037.00	0.04
190	002053	云南能投	3,300	37,026.00	0.04
191	002204	大连重工	7,200	37,008.00	0.04
192	300890	翔丰华	900	36,990.00	0.04
193	300470	中密控股	800	36,976.00	0.04
194	002421	达实智能	10,500	36,960.00	0.04
195	600285	羚锐制药	2,300	36,938.00	0.04
196	000682	东方电子	3,800	36,936.00	0.04
197	000517	荣安地产	12,100	36,905.00	0.04
198	000555	神州信息	3,000	36,900.00	0.04
199	002285	世联行	14,400	36,864.00	0.04
200	002212	天融信	3,800	36,860.00	0.04
201	300101	振芯科技	1,900	36,841.00	0.04
202	000650	仁和药业	6,000	36,840.00	0.04
203	000657	中钨高新	3,800	36,822.00	0.04
204	600864	哈投股份	7,200	36,792.00	0.04
205	600872	中炬高新	1,000	36,790.00	0.04
206	600200	江苏吴中	5,100	36,771.00	0.04
207	603043	广州酒家	1,300	36,738.00	0.04
208	002611	东方精工	6,400	36,736.00	0.04
209	300738	奥飞数据	3,600	36,720.00	0.04
210	603520	司太立	2,200	36,696.00	0.04
211	601567	三星医疗	2,900	36,627.00	0.04
212	002664	信质集团	2,600	36,608.00	0.04

213	300263	隆华科技	4,400	36,608.00	0.04
214	300596	利安隆	900	36,603.00	0.04
215	300191	潜能恒信	2,000	36,560.00	0.04
216	605337	李子园	2,000	36,560.00	0.04
217	600057	厦门象屿	4,200	36,540.00	0.04
218	600773	西藏城投	2,900	36,540.00	0.04
219	600643	爱建集团	7,300	36,500.00	0.04
220	300203	聚光科技	1,800	36,486.00	0.04
221	000913	钱江摩托	2,000	36,460.00	0.04
222	000923	河钢资源	2,700	36,450.00	0.04
223	002267	陕天然气	4,600	36,432.00	0.04
224	000426	兴业银锡	4,100	36,408.00	0.04
225	002747	埃斯顿	1,300	36,400.00	0.04
226	000999	华润三九	600	36,396.00	0.04
227	000901	航天科技	3,400	36,380.00	0.04
228	600185	格力地产	5,300	36,358.00	0.04
229	600064	南京高科	5,500	36,355.00	0.04
230	000685	中山公用	4,800	36,336.00	0.04
231	002928	华夏航空	4,300	36,335.00	0.04
232	300463	迈克生物	2,400	36,288.00	0.04
233	000876	新希望	3,100	36,208.00	0.04
234	002967	广电计量	1,800	36,162.00	0.04
235	300473	德尔股份	2,000	36,120.00	0.04
236	300802	矩子科技	1,500	36,105.00	0.04
237	000429	粤高速 A	4,600	36,064.00	0.04
238	688139	海尔生物	700	36,029.00	0.04
239	002314	南山控股	10,900	35,970.00	0.04
240	300665	飞鹿股份	4,100	35,629.00	0.04
241	300034	钢研高纳	900	35,451.00	0.04
242	603733	仙鹤股份	1,700	35,445.00	0.04
243	002832	比音勒芬	1,000	35,410.00	0.04
244	600658	电子城	6,400	35,392.00	0.04
245	300122	智飞生物	800	35,360.00	0.04
246	300121	阳谷华泰	3,700	35,335.00	0.04
247	603489	八方股份	500	35,060.00	0.04
248	603348	文灿股份	800	35,048.00	0.04
249	600612	老凤祥	500	34,940.00	0.04
250	000821	京山轻机	1,700	34,782.00	0.04
251	000963	华东医药	800	34,696.00	0.04
252	002367	康力电梯	3,800	34,694.00	0.04
253	603087	甘李药业	900	34,650.00	0.04
254	002301	齐心集团	4,800	34,512.00	0.04
255	600552	凯盛科技	2,900	34,336.00	0.04

