

# 兴银中证 1000 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:平安银行股份有限公司

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。

基金托管人平安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.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产(基金净值)变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>44</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	45
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.....	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	66
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	68
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.....	68
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.....	68
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.....	68
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.....	68
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	68
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	68

7.12 投资组合报告附注.....	68
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>69</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	69
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	70
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.....	70
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>70</b>
<b>§ 10 重大事件揭示.....</b>	<b>70</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	71
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.....	71
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	71
10.4 基金投资策略的改变.....	71
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	71
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.....	71
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	71
10.8 其他重大事件.....	72
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>73</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.....	73
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	73
<b>§ 12 备查文件目录.....</b>	<b>73</b>
12.1 备查文件目录.....	73
12.2 存放地点.....	73
12.3 查阅方式.....	73

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	兴银中证 1000 指数增强	
基金主代码	014831	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 01 月 26 日	
基金管理人	兴银基金管理有限责任公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	247,163,413.31 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	兴银中证 1000 指数增强 A	兴银中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	014831	014832
报告期末下属分级基金的份额总额	143,440,559.31 份	103,722,854.00 份

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	兴银基金管理有限责任公司	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郑瑞健
	联系电话	86-21-20296277
	电子邮箱	zhengrj@hffunds.cn
客户服务电话	40000-96326	95511-3
传真	86-21-68630069	0755-82080387
注册地址	平潭综合实验区金井湾商务营运中心 6 号楼 11 层 03-3 房	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址	中国上海市浦东新区滨江大道 5129 号陆家嘴滨江中心 N1 幢三层、五层	广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座 26 楼
邮政编码	200120	518001
法定代表人	吴若曼	谢永林

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金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 1000 指数增强 A	兴银中证 1000 指数增强 C
本期已实现收益	4,264,960.01	2,852,160.96
本期利润	10,088,114.00	7,109,093.35
加权平均基金份额本期利润	0.0667	0.0662
本期加权平均净值利润率	7.37%	7.33%
本期基金份额净值增长率	7.05%	6.93%
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	-13,836,384.34	-10,269,171.92

期末可供分配基金份额利润	-0.0965	-0.0990
期末基金资产净值	130,056,236.52	93,779,087.67
期末基金份额净值	0.9067	0.9041
<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	-9.33%	-9.59%

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 1000 指数增强 A 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.08%	0.88%	0.59%	0.99%	1.49%	-0.11%
过去三个月	-0.83%	0.77%	-3.77%	0.87%	2.94%	-0.10%
过去六个月	7.05%	0.78%	4.87%	0.84%	2.18%	-0.06%
过去一年	-11.77%	1.02%	-5.27%	1.05%	-6.50%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-9.33%	1.23%	-6.91%	1.31%	-2.42%	-0.08%

#### 兴银中证 1000 指数增强 C 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.05%	0.88%	0.59%	0.99%	1.46%	-0.11%
过去三个月	-0.89%	0.77%	-3.77%	0.87%	2.88%	-0.10%
过去六个月	6.93%	0.78%	4.87%	0.84%	2.06%	-0.06%
过去一年	-11.96%	1.02%	-5.27%	1.05%	-6.69%	-

						0.03%
自基金合同生效起至今	-9.59%	1.23%	-6.91%	1.31%	-2.68%	-0.08%

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

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2022年01月26日-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  
(2022年01月26日-2023年06月30日)



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



### 3.3 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	2022- 01-26	-	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。

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

通过多因子选股模型，因子主要涵盖行业、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，同时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，在兼顾股票本身流动性和风险分散度的基础上构建股票投资组合。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，并严格按照策略执行交易管理及风控，力争为投资者带来长期稳定的资本增值回报。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴银中证 1000 指数增强 A 基金份额净值为 0.9067 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 7.05%，同期业绩比较基准收益率为 4.87%；截至报告期末兴银中证 1000 指数增强 C 基金份额净值为 0.9041 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 6.93%，同期业绩比较基准收益率为 4.87%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

##### 1、政策重心或将转向扩大需求，消费有望增长

今年全国两会提出的 GDP 增速目标为 5%左右，对应的两年复合增速为 4%，均较为稳健。从 7 月底政治局会议表态来看，“要积极扩大国内需求，通过终端需求带动有效供给”，意味着下半年政策重心或将从保障供给转向扩大需求。在此背景下，未来消费或将有更多结构性支持。7 月 24 日政治局会议指出“发挥消费拉动经济增长的基础性作用，通过增加居民收入扩大消费”、“提振汽车、电子产品、家居等大宗消费，推动体育休闲、文化旅游等服务消费”，7 月 31 日发改委印发《关于恢复和扩大消费措施的通知》，在相关政策的呵护下，预计下半年大宗消费有望得到提振，而服务消费或将保持稳定增长。

##### 2、降息周期重启，预计人民币汇率后续难以持续贬值

6 月初央行重提“逆周期调节”，国有大行和股份制银行先后下调存款利率，紧随其后的是 OMO 利率、MLF 利率和 LPR 利率的相继下调，这些事件标志着新一轮降息周期重启，监管部门意在通过价格工具引导资金进入实体。下半年宽货币向宽信用的传导仍然任重道远，降准降息的必要性依然较高。

2023 年初以来，美元兑人民币汇率从 6.7 左右较快上行至 7.2 以上，并对相关资产价格造成一定扰动。面对这一情况，为了引导人民币汇率双向波动，央行已经通过公开市场喊话一逆周期因子调节一动用外汇调控工具箱三部曲稳定汇率，加上美联储加息周期接近尾声，预计后续汇率贬值空间相对有限。人民币汇率保持稳定也为央行降准降息创造了有利条件。

### 3、财政政策展望

下半年财政或将“先提速、后加量”。首先是政府发债提速，截至 7 月 23 日，新增一般债、专项债仍有 2429 亿、1.3 万亿待发行空间，国债也仍有 1.8 万亿净融资空间，后续发行有望提速。其次是类财政工具，参考去年经验，政策性金融工具或是地方债基本发行完毕后的关键增量工具。

### 4、PMI 有望上行

当前国内需求复苏信号明确，去库存压力边际缓解，预计将推动下半年制造业 PMI 稳步上行。但与此同时，美国、欧元区等海外主要经济体衰退风险加剧，外需趋于回落，或将降低制造业 PMI 回升斜率。非制造业方面，国内服务业修复空间仍大，同时，近期决策层对房地产业呵护态度明显增强，预计将抬升建筑业 PMI 水平。综上，预计下半年非制造业 PMI 将继续保持在扩张区间。

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

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

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

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

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

### § 6 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 1000 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	2,700,244.26	4,435,449.19
结算备付金		19,295,469.36	33,851,871.38
存出保证金		1,104,566.40	3,204,228.00

交易性金融资产	6.4.7.2	201,170,831.28	198,962,519.61
其中：股票投资		201,170,831.28	198,962,519.61
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	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		79,742.66	848,870.87
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		224,350,853.96	241,302,939.05
<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		-	-
应付赎回款		217,699.64	19,738.73
应付管理人报酬		145,016.57	166,270.57
应付托管费		36,254.12	41,567.61
应付销售服务费		15,197.50	17,065.90
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	101,361.94	171,781.39
负债合计		515,529.77	416,424.20
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	247,163,413.31	284,606,084.95
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-23,328,089.12	-43,719,570.10

净资产合计		223,835,324.19	240,886,514.85
负债和净资产总计		224,350,853.96	241,302,939.05

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 247,163,413.31 份。其中兴银中证 1000 指数增强 A 基金份额净值 0.9067 元，基金份额总额 143,440,559.31 份；兴银中证 1000 指数增强 C 基金份额净值 0.9041 元，基金份额总额 103,722,854.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：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 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 06 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		18,539,035.53	1,877,668.74
1. 利息收入		97,438.05	328,606.63
其中：存款利息收入	6.4.7.9	97,438.05	319,582.34
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	9,024.29
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		8,220,683.25	-12,493,636.53
其中：股票投资收益	6.4.7.10	5,561,208.81	-13,497,027.36
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	732,019.03	143,887.38
股利收益	6.4.7.15	1,927,455.41	859,503.45
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	10,080,086.38	13,904,695.51
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	140,827.85	138,003.13
<b>减：二、营业总支出</b>		1,341,828.18	1,179,453.33

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	928,366.24	814,226.58
2. 托管费	6.4.10.2.2	232,091.59	203,556.69
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	96,206.21	71,218.60
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		4,085.19	468.74
8. 其他费用	6.4.7.18	81,078.95	89,982.72
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		17,197,207.35	698,215.41
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		17,197,207.35	698,215.41
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	0
<b>六、综合收益总额</b>		17,197,207.35	698,215.41

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：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）	284,606,084.95	-	43,719,570.10	240,886,514.85
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）	284,606,084.95	-	43,719,570.10	240,886,514.85
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-37,442,671.64	-	20,391,480.98	-17,051,190.66
（一）、综合收益总额	-	-	17,197,207.35	17,197,207.35
（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）	-37,442,671.64	-	3,194,273.63	-34,248,398.01
其中：1. 基金申购款	56,091,303.22	-	-5,261,671.29	50,829,631.93
2. 基金赎回款	-93,533,974.86	-	8,455,944.92	-85,078,029.94
（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)	247,163,413.31	-	- 23,328,089.12	223,835,324.19
项目	上年度可比期间 2022 年 01 月 26 日(基金合同生效日)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)	-	-	-	-
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	268,420,575.82	-	-	268,420,575.82
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-29,932,946.74	-	6,544,323.90	-23,388,622.84
(一)、综合收益总额	-	-	698,215.41	698,215.41
(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)	-29,932,946.74	-	5,846,108.49	-24,086,838.25
其中: 1. 基金申购款	66,753,649.02	-	-1,213,430.34	65,540,218.68
2. 基金赎回款	-96,686,595.76	-	7,059,538.83	-89,627,056.93
(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)	238,487,629.08	-	6,544,323.90	245,031,952.98

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 1000 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会

2021 年 12 月 28 日证监许可（2021）4124 号变更注册募集。《兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2022 年 1 月 26 日正式生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，本基金首次募集规模为人民币 268,420,575.82 份基金份额。本基金的基金管理人为兴银基金管理有限责任公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。

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

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。本基金的业绩比较基准：中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度和中期报告〉》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》及附注 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、自 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

本半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

#### 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	2,700,244.26
等于：本金	2,700,095.01
加：应计利息	149.25
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	2,700,244.26

#### 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	199,571,911.26	-	201,170,831.28	1,598,920.02
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	199,571,911.26	-	201,170,831.28	1,598,920.02

#### 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	9,126,320.00	0.00	-	-
—股指期货	9,126,320.00	0.00	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	9,126,320.00	-	-	-

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
IM2307	IM2307	7	9,204,720.00	78,400.00
合计				78,400.00
减：可抵销期货暂收款				78,400.00
净额				0.00

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金于本报告期末未持有任何买入返售金融资产。

#### 6.4.7.5 其他资产

注：本基金于本报告期末未持有任何其他资产。

#### 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	244.69
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	81,078.95
其他应付	20,038.30
合计	101,361.94

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 兴银中证 1000 指数增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 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	165,443,457.50	165,443,457.50
本期申购	20,602,916.86	20,602,916.86
本期赎回（以“-”号填列）	-42,605,815.05	-42,605,815.05
本期末	143,440,559.31	143,440,559.31

## 兴银中证 1000 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	119,162,627.45	119,162,627.45
本期申购	35,488,386.36	35,488,386.36
本期赎回（以“-”号填列）	-50,928,159.81	-50,928,159.81
本期末	103,722,854.00	103,722,854.00

## 6.4.7.8 未分配利润

## 兴银中证 1000 指数增强 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-20,138,518.05	-5,168,028.76	-25,306,546.81
本期利润	4,264,960.01	5,823,153.99	10,088,114.00
本期基金份额交易产生的变动数	2,037,173.70	-203,063.68	1,834,110.02
其中：基金申购款	-1,796,951.17	-91,274.73	-1,888,225.90
基金赎回款	3,834,124.87	-111,788.95	3,722,335.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-13,836,384.34	452,061.55	-13,384,322.79

## 兴银中证 1000 指数增强 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-14,697,369.59	-3,715,653.70	-18,413,023.29
本期利润	2,852,160.96	4,256,932.39	7,109,093.35
本期基金份额交易产生的变动数	1,576,036.71	-215,873.10	1,360,163.61
其中：基金申购款	-3,272,719.26	-100,726.13	-3,373,445.39
基金赎回款	4,848,755.97	-115,146.97	4,733,609.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-10,269,171.92	325,405.59	-9,943,766.33

## 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	4,505.12
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	92,932.93
其他	-
合计	97,438.05

#### 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	1,859,739,794.27
减：卖出股票成本总额	1,851,377,665.83
减：交易费用	2,800,919.63
买卖股票差价收入	5,561,208.81

#### 6.4.7.11 债券投资收益

注：本基金在本报告期内无债券投资收益。

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

注：本基金在本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

注：本基金在本报告期内无贵金属投资收益。

#### 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：本基金在本报告期内无衍生工具收益买卖权证差价收入。

##### 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	777,460.00
减：其他衍生工具收益应缴纳增值税	40,851.85
减：交易费用	4,589.12
合计	732,019.03

#### 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	1,927,455.41



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	1,927,455.41

## 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	9,635,286.38
——股票投资	9,635,286.38
——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	444,800.00
——权证投资	-
——期货投资	444,800.00
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	10,080,086.38

## 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	140,228.66
转换费收入	599.19
合计	140,827.85

## 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	21,571.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
合计	81,078.95

## 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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

#### 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
平安银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
华福证券有限责任公司(以下简称“华福证券”)	基金管理人的股东
兴银基金管理有限责任公司(以下简称“兴银基金”)	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
上海兴瀚资产管理有限公司(以下简称“上海兴瀚”)	基金管理人的全资子公司
国脉科技股份有限公司	基金管理人的股东

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 26 日（基金合同生效日）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	3,700,093,801.94	100.00%	5,722,859,317.05	100.00%

###### 6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期以及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

注：本基金本报告期以及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

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 26 日（基金合同生效日）至 2022 年
-------	---------------------------------------	---

	06 月 30 日			
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
华福证券	-	-	120,000,000.00	100.00%

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

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	925,204.59	100.00%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 01 月 26 日（基金合同生效日）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	1,717,158.42	100.00%	0.00	0.00%

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

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

#### 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 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	928,366.24	814,226.58
其中：支付销售机构的客户维护费	457,497.37	389,256.87

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 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 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	232,091.59	203,556.69

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 1000 指数增强 A	兴银中证 1000 指数增强 C	合计
平安银行	-	746.86	746.86
华福证券	-	91,860.83	91,860.83
合计	-	92,607.69	92,607.69
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 26 日（基金合同生效日）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 1000 指数增强 A	兴银中证 1000 指数增强 C	合计
平安银行	-	16.48	16.48
华福证券	-	64,575.61	64,575.61
兴银基金	-	4,692.92	4,692.92
合计	-	69,285.01	69,285.01

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

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

**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固有资金投资本基金的情况**

注：本基金的管理人在本报告期内未运用固有资金投资本基金。

**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 26 日（基金合同生效日）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
平安银行股份有限公司	2,700,244.26	4,505.12	8,093,057.25	12,303.65

注：本基金通过“平安银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于华福证券有限责任公司的结算备付金，于 2023 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 9,821,921.54 元。

**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：本基金在本报告期末未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

无。

**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**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代 码	证 券	成功 认购	受限 期	流 通	认购价 格	期末估 值单价	数量 (单	期末成本总 额	期末估值总 额	备 注

	名称	日		受限类型			位: 股)			
688343	云天励飞	2023年03月28日	6个月	科创板新股锁定	43.92	50.67	3,827	168,081.84	193,914.09	-
301486	致尚科技	2023年06月30日	6个交易日	新股流通受限	57.66	57.66	1,498	86,374.68	86,374.68	-
301395	仁信新材	2023年06月21日	7个交易日	新股流通受限	26.68	26.68	2,532	67,553.76	67,553.76	-
301292	海科新源	2023年06月29日	7个交易日	新股流通受限	19.99	19.99	3,179	63,548.21	63,548.21	-
688603	天承科技	2023年06月30日	7个交易日	新股流通受限	55.00	55.00	1,125	61,875.00	61,875.00	-
301488	豪恩汽电	2023年06月26日	7个交易日	新股流通受限	39.78	39.78	1,548	61,579.44	61,579.44	-
301261	恒工精	2023年06月29日	8个交易日	新股流	36.90	36.90	1,192	43,984.80	43,984.80	-

	密	日		通受限						
301202	朗威股份	2023年06月28日	6个交易日	新股流通受限	25.82	25.82	1,676	43,274.32	43,274.32	-
688361	中科飞测	2023年05月12日	6个月	科创板新股锁定	23.60	64.67	216	5,097.60	13,968.72	-
301325	曼恩斯特	2023年05月04日	6个月	创业板新股锁定	76.80	107.95	128	9,830.40	13,817.60	-
688472	阿特斯	2023年06月02日	6个月	科创板新股锁定	11.10	17.04	786	8,724.60	13,393.44	-
688443	智翔金泰	2023年06月13日	6个月	科创板新股锁定	37.88	29.49	416	15,758.08	12,267.84	-
688562	航天软件	2023年05月15日	6个月	科创板新股锁定	12.68	22.31	447	5,667.96	9,972.57	-

301486	致尚科技	2023年06月30日	6个月	创业板新股锁定	57.66	57.66	167	9,629.22	9,629.22	-
688629	华丰科技	2023年06月16日	6个月	科创板新股锁定	9.26	18.59	512	4,741.12	9,518.08	-
688582	芯动联科	2023年06月21日	6个月	科创板新股锁定	26.74	40.68	232	6,203.68	9,437.76	-
301246	宏源药业	2023年03月10日	6个月	创业板新股锁定	50.00	30.71	286	14,300.00	8,783.06	-
688484	南芯科技	2023年03月28日	6个月	科创板新股锁定	39.99	36.71	229	9,157.71	8,406.59	-
301408	华人健康	2023年02月22日	6个月	创业板新股锁定	16.24	16.95	490	7,957.60	8,305.50	-
688535	华海	2023年03	6个月	科创	35.00	51.23	150	5,250.00	7,684.50	-



	诚科	月 28 日		板新股锁定						
688458	美芯晟	2023 年 05 月 15 日	6 个月	科创板新股锁定	75.00	90.76	84	6,300.00	7,623.84	-
301395	仁信新材	2023 年 06 月 21 日	6 个月	创业板新股锁定	26.68	26.68	282	7,523.76	7,523.76	-
301225	恒勃股份	2023 年 06 月 08 日	6 个月	创业板新股锁定	35.66	33.26	226	8,059.16	7,516.76	-
301295	美硕科技	2023 年 06 月 19 日	6 个月	创业板新股锁定	37.40	36.07	206	7,704.40	7,430.42	-
301292	海科新源	2023 年 06 月 29 日	6 个月	创业板新股锁定	19.99	19.99	354	7,076.46	7,076.46	-
688603	天承科技	2023 年 06 月 30 日	6 个月	科创板新	55.00	55.00	126	6,930.00	6,930.00	-