256	002038	双鹭药业	3,400	34,306.00	0.04
257	300378	鼎捷软件	1,000	34,250.00	0.04
258	601702	华峰铝业	2,500	34,200.00	0.04
259	688131	皓元医药	600	34,188.00	0.04
260	601872	招商轮船	5,900	34,161.00	0.04
261	300613	富瀚微	600	34,044.00	0.04
262	002847	盐津铺子	400	34,020.00	0.04
263	600761	安徽合力	1,700	33,881.00	0.04
264	300252	金信诺	3,000	33,720.00	0.04
265	000950	重药控股	5,000	33,650.00	0.04
266	600012	皖通高速	3,200	33,536.00	0.04
267	600865	百大集团	3,900	33,423.00	0.04
268	002215	诺普信	4,400	33,044.00	0.04
269	600269	赣粤高速	9,000	33,030.00	0.04
270	600237	铜峰电子	4,000	32,920.00	0.04
271	000858	五粮液	200	32,714.00	0.03
272	600138	中青旅	2,600	32,526.00	0.03
273	300180	华峰超纤	9,000	32,490.00	0.03
274	002275	桂林三金	1,800	32,418.00	0.03
275	300587	天铁股份	4,200	32,340.00	0.03
276	600965	福成股份	5,100	32,283.00	0.03
277	300217	东方电热	5,500	32,230.00	0.03
278	002588	史丹利	5,300	32,224.00	0.03
279	002448	中原内配	4,600	32,200.00	0.03
280	600050	中国联通	6,700	32,160.00	0.03
281	600023	浙能电力	6,300	31,941.00	0.03
282	002123	梦网科技	2,400	31,896.00	0.03
283	600559	老白干酒	1,300	31,863.00	0.03
284	601163	三角轮胎	2,000	31,740.00	0.03
285	300856	科思股份	400	31,508.00	0.03
286	603567	珍宝岛	2,100	31,416.00	0.03
287	300731	科创新源	1,500	31,395.00	0.03
288	688683	莱尔科技	1,400	31,150.00	0.03
289	600600	青岛啤酒	300	31,089.00	0.03
290	600578	京能电力	7,900	30,889.00	0.03
291	300099	精准信息	4,800	30,528.00	0.03
292	300045	华力创通	2,600	30,160.00	0.03
293	300402	宝色股份	1,400	30,086.00	0.03
294	000503	国新健康	2,500	29,975.00	0.03
295	603758	秦安股份	2,800	29,792.00	0.03
296	300773	拉卡拉	1,700	29,648.00	0.03
297	000905	厦门港务	3,800	29,564.00	0.03
298	002170	芭田股份	4,300	29,541.00	0.03

299	000828	东莞控股	3,200	29,280.00	0.03
300	002214	大立科技	2,140	29,211.00	0.03
301	600203	福日电子	4,800	29,184.00	0.03
302	300790	宇瞳光学	1,900	28,956.00	0.03
303	002344	海宁皮城	6,100	28,853.00	0.03
304	600011	华能国际	3,100	28,706.00	0.03
305	002121	科陆电子	3,900	28,587.00	0.03
306	601618	中国中冶	7,200	28,584.00	0.03
307	600803	新奥股份	1,500	28,470.00	0.03
308	600537	亿晶光电	3,700	28,268.00	0.03
309	600353	旭光电子	3,440	28,208.00	0.03
310	301025	读客文化	2,300	28,106.00	0.03
311	300761	立华股份	1,500	27,645.00	0.03
312	000690	宝新能源	3,900	27,378.00	0.03
313	002461	珠江啤酒	3,100	27,311.00	0.03
314	688186	广大特材	822	26,739.66	0.03
315	300302	同有科技	1,800	26,730.00	0.03
316	603369	今世缘	500	26,400.00	0.03
317	300863	卡倍亿	400	25,164.00	0.03
318	688333	铂力特	196	20,725.04	0.02
319	300376	易事特	2,900	19,430.00	0.02
320	688016	心脉医疗	100	17,988.00	0.02
321	601619	嘉泽新能	3,700	16,835.00	0.02
322	688202	美迪西	196	16,709.00	0.02
323	688408	中信博	184	15,516.72	0.02
324	688368	晶丰明源	100	12,721.00	0.01
325	688608	恒玄科技	100	12,103.00	0.01
326	688508	芯朋微	173	10,032.27	0.01
327	688305	科德数控	100	10,026.00	0.01
328	688668	鼎通科技	100	9,780.00	0.01
329	002846	英联股份	700	8,974.00	0.01
330	688798	艾为电子	140	8,281.00	0.01
331	601138	工业富联	300	7,560.00	0.01
332	688168	安博通	200	7,120.00	0.01
333	688155	先惠技术	100	5,426.00	0.01
334	688698	伟创电气	132	5,277.36	0.01
335	688786	悦安新材	95	4,407.05	0.00
336	603195	公牛集团	44	4,226.64	0.00
337	688303	大全能源	100	4,045.00	0.00
338	688625	呈和科技	100	3,919.00	0.00
339	688328	深科达	100	3,348.00	0.00
340	300092	科新机电	200	3,280.00	0.00
341	688020	方邦股份	52	2,598.44	0.00