				股 锁 定						
688334	西 高 院	2023 年 06 月 09 日	6 个月	科 创 板 新 股 锁 定	14.16	16.21	426	6,032.16	6,905.46	-
301488	豪 恩 汽 电	2023 年 06 月 26 日	6 个月	创 业 板 新 股 锁 定	39.78	39.78	172	6,842.16	6,842.16	-
301305	朗 坤 环 境	2023 年 05 月 15 日	6 个月	创 业 板 新 股 锁 定	25.25	19.69	322	8,130.50	6,340.18	-
301376	致 欧 科 技	2023 年 06 月 14 日	6 个月	创 业 板 新 股 锁 定	24.66	22.51	269	6,633.54	6,055.19	-
301157	华 塑 科 技	2023 年 03 月 01 日	6 个月	创 业 板 新 股 锁 定	56.50	52.93	114	6,441.00	6,034.02	-
301262	海 看 股 份	2023 年 06 月 13 日	6 个月	创 业 板 新 股 锁 定	30.22	25.50	236	7,131.92	6,018.00	-

				定						
301232	飞沃科技	2023年06月08日	6个月	创业板新股锁定	72.50	58.42	103	7,467.50	6,017.26	-
301281	科源制药	2023年03月28日	6个月	创业板新股锁定	44.18	25.10	238	7,510.60	5,973.80	-
301332	德尔玛	2023年05月09日	6个月	创业板新股锁定	14.81	13.73	434	6,427.54	5,958.82	-
688581	安杰思	2023年05月12日	6个月	科创板新股锁定	125.80	118.03	50	6,290.00	5,901.50	-
301386	未来电器	2023年03月21日	6个月	创业板新股锁定	29.99	23.79	244	7,317.56	5,804.76	-
301439	泓淋电力	2023年03月10日	6个月	创业板新股锁定	19.99	16.90	339	6,776.61	5,729.10	-
301428	世	2023	6个月	创	26.35	30.60	186	4,901.10	5,691.60	-

	纪恒通	年 05 月 10 日		业板新股锁定							
301210	金杨股份	2023 年 06 月 21 日	6 个月	创业板新股锁定	57.88	49.17	112	6,482.56	5,507.04	-	
301322	绿通科技	2023 年 02 月 27 日	6 个月	创业板新股锁定	131.11	53.24	102	8,915.48	5,430.48	-	
688570	天玛智控	2023 年 05 月 29 日	6 个月	科创板新股锁定	30.26	25.33	208	6,294.08	5,268.64	-	
301323	新莱福	2023 年 05 月 29 日	6 个月	创业板新股锁定	39.06	39.36	131	5,116.86	5,156.16	-	
301261	恒工精密	2023 年 06 月 29 日	6 个月	创业板新股锁定	36.90	36.90	133	4,907.70	4,907.70	-	
688631	莱斯信	2023 年 06 月 19 日	6 个月	科创板	25.28	29.87	163	4,120.64	4,868.81	-	

	息	日		新股 锁定							
688623	双 元 科 技	2023 年 05 月 31 日	6 个月	科 创 板 新 股 锁 定	125.88	86.79	56	7,049.28	4,860.24	-	
301337	亚 华 电 子	2023 年 05 月 16 日	6 个月	创 业 板 新 股 锁 定	32.60	30.37	160	5,216.00	4,859.20	-	
301202	朗 威 股 份	2023 年 06 月 28 日	6 个月	创 业 板 新 股 锁 定	25.82	25.82	187	4,828.34	4,828.34	-	
688429	时 创 能 源	2023 年 06 月 20 日	6 个月	科 创 板 新 股 锁 定	19.20	25.53	189	3,628.80	4,825.17	-	
301345	涛 涛 车 业	2023 年 03 月 10 日	6 个月	创 业 板 新 股 锁 定	73.45	46.64	97	7,124.65	4,524.08	-	
688479	友 车 科 技	2023 年 05 月 04 日	6 个月	科 创 板 新 股	33.99	29.49	144	4,894.56	4,246.56	-	

				锁定						
001282	三联锻造	2023年05月15日	6个月	股票流通受限	27.93	33.03	74	2,066.82	2,444.22	-
001324	长青科技	2023年05月12日	6个月	股票流通受限	18.88	19.60	107	2,020.16	2,097.20	-
603172	万丰股份	2023年04月28日	6个月	股票流通受限	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

##### 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：本基金本报告期末和上年度末未持有需按长期信用评级列示的债券投资。

##### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有需按长期信用评级列示的资产支持证券。

##### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有需按长期信用评级列示的同业存单。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来

自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持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	2,700,244.26	-	-	-	-	-	2,700,244.26
结算备付金	19,295,469.36	-	-	-	-	-	19,295,469.36
存出保证金	1,104,566.40	-	-	-	-	-	1,104,566.40
交易性金融资产	-	-	-	-	-	201,170,831.28	201,170,831.28
应收申购款	-	-	-	-	-	79,742.66	79,742.66
资产总计	23,100,280.02	-	-	-	-	201,250,573.94	224,350,853.96
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	217,699.64	217,699.64
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	145,016.57	145,016.57
应付托管费	-	-	-	-	-	36,254.12	36,254.12
应付销售服务费	-	-	-	-	-	15,197.50	15,197.50
其他负债	-	-	-	-	-	101,361.94	101,361.94
负债总计	-	-	-	-	-	515,529.77	515,529.77
利率敏感度缺口	23,100,280.02	-	-	-	-	200,735,044.17	223,835,324.19
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	4,435,449.19	-	-	-	-	-	4,435,449.19

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除利率之外的其他市场变量保持不变；		
	该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券与可交换债券。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	-	-
	市场利率下降 25 个基点	-	-

注：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。

##### 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	201,170,831.28	89.87	198,962,519.61	82.60
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	201,170,831.28	89.87	198,962,519.61	82.60

##### 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%	7,459,428.35	9,365,123.17
	沪深 300 指数下跌 5%	-7,459,428.35	-9,365,123.17

#### 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	200,234,377.31	198,323,297.01
第二层次	475,927.85	-
第三层次	460,526.12	639,222.60
合计	201,170,831.28	198,962,519.61

##### 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	201,170,831.28	89.67
	其中：股票	201,170,831.28	89.67
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	21,995,713.62	9.80
8	其他各项资产	1,184,309.06	0.53
9	合计	224,350,853.96	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	1,011,350.00	0.45
B	采矿业	5,266,830.00	2.35
C	制造业	106,408,137.66	47.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,772,226.00	3.03
E	建筑业	1,903,194.00	0.85
F	批发和零售业	6,537,629.90	2.92
G	交通运输、仓储和邮政业	4,687,978.60	2.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,444,332.42	6.01
J	金融业	4,023,151.10	1.80
K	房地产业	6,460,363.00	2.89
L	租赁和商务服务业	1,507,388.10	0.67
M	科学研究和技术服务业	1,536,916.92	0.69
N	水利、环境和公共设施管理业	2,016,584.93	0.90
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	657,720.00	0.29
R	文化、体育和娱乐业	2,076,527.00	0.93
S	综合	-	-
	合计	164,310,329.63	73.41

### 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	168,520.00	0.08
B	采矿业	361,286.00	0.16
C	制造业	27,514,461.38	12.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应	994,375.00	0.44

	业		
E	建筑业	317,346.60	0.14
F	批发和零售业	432,498.69	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	1,768,999.00	0.79
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,683,683.95	0.75
J	金融业	1,099,710.00	0.49
K	房地产业	897,957.00	0.40
L	租赁和商务服务业	342,857.00	0.15
M	科学研究和技术服务业	182,051.14	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	733,447.89	0.33
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	72,360.00	0.03
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	290,948.00	0.13
S	综合	-	-
	合计	36,860,501.65	16.47

### 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	001696	宗申动力	302,500	2,141,700.00	0.96
2	600578	京能电力	433,100	1,693,421.00	0.76
3	603368	柳药集团	65,100	1,608,621.00	0.72
4	000685	中山公用	188,100	1,423,917.00	0.64
5	601918	新集能源	330,700	1,405,475.00	0.63
6	000921	海信家电	49,100	1,323,245.00	0.59
7	002484	江海股份	61,500	1,309,335.00	0.58
8	601567	三星医疗	102,400	1,293,312.00	0.58
9	600612	老凤祥	17,800	1,243,864.00	0.56
10	002367	康力电梯	129,500	1,182,335.00	0.53
11	002697	红旗连锁	196,500	1,147,560.00	0.51
12	300185	通裕重工	399,700	1,115,163.00	0.50
13	002011	盾安环境	78,700	1,088,421.00	0.49
14	600007	中国国贸	58,600	1,085,272.00	0.48
15	603279	景津装备	33,900	1,063,104.00	0.47
16	300332	天壕环境	90,700	1,040,329.00	0.46
17	000969	安泰科技	108,836	1,030,676.92	0.46
18	002320	海峡股份	170,200	1,028,008.00	0.46
19	600323	瀚蓝环境	54,001	1,022,238.93	0.46