342	603613	国联股份	70	2,585.10	0.00
343	688025	杰普特	16	1,397.60	0.00
344	688136	科兴制药	74	1,380.10	0.00
345	300855	图南股份	30	1,059.60	0.00
346	688378	奥来德	17	839.80	0.00
347	688135	利扬芯片	36	789.48	0.00
348	605180	华生科技	60	742.20	0.00
349	688357	建龙微纳	11	711.59	0.00
350	600123	兰花科创	80	654.40	0.00
351	000567	海德股份	30	384.60	0.00
352	301078	孩子王	18	205.74	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入 金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300308	中际旭创	3,887,015.00	3.97
2	688390	固德威	3,487,465.58	3.56
3	600528	中铁工业	3,001,634.00	3.07
4	300115	长盈精密	3,000,075.00	3.06
5	688063	派能科技	2,978,919.70	3.04
6	600968	海油发展	2,942,756.00	3.01
7	600623	华谊集团	2,935,140.00	3.00
8	601699	潞安环能	2,931,441.00	2.99
9	300568	星源材质	2,905,909.00	2.97
10	300604	长川科技	2,876,447.00	2.94
11	601598	中国外运	2,838,124.00	2.90
12	688208	道通科技	2,776,589.07	2.84
13	300017	网宿科技	2,761,922.69	2.82
14	002353	杰瑞股份	2,744,548.00	2.80
15	600259	广晟有色	2,740,638.00	2.80
16	600895	张江高科	2,617,867.00	2.67
17	600060	海信视像	2,617,296.00	2.67
18	603688	石英股份	2,530,679.00	2.59
19	688006	杭可科技	2,521,471.49	2.58
20	002690	美亚光电	2,478,141.00	2.53
21	000050	深天马 A	2,444,529.00	2.50
22	688521	芯原股份	2,444,300.73	2.50
23	603927	中科软	2,424,760.00	2.48
24	000060	中金岭南	2,420,036.97	2.47
25	601717	郑煤机	2,411,862.00	2.46

26	001914	招商积余	2,392,027.00	2.44
27	600566	济川药业	2,362,361.00	2.41
28	601231	环旭电子	2,341,184.00	2.39
29	601872	招商轮船	2,338,796.36	2.39
30	688088	虹软科技	2,328,363.85	2.38
31	600339	中油工程	2,319,663.00	2.37
32	002152	广电运通	2,298,634.00	2.35
33	002249	大洋电机	2,297,957.00	2.35
34	600131	国网信通	2,248,565.00	2.30
35	002056	横店东磁	2,225,768.00	2.27
36	000997	新大陆	2,217,798.00	2.27
37	601016	节能风电	2,206,792.00	2.25
38	600271	航天信息	2,199,786.00	2.25
39	600563	法拉电子	2,197,501.00	2.24
40	600582	天地科技	2,175,988.14	2.22
41	002434	万里扬	2,134,778.00	2.18
42	600901	江苏金租	2,129,874.00	2.18
43	300390	天华新能	2,128,831.00	2.17
44	600970	中材国际	2,113,039.00	2.16
45	688188	柏楚电子	2,103,106.44	2.15
46	600642	申能股份	2,100,332.00	2.15
47	002409	雅克科技	2,077,060.00	2.12
48	601992	金隅集团	2,066,111.00	2.11
49	000988	华工科技	2,062,122.00	2.11
50	000598	兴蓉环境	2,058,891.00	2.10
51	600820	隧道股份	2,049,268.00	2.09
52	688779	长远锂科	2,048,135.10	2.09
53	300418	昆仑万维	2,046,003.74	2.09
54	603228	景旺电子	2,045,496.00	2.09
55	688289	圣湘生物	2,037,710.55	2.08
56	688690	纳微科技	2,026,767.28	2.07
57	002563	森马服饰	2,024,854.00	2.07
58	600597	光明乳业	2,022,272.00	2.07
59	000728	国元证券	2,021,342.00	2.06
60	600839	四川长虹	2,012,983.00	2.06
61	601168	西部矿业	2,010,727.00	2.05
62	600867	通化东宝	2,004,277.00	2.05
63	600959	江苏有线	1,977,958.00	2.02