20	000885	城发环境	76,800	1,022,208.00	0.46
21	002351	漫步者	48,800	1,009,184.00	0.45
22	002664	信质集团	71,000	999,680.00	0.45
23	002929	润建股份	23,000	998,430.00	0.45
24	000811	冰轮环境	61,800	973,968.00	0.44
25	002085	万丰奥威	140,000	970,200.00	0.43
26	603766	隆鑫通用	180,500	953,040.00	0.43
27	300224	正海磁材	73,600	946,496.00	0.42
28	603328	依顿电子	113,800	942,264.00	0.42
29	600510	黑牡丹	154,700	939,029.00	0.42
30	002158	汉钟精机	37,600	938,496.00	0.42
31	601702	华峰铝业	68,400	935,712.00	0.42
32	600572	康恩贝	136,400	934,340.00	0.42
33	601137	博威合金	59,700	928,932.00	0.42
34	603989	艾华集团	44,100	928,746.00	0.41
35	002636	金安国纪	98,400	908,232.00	0.41
36	600929	雪天盐业	113,500	901,190.00	0.40
37	600602	云赛智联	59,559	896,958.54	0.40
38	603466	风语筑	63,500	882,650.00	0.39
39	002130	沃尔核材	108,700	882,644.00	0.39
40	600850	电科数字	37,100	875,189.00	0.39
41	000913	钱江摩托	47,600	867,748.00	0.39
42	600508	上海能源	58,200	854,376.00	0.38
43	300762	上海瀚讯	71,900	846,263.00	0.38
44	688389	普门科技	36,000	845,640.00	0.38
45	002832	比音勒芬	23,600	835,676.00	0.37
46	002283	天润工业	129,100	828,822.00	0.37
47	600458	时代新材	69,000	827,310.00	0.37
48	603032	德新科技	23,800	822,052.00	0.37
49	300470	中密控股	17,200	794,984.00	0.36
50	002204	大连重工	154,300	793,102.00	0.35
51	000048	京基智农	40,100	782,752.00	0.35
52	300777	中简科技	16,300	770,338.00	0.34
53	002839	张家港行	181,000	765,630.00	0.34
54	603298	杭叉集团	32,300	760,665.00	0.34
55	600456	宝钛股份	22,400	758,016.00	0.34
56	600223	福瑞达	72,600	744,876.00	0.33
57	300319	麦捷科技	86,900	743,864.00	0.33
58	300134	大富科技	72,000	738,000.00	0.33
59	688711	宏微科技	12,483	728,258.22	0.33
60	002928	华夏航空	85,700	724,165.00	0.32
61	002139	拓邦股份	54,300	708,615.00	0.32
62	600742	一汽富维	85,676	701,686.44	0.31

63	300352	北信源	137,400	692,496.00	0.31
64	600583	海油工程	118,000	690,300.00	0.31
65	000528	柳工	86,400	682,560.00	0.30
66	603129	春风动力	4,200	679,980.00	0.30
67	601908	京运通	112,000	677,600.00	0.30
68	002612	朗姿股份	27,900	663,462.00	0.30
69	603308	应流股份	36,200	662,460.00	0.30
70	600312	平高电气	53,100	657,909.00	0.29
71	300143	盈康生命	58,000	657,720.00	0.29
72	688518	联赢激光	22,937	639,024.82	0.29
73	000036	华联控股	154,900	638,188.00	0.29
74	601882	海天精工	19,100	636,030.00	0.28
75	002421	达实智能	180,300	634,656.00	0.28
76	002318	久立特材	37,100	631,813.00	0.28
77	002239	奥特佳	235,800	629,586.00	0.28
78	002446	盛路通信	66,200	625,590.00	0.28
79	000567	海德股份	48,755	625,039.10	0.28
80	002698	博实股份	35,600	622,644.00	0.28
81	002918	蒙娜丽莎	40,200	620,688.00	0.28
82	002651	利君股份	78,600	610,722.00	0.27
83	002611	东方精工	106,300	610,162.00	0.27
84	002959	小熊电器	7,300	609,550.00	0.27
85	600211	西藏药业	10,200	605,880.00	0.27
86	603979	金诚信	19,400	603,340.00	0.27
87	300036	超图软件	25,400	602,234.00	0.27
88	000560	我爱我家	226,800	601,020.00	0.27
89	601099	太平洋	228,600	589,788.00	0.26
90	300775	三角防务	17,400	587,772.00	0.26
91	603906	龙蟠科技	32,300	586,245.00	0.26
92	603730	岱美股份	36,970	584,126.00	0.26
93	603636	南威软件	39,700	582,399.00	0.26
94	600277	亿利洁能	179,100	580,284.00	0.26
95	600633	浙数文化	35,600	577,076.00	0.26
96	002782	可立克	37,300	570,317.00	0.25
97	002467	二六三	114,600	569,562.00	0.25
98	000735	罗牛山	86,900	568,326.00	0.25
99	002017	东信和平	43,310	567,794.10	0.25
100	688278	特宝生物	12,900	566,439.00	0.25
101	000016	深康佳 A	119,800	565,456.00	0.25
102	600621	华鑫股份	52,900	562,327.00	0.25
103	600059	古越龙山	54,100	561,558.00	0.25
104	003040	楚天龙	30,900	560,526.00	0.25
105	002726	龙大美食	67,300	557,917.00	0.25



106	002946	新乳业	38,200	548,170.00	0.24
107	000688	国城矿业	35,900	544,603.00	0.24
108	002895	川恒股份	27,200	535,840.00	0.24
109	603027	千禾味业	25,176	531,717.12	0.24
110	002815	崇达技术	42,700	531,615.00	0.24
111	002402	和而泰	31,100	528,078.00	0.24
112	003006	百亚股份	30,400	525,312.00	0.23
113	688166	博瑞医药	23,656	520,195.44	0.23
114	600750	江中药业	23,700	519,741.00	0.23
115	600502	安徽建工	97,700	515,856.00	0.23
116	002990	盛视科技	13,900	511,520.00	0.23
117	000030	富奥股份	100,800	508,032.00	0.23
118	688676	金盘科技	16,700	505,843.00	0.23
119	000517	荣安地产	164,900	502,945.00	0.22
120	300382	斯莱克	38,100	502,539.00	0.22
121	603071	物产环能	30,100	499,359.00	0.22
122	002151	北斗星通	14,200	499,272.00	0.22
123	600639	浦东金桥	40,200	498,882.00	0.22
124	000951	中国重汽	29,300	493,705.00	0.22
125	600717	天津港	111,100	492,173.00	0.22
126	600483	福能股份	42,400	489,720.00	0.22
127	002267	陕天然气	61,800	489,456.00	0.22
128	600933	爱柯迪	21,000	489,090.00	0.22
129	600248	陕建股份	101,800	485,586.00	0.22
130	300767	震安科技	19,000	481,840.00	0.22
131	000028	国药一致	10,590	461,829.90	0.21
132	601126	四方股份	30,400	461,776.00	0.21
133	300133	华策影视	64,500	457,305.00	0.20
134	002063	远光软件	52,500	455,700.00	0.20
135	002344	海宁皮城	94,000	444,620.00	0.20
136	603235	天新药业	14,100	442,176.00	0.20
137	301180	万祥科技	25,200	441,756.00	0.20
138	301015	百洋医药	15,800	438,608.00	0.20
139	600662	外服控股	76,080	435,177.60	0.19
140	002489	浙江永强	107,300	434,565.00	0.19
141	300206	理邦仪器	28,585	431,061.80	0.19
142	002038	双鹭药业	42,400	427,816.00	0.19
143	603187	海容冷链	21,372	427,226.28	0.19
144	601222	林洋能源	51,900	425,061.00	0.19
145	002215	诺普信	55,000	413,050.00	0.18
146	002727	一心堂	15,600	411,840.00	0.18
147	603018	华设集团	47,000	411,250.00	0.18
148	000672	上峰水泥	45,000	410,850.00	0.18

149	002233	塔牌集团	52,100	402,212.00	0.18
150	002034	旺能环境	25,200	398,412.00	0.18
151	000923	河钢资源	29,500	398,250.00	0.18
152	600888	新疆众和	50,100	396,792.00	0.18
153	603881	数据港	17,480	394,873.20	0.18
154	300358	楚天科技	26,400	394,152.00	0.18
155	600017	日照港	130,200	389,298.00	0.17
156	002724	海洋王	44,800	388,864.00	0.17
157	002262	恩华药业	12,600	388,458.00	0.17
158	603118	共进股份	29,100	386,739.00	0.17
159	002544	普天科技	16,500	377,850.00	0.17
160	300887	谱尼测试	9,500	376,010.00	0.17
161	300768	迪普科技	22,400	371,168.00	0.17
162	600285	羚锐制药	22,800	366,168.00	0.16
163	300855	图南股份	10,020	353,906.40	0.16
164	600977	中国电影	24,900	349,845.00	0.16
165	002675	东诚药业	23,700	348,627.00	0.16
166	688556	高测股份	6,494	345,091.16	0.15
167	002276	万马股份	28,300	342,713.00	0.15
168	000915	华特达因	9,700	342,313.00	0.15
169	300294	博雅生物	9,300	337,404.00	0.15
170	601965	中国汽研	16,200	334,530.00	0.15
171	300567	精测电子	3,500	333,025.00	0.15
172	600587	新华医疗	9,400	332,102.00	0.15
173	002768	国恩股份	13,500	326,565.00	0.15
174	002440	闰土股份	48,300	322,161.00	0.14
175	300860	锋尚文化	5,800	321,552.00	0.14
176	603033	三维股份	15,800	321,530.00	0.14
177	601311	骆驼股份	34,600	321,088.00	0.14
178	600420	国药现代	28,200	318,378.00	0.14
179	002003	伟星股份	33,900	317,304.00	0.14
180	603567	珍宝岛	21,200	317,152.00	0.14
181	002605	姚记科技	6,800	315,724.00	0.14
182	002023	海特高新	34,300	315,560.00	0.14
183	000950	重药控股	46,600	313,618.00	0.14
184	002237	恒邦股份	28,700	312,543.00	0.14
185	300075	数字政通	12,400	308,512.00	0.14
186	300131	英唐智控	58,700	308,175.00	0.14
187	002314	南山控股	92,000	303,600.00	0.14
188	002851	麦格米特	8,300	302,701.00	0.14
189	300623	捷捷微电	16,700	302,604.00	0.14
190	600864	哈投股份	59,000	301,490.00	0.13
191	002106	莱宝高科	35,400	300,900.00	0.13