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出	占期初基金资产净值比例
----	------	------	--------	-------------

			金额	(%)
1	300308	中际旭创	4,457,112.00	4.55
2	688063	派能科技	3,945,580.31	4.03
3	688390	固德威	3,653,931.47	3.73
4	601598	中国外运	3,210,380.18	3.28
5	300604	长川科技	3,179,053.90	3.25
6	601699	潞安环能	3,178,739.35	3.25
7	300115	长盈精密	3,128,177.80	3.20
8	300568	星源材质	3,105,810.00	3.17
9	002353	杰瑞股份	2,918,439.00	2.98
10	300017	网宿科技	2,912,589.57	2.98
11	600528	中铁工业	2,839,269.90	2.90
12	603688	石英股份	2,813,073.00	2.87
13	600060	海信视像	2,797,412.00	2.86
14	601231	环旭电子	2,726,389.00	2.78
15	600968	海油发展	2,684,630.00	2.74
16	600901	江苏金租	2,672,862.00	2.73
17	600895	张江高科	2,618,295.00	2.67
18	603228	景旺电子	2,596,051.00	2.65
19	600259	广晟有色	2,594,368.00	2.65
20	600566	济川药业	2,590,559.00	2.65
21	688208	道通科技	2,555,269.60	2.61
22	688088	虹软科技	2,532,490.35	2.59
23	688521	芯原股份	2,501,139.55	2.55
24	002625	光启技术	2,486,399.00	2.54
25	002409	雅克科技	2,482,952.00	2.54
26	600623	华谊集团	2,440,569.00	2.49
27	300390	天华新能	2,420,250.00	2.47
28	600160	巨化股份	2,409,497.00	2.46
29	000878	云南铜业	2,333,665.00	2.38
30	002081	金螳螂	2,314,880.00	2.36
31	600820	隧道股份	2,311,347.00	2.36
32	002690	美亚光电	2,307,912.00	2.36
33	000563	陕国投 A	2,303,528.00	2.35
34	603927	中科软	2,298,314.40	2.35
35	000629	钒钛股份	2,261,826.00	2.31
36	000997	新大陆	2,259,175.00	2.31
37	601872	招商轮船	2,252,232.00	2.30
38	002273	水晶光电	2,232,127.00	2.28
39	001914	招商积余	2,230,908.74	2.28
40	688006	杭可科技	2,223,704.51	2.27
41	600563	法拉电子	2,214,148.00	2.26
42	600339	中油工程	2,203,103.00	2.25



43	601016	节能风电	2,183,728.00	2.23
44	002249	大洋电机	2,181,130.00	2.23
45	600728	佳都科技	2,169,802.96	2.22
46	300418	昆仑万维	2,162,431.00	2.21
47	600373	中文传媒	2,151,710.00	2.20
48	300373	扬杰科技	2,114,930.00	2.16
49	000999	华润三九	2,112,711.00	2.16
50	603605	珀莱雅	2,081,247.20	2.13
51	603317	天味食品	2,079,596.00	2.12
52	601717	郑煤机	2,078,808.00	2.12
53	002434	万里扬	2,075,858.00	2.12
54	002056	横店东磁	2,073,504.00	2.12
55	603056	德邦股份	2,065,224.00	2.11
56	300182	捷成股份	2,064,808.00	2.11
57	000728	国元证券	2,059,492.47	2.10
58	688690	纳微科技	2,059,176.18	2.10
59	600499	科达制造	2,056,030.00	2.10
60	600879	航天电子	2,048,082.00	2.09
61	002407	多氟多	2,047,547.34	2.09
62	600166	福田汽车	2,031,111.00	2.07
63	603345	安井食品	2,021,587.68	2.07
64	600959	江苏有线	2,012,677.00	2.06
65	300699	光威复材	2,001,303.00	2.04
66	601992	金隅集团	2,000,928.00	2.04
67	603719	良品铺子	1,990,422.00	2.03
68	002152	广电运通	1,987,901.00	2.03
69	000050	深天马 A	1,987,325.00	2.03
70	002738	中矿资源	1,983,299.20	2.03
71	600699	均胜电子	1,982,650.46	2.03
72	688188	柏楚电子	1,974,509.54	2.02
73	601168	西部矿业	1,974,329.00	2.02
74	000060	中金岭南	1,960,206.50	2.00