192	605008	长鸿高科	20,900	298,034.00	0.13
193	000682	东方电子	30,500	296,460.00	0.13
194	300065	海兰信	23,875	295,811.25	0.13
195	603043	广州酒家	10,300	291,078.00	0.13
196	002498	汉缆股份	71,800	287,918.00	0.13
197	000061	农产品	48,000	287,520.00	0.13
198	601677	明泰铝业	20,700	287,316.00	0.13
199	301236	软通动力	10,550	287,065.50	0.13
200	603010	万盛股份	26,400	286,968.00	0.13
201	002701	奥瑞金	63,500	286,385.00	0.13
202	300638	广和通	12,520	283,953.60	0.13
203	600986	浙文互联	44,300	283,520.00	0.13
204	600185	格力地产	41,100	281,946.00	0.13
205	603733	仙鹤股份	13,500	281,475.00	0.13
206	002641	公元股份	49,800	280,872.00	0.13
207	002135	东南网架	43,100	278,426.00	0.12
208	002649	博彦科技	19,600	276,948.00	0.12
209	605589	圣泉集团	12,700	276,098.00	0.12
210	601369	陕鼓动力	30,100	274,211.00	0.12
211	300451	创业慧康	32,400	271,512.00	0.12
212	000546	ST 金圆	42,600	271,362.00	0.12
213	600557	康缘药业	9,700	266,362.00	0.12
214	300770	新媒股份	5,700	261,402.00	0.12
215	600874	创业环保	44,200	259,012.00	0.12
216	603678	火炬电子	7,500	258,450.00	0.12
217	300773	拉卡拉	14,800	258,112.00	0.12
218	002461	珠江啤酒	29,200	257,252.00	0.11
219	600267	海正药业	22,400	254,912.00	0.11
220	605123	派克新材	2,300	249,895.00	0.11
221	600531	豫光金铅	39,100	246,330.00	0.11
222	603300	华铁应急	44,520	242,634.00	0.11
223	001308	康冠科技	8,800	241,648.00	0.11
224	603959	百利科技	20,700	238,050.00	0.11
225	688330	宏力达	6,762	237,210.96	0.11
226	688110	东芯股份	6,500	234,650.00	0.10
227	300232	洲明科技	24,700	225,758.00	0.10
228	002677	浙江美大	21,200	224,508.00	0.10
229	300109	新开源	9,000	223,830.00	0.10
230	301087	可孚医疗	4,500	221,850.00	0.10
231	600710	苏美达	25,500	218,280.00	0.10
232	000582	北部湾港	28,700	218,120.00	0.10
233	300406	九强生物	9,300	216,969.00	0.10
234	688568	中科星图	2,689	216,679.62	0.10

235	002088	鲁阳节能	11,700	215,748.00	0.10
236	600163	中闽能源	38,600	215,388.00	0.10
237	002746	仙坛股份	27,300	215,124.00	0.10
238	688148	芳源股份	17,600	214,720.00	0.10
239	300639	凯普生物	21,400	214,428.00	0.10
240	688100	威胜信息	7,188	214,274.28	0.10
241	688425	铁建重工	44,386	213,496.66	0.10
242	600210	紫江企业	40,100	213,332.00	0.10
243	688707	振华新材	6,921	213,097.59	0.10
244	002434	万里扬	23,700	212,115.00	0.09
245	605168	三人行	2,465	211,842.10	0.09
246	300596	利安隆	5,200	211,484.00	0.09
247	688800	瑞可达	3,400	211,310.00	0.09
248	002274	华昌化工	28,200	211,218.00	0.09
249	002004	华邦健康	42,200	211,000.00	0.09
250	600649	城投控股	53,600	210,648.00	0.09
251	002597	金禾实业	8,900	210,040.00	0.09
252	603113	金能科技	25,900	209,531.00	0.09
253	603393	新天然气	7,800	209,352.00	0.09
254	002737	葵花药业	8,600	209,324.00	0.09
255	688139	海尔生物	4,062	209,071.14	0.09
256	002978	安宁股份	6,500	208,715.00	0.09
257	002516	旷达科技	43,100	208,604.00	0.09
258	002176	江特电机	17,500	208,600.00	0.09
259	600618	氯碱化工	23,200	208,104.00	0.09
260	601678	滨化股份	44,800	207,872.00	0.09
261	600284	浦东建设	33,900	207,468.00	0.09
262	600328	中盐化工	23,010	207,090.00	0.09
263	600057	厦门象屿	23,800	207,060.00	0.09
264	600740	山西焦化	40,300	206,739.00	0.09
265	603299	苏盐井神	20,700	206,586.00	0.09
266	002539	云图控股	23,000	206,540.00	0.09
267	000795	英洛华	27,100	205,418.00	0.09
268	000657	中钨高新	21,190	205,331.10	0.09
269	600908	无锡银行	38,300	205,288.00	0.09
270	002573	清新环境	37,200	204,972.00	0.09
271	000789	万年青	26,400	204,600.00	0.09
272	601886	江河集团	23,000	204,470.00	0.09
273	300747	锐科激光	6,700	204,216.00	0.09
274	600773	西藏城投	16,200	204,120.00	0.09
275	603128	华贸物流	22,400	204,064.00	0.09
276	002258	利尔化学	15,800	203,978.00	0.09
277	601860	紫金银行	81,000	203,310.00	0.09

278	002556	辉隆股份	28,000	203,280.00	0.09
279	300054	鼎龙股份	8,200	202,786.00	0.09
280	002020	京新药业	15,800	202,556.00	0.09
281	300737	科顺股份	22,100	202,436.00	0.09
282	002747	埃斯顿	7,200	201,600.00	0.09
283	600761	安徽合力	10,100	201,293.00	0.09
284	002807	江阴银行	54,500	201,105.00	0.09
285	000062	深圳华强	17,600	200,992.00	0.09
286	605376	博迁新材	6,400	200,832.00	0.09
287	002091	江苏国泰	26,600	200,564.00	0.09
288	603208	江山欧派	5,500	200,310.00	0.09
289	000875	吉电股份	37,100	199,969.00	0.09
290	600789	鲁抗医药	31,100	199,662.00	0.09
291	300101	振芯科技	10,200	197,778.00	0.09
292	300203	聚光科技	9,700	196,619.00	0.09
293	300463	迈克生物	13,000	196,560.00	0.09
294	600552	凯盛科技	16,600	196,544.00	0.09
295	300180	华峰超纤	54,100	195,301.00	0.09
296	000552	甘肃能化	58,600	195,138.00	0.09
297	002993	奥海科技	5,700	193,344.00	0.09
298	600120	浙江东方	50,100	191,883.00	0.09
299	601619	嘉泽新能	42,100	191,555.00	0.09
300	600872	中炬高新	5,200	191,308.00	0.09
301	688131	皓元医药	3,354	191,110.92	0.09
302	002332	仙琚制药	14,400	190,800.00	0.09
303	300457	赢合科技	10,800	190,728.00	0.09
304	603690	至纯科技	5,460	190,226.40	0.08
305	300587	天铁股份	24,500	188,650.00	0.08
306	600273	嘉化能源	20,000	188,400.00	0.08
307	600197	伊力特	6,900	187,473.00	0.08
308	600682	南京新百	23,100	185,031.00	0.08
309	002378	章源钨业	31,700	184,494.00	0.08
310	002847	盐津铺子	2,150	182,857.50	0.08
311	600480	凌云股份	23,100	181,566.00	0.08
312	300856	科思股份	2,300	181,171.00	0.08
313	600577	精达股份	42,800	180,616.00	0.08
314	600821	金开新能	26,100	179,829.00	0.08
315	002643	万润股份	10,300	179,323.00	0.08
316	300525	博思软件	11,660	178,864.40	0.08
317	002108	沧州明珠	39,400	178,482.00	0.08
318	600559	老白干酒	7,200	176,472.00	0.08
319	000555	神州信息	14,319	176,123.70	0.08
320	688586	江航装备	12,654	176,017.14	0.08

321	002123	梦网科技	13,200	175,428.00	0.08
322	000828	东莞控股	19,100	174,765.00	0.08
323	002891	中宠股份	7,200	173,808.00	0.08
324	002214	大立科技	12,680	173,082.00	0.08
325	300183	东软载波	10,400	171,704.00	0.08
326	000690	宝新能源	24,200	169,884.00	0.08
327	300226	上海钢联	5,145	166,698.00	0.07
328	002097	山河智能	24,900	165,585.00	0.07
329	300761	立华股份	8,900	164,027.00	0.07
330	000426	兴业银锡	18,200	161,616.00	0.07
331	002174	游族网络	9,300	156,240.00	0.07
332	300674	宇信科技	8,800	155,584.00	0.07
333	301090	华润材料	12,300	155,226.00	0.07
334	300377	赢时胜	18,400	149,040.00	0.07
335	600491	龙元建设	27,900	140,616.00	0.06
336	301200	大族数控	3,500	139,580.00	0.06
337	002254	泰和新材	5,600	137,032.00	0.06
338	688339	亿华通	1,591	135,235.00	0.06
339	603877	太平鸟	5,000	126,400.00	0.06
340	300416	苏试试验	5,800	125,048.00	0.06
341	002645	华宏科技	10,100	123,826.00	0.06
342	002773	康弘药业	6,300	120,456.00	0.05
343	002706	良信股份	10,700	120,375.00	0.05
344	002126	银轮股份	6,800	120,360.00	0.05
345	000049	德赛电池	3,400	119,952.00	0.05
346	002549	凯美特气	10,400	119,600.00	0.05
347	002124	天邦食品	26,300	119,402.00	0.05
348	603387	基蛋生物	9,200	118,588.00	0.05
349	002948	青岛银行	37,800	118,314.00	0.05
350	002911	佛燃能源	9,200	118,312.00	0.05
351	600562	国睿科技	7,300	118,260.00	0.05
352	600876	凯盛新能	7,400	118,104.00	0.05
353	300327	中颖电子	4,200	117,432.00	0.05
354	000603	盛达资源	9,700	117,273.00	0.05
355	000848	承德露露	13,200	116,820.00	0.05
356	600993	马应龙	4,200	116,802.00	0.05
357	002859	洁美科技	4,200	116,340.00	0.05
358	300973	立高食品	1,700	116,314.00	0.05
359	000503	国新健康	9,700	116,303.00	0.05
360	688399	硕世生物	2,100	115,920.00	0.05
361	000403	派林生物	5,800	115,768.00	0.05
362	002335	科华数据	3,200	115,040.00	0.05
363	002243	力合科创	13,500	114,885.00	0.05

364	000652	泰达股份	27,700	114,124.00	0.05
365	000058	深赛格	18,400	113,712.00	0.05
366	000029	深深房 A	10,500	113,505.00	0.05
367	603919	金徽酒	4,800	112,704.00	0.05
368	000065	北方国际	7,400	111,148.00	0.05
369	600335	国机汽车	9,700	110,580.00	0.05
370	300679	电连技术	3,300	109,065.00	0.05
371	603305	旭升集团	3,900	108,693.00	0.05
372	601929	吉视传媒	58,100	106,904.00	0.05
373	600776	东方通信	7,500	106,875.00	0.05
374	300079	数码视讯	17,200	104,920.00	0.05
375	600490	鹏欣资源	27,800	102,304.00	0.05
376	301039	中集车辆	7,700	101,871.00	0.05
377	301207	华兰疫苗	3,050	101,443.00	0.05
378	603093	南华期货	9,300	101,277.00	0.05
379	600400	红豆股份	30,500	100,040.00	0.04
380	300455	航天智装	8,700	99,615.00	0.04
381	603938	三孚股份	4,900	96,971.00	0.04
382	000881	中广核技	11,700	96,291.00	0.04
383	002865	钧达股份	628	95,788.84	0.04
384	300497	富祥药业	7,500	95,700.00	0.04
385	300102	乾照光电	14,500	95,410.00	0.04
386	301031	中熔电气	700	94,997.00	0.04
387	600184	光电股份	7,100	93,223.00	0.04
388	002324	普利特	6,500	92,755.00	0.04
389	600098	广州发展	14,900	92,082.00	0.04
390	603489	八方股份	1,300	91,156.00	0.04
391	300034	钢研高纳	2,300	90,597.00	0.04
392	300827	上能电气	2,500	90,125.00	0.04
393	600266	城建发展	17,600	89,408.00	0.04
394	603599	广信股份	3,300	89,364.00	0.04
395	002234	民和股份	4,900	89,229.00	0.04
396	300091	金通灵	29,900	89,102.00	0.04
397	300443	金雷股份	2,500	88,625.00	0.04
398	300263	隆华科技	10,600	88,192.00	0.04
399	301071	力量钻石	2,000	88,000.00	0.04
400	688526	科前生物	3,698	87,975.42	0.04
401	300191	潜能恒信	4,800	87,744.00	0.04
402	601700	风范股份	16,500	87,615.00	0.04
403	300080	易成新能	17,200	87,548.00	0.04
404	002053	云南能投	7,800	87,516.00	0.04
405	603915	国茂股份	4,100	86,838.00	0.04
406	002285	世联行	33,900	86,784.00	0.04

407	300035	中科电气	7,200	86,544.00	0.04
408	600643	爱建集团	17,200	86,000.00	0.04
409	000650	仁和药业	14,000	85,960.00	0.04
410	002635	安洁科技	6,200	85,560.00	0.04
411	600320	振华重工	22,900	85,417.00	0.04
412	600064	南京高科	12,900	85,269.00	0.04
413	603520	司太立	5,100	85,068.00	0.04
414	000901	航天科技	7,900	84,530.00	0.04
415	002967	广电计量	4,200	84,378.00	0.04
416	603179	新泉股份	1,900	83,391.00	0.04
417	603348	文灿股份	1,900	83,239.00	0.04
418	603197	保隆科技	1,500	81,375.00	0.04
419	000818	航锦科技	2,400	80,088.00	0.04
420	300738	奥飞数据	7,800	79,560.00	0.04
421	002212	天融信	8,200	79,540.00	0.04
422	300613	富瀚微	1,400	79,436.00	0.04
423	600657	信达地产	17,700	74,871.00	0.03
424	000860	顺鑫农业	2,200	74,118.00	0.03
425	300598	诚迈科技	1,600	73,872.00	0.03
426	603609	禾丰股份	8,000	72,800.00	0.03
427	000627	天茂集团	23,900	71,700.00	0.03
428	600550	保变电气	14,200	71,568.00	0.03
429	600108	亚盛集团	23,300	70,366.00	0.03
430	300002	神州泰岳	5,000	70,000.00	0.03
431	000821	京山轻机	3,400	69,564.00	0.03
432	300379	东方通	3,300	67,881.00	0.03
433	601921	浙版传媒	7,500	65,175.00	0.03
434	600391	航发科技	2,700	65,097.00	0.03
435	301177	迪阿股份	1,500	57,645.00	0.03
436	603719	良品铺子	2,300	57,523.00	0.03
437	688050	爱博医疗	246	50,511.18	0.02
438	002906	华阳集团	1,400	47,866.00	0.02
439	688023	安恒信息	222	38,785.62	0.02
440	688617	惠泰医疗	100	37,375.00	0.02
441	688368	晶丰明源	200	25,442.00	0.01
442	688037	芯源微	148	25,300.60	0.01
443	688356	键凯科技	180	19,179.00	0.01
444	688019	安集科技	110	18,131.30	0.01
445	688016	心脉医疗	100	17,988.00	0.01
446	688598	金博股份	100	17,150.00	0.01
447	688686	奥普特	100	16,448.00	0.01
448	688091	上海谊众	220	16,198.60	0.01
449	688318	财富趋势	140	13,995.80	0.01



450	688383	新益昌	100	13,922.00	0.01
451	688190	云路股份	185	13,505.00	0.01
452	688018	乐鑫科技	100	12,982.00	0.01
453	688789	宏华数科	145	12,807.85	0.01
454	688680	海优新材	100	12,182.00	0.01
455	688508	芯朋微	208	12,061.92	0.01
456	688202	美迪西	140	11,935.00	0.01
457	688776	国光电气	140	11,603.20	0.01
458	688333	铂力特	108	11,419.92	0.01
459	688066	航天宏图	180	10,962.00	0.00
460	688408	中信博	100	8,433.00	0.00
461	688366	昊海生科	100	8,422.00	0.00
462	688798	艾为电子	140	8,281.00	0.00
463	688268	华特气体	100	8,073.00	0.00
464	688083	中望软件	40	5,795.60	0.00
465	300394	天孚通信	50	5,341.50	0.00
466	688017	绿的谐波	30	4,872.00	0.00
467	688700	东威科技	44	4,388.12	0.00
468	688088	虹软科技	84	3,591.00	0.00
469	688085	三友医疗	130	3,413.80	0.00
470	688033	天宜上佳	178	3,403.36	0.00
471	688739	成大生物	100	3,296.00	0.00
472	688733	壹石通	100	3,096.00	0.00
473	688106	金宏气体	100	2,720.00	0.00
474	688315	诺禾致源	100	2,655.00	0.00
475	688161	威高骨科	60	2,598.60	0.00
476	688128	中国电研	100	2,550.00	0.00
477	688007	光峰科技	100	2,085.00	0.00
478	603920	世运电路	90	1,757.70	0.00
479	688277	天智航	95	1,751.80	0.00
480	688158	优刻得	79	1,491.52	0.00
481	603025	大豪科技	100	1,236.00	0.00
482	688575	亚辉龙	59	1,088.55	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	002833	弘亚数控	65,900	1,295,594.00	0.58
2	600590	泰豪科技	138,720	989,073.60	0.44
3	002518	科士达	23,400	936,234.00	0.42
4	600481	双良节能	61,800	863,964.00	0.39

5	300439	美康生物	73,900	835,809.00	0.37
6	603313	梦百合	61,200	613,836.00	0.27
7	300276	三丰智能	141,500	595,715.00	0.27
8	603826	坤彩科技	11,400	570,000.00	0.25
9	000507	珠海港	101,700	562,401.00	0.25
10	300791	仙乐健康	18,400	534,336.00	0.24
11	000423	东阿阿胶	9,200	491,740.00	0.22
12	000910	大亚圣象	57,700	450,637.00	0.20
13	600748	上实发展	102,900	406,455.00	0.18
14	688778	厦钨新能	6,791	336,154.50	0.15
15	000823	超声电子	33,720	319,665.60	0.14
16	300438	鹏辉能源	6,600	317,064.00	0.14
17	300326	凯利泰	47,700	310,050.00	0.14
18	002662	京威股份	93,100	310,023.00	0.14
19	300748	金力永磁	10,300	308,176.00	0.14
20	002240	盛新锂能	9,300	296,391.00	0.13
21	601686	友发集团	43,100	294,804.00	0.13
22	600060	海信视像	11,000	272,250.00	0.12
23	300127	银河磁体	14,900	270,137.00	0.12
24	000958	电投产融	62,000	268,460.00	0.12
25	300487	蓝晓科技	4,300	268,406.00	0.12
26	600114	东睦股份	34,500	262,890.00	0.12
27	600419	天润乳业	14,900	241,678.00	0.11
28	002105	信隆健康	40,300	239,785.00	0.11
29	603679	华体科技	15,800	235,736.00	0.11
30	600377	宁沪高速	23,900	234,937.00	0.10
31	002121	科陆电子	31,900	233,827.00	0.10
32	300763	锦浪科技	2,200	229,020.00	0.10
33	601958	金铂股份	20,400	227,460.00	0.10
34	300609	汇纳科技	8,100	226,800.00	0.10
35	300440	运达科技	31,400	221,998.00	0.10
36	002463	沪电股份	10,500	219,870.00	0.10
37	603610	麒盛科技	18,857	218,364.06	0.10
38	002614	奥佳华	26,700	217,338.00	0.10
39	002027	分众传媒	31,700	215,877.00	0.10
40	002293	罗莱生活	18,600	213,900.00	0.10
41	688390	固德威	1,262	210,577.32	0.09
42	600548	深高速	23,400	210,132.00	0.09
43	601827	三峰环境	28,300	209,420.00	0.09
44	300815	玉禾田	14,000	208,320.00	0.09
45	002930	宏川智慧	9,100	207,207.00	0.09
46	002429	兆驰股份	36,900	202,950.00	0.09
47	601588	北辰实业	98,400	199,752.00	0.09