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	729,151,517.85
卖出股票收入（成交）总额	730,425,500.18

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包含国债期货，无相关投资政策。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

## 7.12 投资组合报告附注

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

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

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

无。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	479,842.45
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	84,194.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	564,037.20

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限的情况。

##### 7.12.5.2 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未存在流通受限的情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
兴银中证 500 指数增强 A	1,855	17,910.23	0.00	0.00%	33,223,484.25	100%
兴银中证 500 指数增强 C	18,198	3,728.09	0.00	0.00%	67,843,750.79	100%
合计	20,053	5,040.01	0.00	0.00%	101,067,235.04	100%

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	兴银中证 500 指数增强 A	35,039.46	0.105466%
	兴银中证 500 指数增强 C	54,531.08	0.080377%
	合计	89,570.54	0.088625%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	兴银中证 500 指数增强 A	0
	兴银中证 500 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	兴银中证 500 指数增强 A	0~10
	兴银中证 500 指数增强 C	0
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	兴银中证 500 指数 增强 A	兴银中证 500 指数 增强 C
基金合同生效日（2021 年 03 月 01 日）基金份额总额	120,603,411.79	143,434,150.49
本报告期期初基金份额总额	34,892,385.20	72,783,095.56
本报告期基金总申购份额	2,449,839.82	11,377,470.99
减：本报告期基金总赎回份额	4,118,740.77	16,316,815.76
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	33,223,484.25	67,843,750.79

## § 10 重大事件揭示

## 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 2023 年 2 月 28 日，郑瑞健担任基金管理人督察长。

(2) 2023 年 5 月 26 日, 吴若曼担任基金管理人董事长、法定代表人, 张贵云不再担任基金管理人董事长、法定代表人。

(3) 基金托管人于 2023 年 5 月 17 日发布公告, 自 2023 年 5 月 10 日起丁文忠先生不再担任基金托管部门总经理; 自 2023 年 5 月 10 日起聘任赵刚先生为基金托管部门总经理。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

无。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙), 报告期内无改聘情况。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 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, 基金管理人及其高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注: 本报告期内, 本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位: 人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
民生证券	2	615,998,937.27	42.20%	142,482.98	43.51%	-
广发证券	2	373,947,845.87	25.62%	86,511.63	26.42%	-
华福证券	2	266,974,048.58	18.29%	61,751.00	18.86%	-
招商证券	2	202,656,186.31	13.88%	36,749.53	11.22%	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-

渤海证 券	2	-	-	-	-	-
----------	---	---	---	---	---	---

注：1、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。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	公司旗下部分产品在众惠基金、泰信财富、博时财富上线同时开通转换、定投、参与费率优惠活动并公告	中国证券报、证券时报、证券日报、上海证券报、指定网站	2023-01-12
2	兴银中证 500 指数增强型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	指定网站	2023-01-20
3	兴银基金管理有限责任公司旗下部分基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报	2023-01-20
4	兴银中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、指定网站	2023-02-24
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	2023-03-01
6	兴银基金管理有限责任公司旗下部分基金 2022 年年度报告提示性公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报	2023-03-30
7	兴银中证 500 指数增强型证券投资基金 2022 年年度报告	指定网站	2023-03-30
8	关于旗下基金参与江海证券费率优惠活动并开通定期定额投资的公告	中国证券报、证券时报、证券日报、上海证券报、指定网站	2023-04-17
9	关于旗下基金参与攀赢基金费率优惠活动并公告	中国证券报、证券时报、证券日报、上海证券报、指定网站	2023-04-22
10	兴银基金管理有限责任公司旗下基金 2023 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	2023-04-22
11	兴银中证 500 指数增强型证券	指定网站	2023-04-22

	投资基金 2023 年第 1 季度报告		
12	关于旗下部分基金在华西证券开通定期定额投资的公告	中国证券报、证券时报、证券日报、上海证券报、指定网站	2023-05-27
13	兴银基金管理有限责任公司关于董事长变更的公告	中国证券报、证券时报、证券日报、上海证券报、指定网站	2023-05-27
14	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	2023-06-21

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期内单一投资者持有基金份额比例未出现超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予兴银中证 500 指数增强型证券投资基金变更注册的文件
2. 《兴银中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》
3. 《兴银中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》
4. 《兴银中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照
6. 报告期内在指定信息披露媒体上公开披露的各项公告

### 12.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处。

### 12.3 查阅方式

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

兴银基金管理有限责任公司

二〇二三年八月三十日