48	300996	普联软件	6,500	199,550.00	0.09
49	603960	克来机电	10,600	197,690.00	0.09
50	688343	云天励飞	3,827	193,914.09	0.09
51	300590	移为通信	15,200	185,744.00	0.08
52	300318	博晖创新	34,000	183,940.00	0.08
53	600995	南网储能	16,700	183,867.00	0.08
54	600537	亿晶光电	23,700	181,068.00	0.08
55	300790	宇瞳光学	11,200	170,688.00	0.08
56	300045	华力创通	14,700	170,520.00	0.08
57	688186	广大特材	5,200	169,156.00	0.08
58	002299	圣农发展	8,800	168,520.00	0.08
59	000559	万向钱潮	30,800	167,860.00	0.07
60	300302	同有科技	11,300	167,805.00	0.07
61	002985	北摩高科	3,800	167,656.00	0.07
62	300604	长川科技	3,500	166,215.00	0.07
63	601577	长沙银行	21,400	166,064.00	0.07
64	300378	鼎捷软件	4,800	164,400.00	0.07
65	600353	旭光电子	20,000	164,000.00	0.07
66	300863	卡倍亿	2,500	157,275.00	0.07
67	301025	读客文化	12,400	151,528.00	0.07
68	000400	许继电气	6,500	149,825.00	0.07
69	300308	中际旭创	1,000	147,450.00	0.07
70	688403	汇成股份	11,916	145,613.52	0.07
71	002582	好想你	16,500	128,865.00	0.06
72	600066	宇通客车	8,500	125,290.00	0.06
73	002459	晶澳科技	3,000	125,100.00	0.06
74	300146	汤臣倍健	5,200	124,696.00	0.06
75	600792	云煤能源	35,900	120,983.00	0.05
76	603209	兴通股份	5,700	120,897.00	0.05
77	300563	神宇股份	6,900	112,746.00	0.05
78	300128	锦富技术	26,900	112,173.00	0.05
79	600582	天地科技	19,200	111,936.00	0.05
80	688102	斯瑞新材	8,900	108,580.00	0.05
81	002334	英威腾	8,400	107,016.00	0.05
82	600642	申能股份	15,300	106,947.00	0.05
83	300636	同和药业	8,700	106,662.00	0.05
84	300925	法本信息	7,400	104,562.00	0.05
85	300265	通光线缆	10,000	103,800.00	0.05
86	605499	东鹏饮料	600	103,740.00	0.05
87	002875	安奈儿	7,700	103,565.00	0.05
88	000739	普洛药业	5,800	102,892.00	0.05
89	603002	宏昌电子	19,400	99,910.00	0.04
90	300501	海顺新材	5,900	98,294.00	0.04

91	000050	深天马 A	10,600	97,308.00	0.04
92	000544	中原环保	13,500	96,930.00	0.04
93	301486	致尚科技	1,665	96,003.90	0.04
94	600528	中铁工业	9,700	95,836.00	0.04
95	002154	报喜鸟	17,000	93,840.00	0.04
96	300759	康龙化成	2,400	91,872.00	0.04
97	300750	宁德时代	400	91,516.00	0.04
98	001979	招商蛇口	7,000	91,210.00	0.04
99	603717	天域生态	13,400	90,986.00	0.04
100	000702	正虹科技	16,500	90,420.00	0.04
101	601607	上海医药	4,000	89,640.00	0.04
102	603338	浙江鼎力	1,600	89,616.00	0.04
103	300664	鹏鹞环保	15,800	89,428.00	0.04
104	603901	永创智能	6,100	88,816.00	0.04
105	601865	福莱特	2,300	88,573.00	0.04
106	600061	国投资本	12,400	88,288.00	0.04
107	000623	吉林敖东	5,500	88,220.00	0.04
108	000900	现代投资	21,800	87,854.00	0.04
109	600039	四川路桥	8,860	86,916.60	0.04
110	300700	岱勒新材	4,500	85,725.00	0.04
111	300779	惠城环保	1,600	85,264.00	0.04
112	003816	中国广核	27,400	85,214.00	0.04
113	603660	苏州科达	12,400	85,188.00	0.04
114	688689	银河微电	3,300	85,140.00	0.04
115	301256	华融化学	9,600	85,056.00	0.04
116	300537	广信材料	5,200	84,968.00	0.04
117	300353	东土科技	6,500	84,565.00	0.04
118	601766	中国中车	13,000	84,500.00	0.04
119	000949	新乡化纤	26,300	84,423.00	0.04
120	002846	英联股份	6,500	83,330.00	0.04
121	002116	中国海诚	6,500	83,070.00	0.04
122	301057	汇隆新材	4,800	82,752.00	0.04
123	300197	节能铁汉	33,900	82,377.00	0.04
124	600879	航天电子	9,700	82,353.00	0.04
125	600180	瑞茂通	13,700	81,926.00	0.04
126	301391	卡莱特	696	81,550.32	0.04
127	002379	宏创控股	19,100	80,793.00	0.04
128	603697	有友食品	8,800	80,696.00	0.04
129	002511	中顺洁柔	7,200	80,280.00	0.04
130	002867	周大生	4,500	80,010.00	0.04
131	600886	国投电力	6,300	79,695.00	0.04
132	002223	鱼跃医疗	2,200	79,178.00	0.04
133	688301	奕瑞科技	280	79,080.40	0.04

134	601107	四川成渝	19,400	78,958.00	0.04
135	603367	辰欣药业	5,200	78,936.00	0.04
136	002270	华明装备	7,200	78,840.00	0.04
137	601928	凤凰传媒	6,900	78,660.00	0.04
138	002803	吉宏股份	3,800	77,748.00	0.03
139	000063	中兴通讯	1,700	77,418.00	0.03
140	300683	海特生物	2,000	76,620.00	0.03
141	000333	美的集团	1,300	76,596.00	0.03
142	000783	长江证券	13,200	76,560.00	0.03
143	300005	探路者	9,100	76,440.00	0.03
144	002007	华兰生物	3,400	76,194.00	0.03
145	601319	中国人保	12,900	75,336.00	0.03
146	301395	仁信新材	2,814	75,077.52	0.03
147	300940	南极光	4,400	74,844.00	0.03
148	000537	广宇发展	6,400	74,688.00	0.03
149	002922	伊戈尔	5,200	74,620.00	0.03
150	605167	利柏特	7,700	74,536.00	0.03
151	000425	徐工机械	11,000	74,470.00	0.03
152	300708	聚灿光电	7,500	74,025.00	0.03
153	000963	华东医药	1,700	73,729.00	0.03
154	002536	飞龙股份	4,900	73,500.00	0.03
155	601199	江南水务	10,700	72,974.00	0.03
156	002252	上海莱士	9,700	72,847.00	0.03
157	603377	东方时尚	9,000	72,360.00	0.03
158	002423	中粮资本	9,000	72,000.00	0.03
159	300164	通源石油	16,500	71,940.00	0.03
160	600329	达仁堂	1,600	71,824.00	0.03
161	000967	盈峰环境	14,200	71,710.00	0.03
162	300254	仟源医药	9,700	71,586.00	0.03
163	600271	航天信息	5,200	71,188.00	0.03
164	600535	天士力	4,900	71,099.00	0.03
165	002886	沃特股份	3,500	70,980.00	0.03
166	301292	海科新源	3,533	70,624.67	0.03
167	605337	李子园	3,860	70,560.80	0.03
168	000429	粤高速 A	9,000	70,560.00	0.03
169	002028	思源电气	1,500	70,080.00	0.03
170	600200	江苏吴中	9,700	69,937.00	0.03
171	300890	翔丰华	1,700	69,870.00	0.03
172	002600	领益智造	10,100	69,791.00	0.03
173	300665	飞鹿股份	8,000	69,520.00	0.03
174	600109	国金证券	8,000	69,360.00	0.03
175	603998	方盛制药	5,500	69,355.00	0.03
176	603768	常青股份	3,900	69,303.00	0.03

177	002056	横店东磁	3,800	69,198.00	0.03
178	300140	中环装备	7,600	69,160.00	0.03
179	603165	荣晟环保	4,300	68,972.00	0.03
180	000876	新希望	5,900	68,912.00	0.03
181	000576	甘化科工	6,500	68,900.00	0.03
182	688603	天承科技	1,251	68,805.00	0.03
183	300121	阳谷华泰	7,200	68,760.00	0.03
184	300473	德尔股份	3,800	68,628.00	0.03
185	300001	特锐德	3,300	68,574.00	0.03
186	600658	电子城	12,400	68,572.00	0.03
187	300640	德艺文创	11,400	68,514.00	0.03
188	301488	豪恩汽电	1,720	68,421.60	0.03
189	000988	华工科技	1,800	68,418.00	0.03
190	603508	思维列控	4,000	68,200.00	0.03
191	600012	皖通高速	6,500	68,120.00	0.03
192	002152	广电运通	5,800	67,976.00	0.03
193	600161	天坛生物	2,500	67,875.00	0.03
194	600867	通化东宝	6,500	67,860.00	0.03
195	300724	捷佳伟创	600	67,410.00	0.03
196	300802	矩子科技	2,800	67,396.00	0.03
197	600008	首创环保	23,400	67,392.00	0.03
198	600398	海澜之家	9,700	66,736.00	0.03
199	601600	中国铝业	12,000	65,880.00	0.03
200	600269	赣粤高速	17,900	65,693.00	0.03
201	600415	小商品城	7,700	65,681.00	0.03
202	603087	甘李药业	1,700	65,450.00	0.03
203	601616	广电电气	19,300	65,234.00	0.03
204	002939	长城证券	8,000	65,040.00	0.03
205	600023	浙能电力	12,700	64,389.00	0.03
206	002301	齐心集团	8,900	63,991.00	0.03
207	002531	天顺风能	4,200	63,966.00	0.03
208	601163	三角轮胎	4,000	63,480.00	0.03
209	002723	小崧股份	6,200	63,364.00	0.03
210	002588	史丹利	10,400	63,232.00	0.03
211	002500	山西证券	11,300	63,054.00	0.03
212	002275	桂林三金	3,500	63,035.00	0.03
213	002448	中原内配	9,000	63,000.00	0.03
214	688221	前沿生物	5,900	62,894.00	0.03
215	300217	东方电热	10,700	62,702.00	0.03
216	600362	江西铜业	3,300	62,634.00	0.03
217	688132	邦彦技术	2,300	62,514.00	0.03
218	688683	莱尔科技	2,800	62,300.00	0.03
219	000905	厦门港务	8,000	62,240.00	0.03

220	600600	青岛啤酒	600	62,178.00	0.03
221	603551	奥普家居	4,800	62,064.00	0.03
222	300583	赛托生物	2,400	62,040.00	0.03
223	600774	汉商集团	4,900	62,034.00	0.03
224	600050	中国联通	12,900	61,920.00	0.03
225	000937	冀中能源	9,700	61,886.00	0.03
226	300122	智飞生物	1,400	61,880.00	0.03
227	300252	金信诺	5,500	61,820.00	0.03
228	600237	铜峰电子	7,500	61,725.00	0.03
229	600865	百大集团	7,200	61,704.00	0.03
230	600965	福成股份	9,700	61,401.00	0.03
231	600138	中青旅	4,900	61,299.00	0.03
232	300144	宋城演艺	4,900	60,760.00	0.03
233	300092	科新机电	3,700	60,680.00	0.03
234	002479	富春环保	13,000	60,580.00	0.03
235	300136	信维通信	3,000	60,240.00	0.03
236	300402	宝色股份	2,800	60,172.00	0.03
237	600509	天富能源	7,700	60,137.00	0.03
238	300129	泰胜风能	6,200	59,458.00	0.03
239	600803	新奥股份	3,100	58,838.00	0.03
240	688141	杰华特	1,500	58,650.00	0.03
241	300731	科创新源	2,800	58,604.00	0.03
242	603758	秦安股份	5,500	58,520.00	0.03
243	300099	精准信息	9,200	58,512.00	0.03
244	002170	芭田股份	8,500	58,395.00	0.03
245	600566	济川药业	2,000	58,080.00	0.03
246	000060	中金岭南	12,200	57,950.00	0.03
247	688428	诺诚健华	5,000	57,750.00	0.03
248	600011	华能国际	6,200	57,412.00	0.03
249	600684	珠江股份	17,900	57,280.00	0.03
250	603797	联泰环保	10,300	57,268.00	0.03
251	600928	西安银行	16,200	57,024.00	0.03
252	601618	中国中冶	14,200	56,374.00	0.03
253	600203	福日电子	9,000	54,720.00	0.02
254	688429	时创能源	1,887	53,982.27	0.02
255	688168	安博通	1,500	53,400.00	0.02
256	000932	华菱钢铁	11,100	52,947.00	0.02
257	603369	今世缘	1,000	52,800.00	0.02
258	002065	东华软件	7,300	51,538.00	0.02
259	600909	华安证券	11,000	51,370.00	0.02
260	000705	浙江震元	6,100	49,105.00	0.02
261	000858	五粮液	300	49,071.00	0.02
262	301261	恒工精密	1,325	48,892.50	0.02

263	301093	华兰股份	1,400	48,440.00	0.02
264	301202	朗威股份	1,863	48,102.66	0.02
265	688223	晶科能源	3,400	47,804.00	0.02
266	600927	永安期货	2,900	47,154.00	0.02
267	688012	中微公司	286	44,744.70	0.02
268	688188	柏楚电子	226	42,614.56	0.02
269	688200	华峰测控	196	29,988.00	0.01
270	688581	安杰思	200	24,275.00	0.01
271	688536	思瑞浦	100	21,800.00	0.01
272	688063	派能科技	100	19,825.00	0.01
273	600525	长园集团	3,300	19,404.00	0.01
274	688361	中科飞测	259	17,538.15	0.01
275	688058	宝兰德	299	17,040.01	0.01
276	688484	南芯科技	389	14,998.59	0.01
277	301325	曼恩斯特	128	13,817.60	0.01
278	688623	双元科技	152	13,679.76	0.01
279	688443	智翔金泰	459	13,596.97	0.01
280	688472	阿特斯	786	13,393.44	0.01
281	688003	天准科技	300	13,389.00	0.01
282	688561	奇安信	243	12,589.83	0.01
283	688535	华海诚科	200	10,741.00	0.00
284	688793	倍轻松	188	10,133.20	0.00
285	688562	航天软件	447	9,972.57	0.00
286	688629	华丰科技	512	9,518.08	0.00
287	688582	芯动联科	232	9,437.76	0.00
288	688458	美芯晟	100	9,162.56	0.00
289	688777	中控技术	145	9,103.10	0.00
290	688357	建龙微纳	140	9,056.60	0.00
291	301246	宏源药业	286	8,783.06	0.00
292	301408	华人健康	490	8,305.50	0.00
293	688621	阳光诺和	140	8,234.80	0.00
294	688029	南微医学	100	8,156.00	0.00
295	301225	恒勃股份	226	7,516.76	0.00
296	301295	美硕科技	206	7,430.42	0.00
297	688334	西高院	454	7,408.34	0.00
298	688580	伟思医疗	100	7,230.00	0.00
299	688521	芯原股份	100	7,192.00	0.00
300	301305	朗坤环境	322	6,340.18	0.00
301	688068	热景生物	148	6,276.68	0.00
302	688156	路德环境	213	6,106.71	0.00
303	688533	上声电子	130	6,074.90	0.00
304	301376	致欧科技	269	6,055.19	0.00
305	301157	华塑科技	114	6,034.02	0.00



306	301262	海看股份	236	6,018.00	0.00
307	301232	飞沃科技	103	6,017.26	0.00
308	688479	友车科技	200	6,008.88	0.00
309	301281	科源制药	238	5,973.80	0.00
310	301332	德尔玛	434	5,958.82	0.00
311	301386	未来电器	244	5,804.76	0.00
312	301439	泓淋电力	339	5,729.10	0.00
313	301428	世纪恒通	186	5,691.60	0.00
314	688520	神州细胞	100	5,674.00	0.00
315	301210	金杨股份	112	5,507.04	0.00
316	301322	绿通科技	102	5,430.48	0.00
317	688353	华盛锂电	145	5,362.10	0.00
318	688570	天玛智控	208	5,268.64	0.00
319	688201	信安世纪	122	5,214.28	0.00
320	301323	新莱福	131	5,156.16	0.00
321	688358	祥生医疗	100	5,100.00	0.00
322	688020	方邦股份	100	4,997.00	0.00
323	688097	博众精工	162	4,918.32	0.00
324	688631	莱斯信息	163	4,868.81	0.00
325	301337	亚华电子	160	4,859.20	0.00
326	688628	优利德	100	4,859.00	0.00
327	688006	杭可科技	155	4,722.85	0.00
328	301345	涛涛车业	97	4,524.08	0.00
329	688698	伟创电气	98	3,918.04	0.00
330	688121	卓然股份	100	3,740.00	0.00
331	688122	西部超导	66	3,678.18	0.00
332	688207	格灵深瞳	140	3,486.00	0.00
333	688076	诺泰生物	79	2,810.82	0.00
334	688319	欧林生物	126	2,725.38	0.00
335	688081	兴图新科	140	2,683.80	0.00
336	002266	浙富控股	600	2,478.00	0.00
337	001282	三联锻造	74	2,444.22	0.00
338	688327	云从科技	140	2,422.00	0.00
339	688519	南亚新材	100	2,403.00	0.00
340	688788	科思科技	57	2,362.65	0.00
341	688360	德马科技	104	2,307.76	0.00
342	688567	孚能科技	100	2,159.00	0.00
343	688143	长盈通	57	2,148.90	0.00
344	001324	长青科技	107	2,097.20	0.00
345	688135	利扬芯片	94	2,061.42	0.00
346	688379	华光新材	100	2,031.00	0.00
347	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00
348	688351	微电生理	100	1,947.00	0.00

349	002899	英派斯	100	1,497.00	0.00
350	688553	汇宇制药	100	1,493.00	0.00
351	300988	津荣天宇	60	1,288.80	0.00
352	688165	埃夫特	100	1,263.00	0.00
353	688365	光云科技	81	1,168.02	0.00
354	688093	世华科技	46	922.76	0.00
355	688585	上纬新材	100	823.00	0.00
356	688299	长阳科技	39	611.13	0.00
357	688055	龙腾光电	126	511.56	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	300735	光弘科技	12,289,019.60	5.10
2	300379	东方通	11,222,389.00	4.66
3	600458	时代新材	8,247,861.29	3.42
4	002126	银轮股份	7,596,106.22	3.15
5	600114	东睦股份	7,384,114.00	3.07
6	002463	沪电股份	7,316,729.90	3.04
7	003021	兆威机电	6,381,053.00	2.65
8	301039	中集车辆	5,988,477.00	2.49
9	300131	英唐智控	5,858,619.71	2.43
10	688526	科前生物	5,800,279.85	2.41
11	688100	威胜信息	5,774,360.97	2.40
12	688598	金博股份	5,686,352.34	2.36
13	300872	天阳科技	5,550,288.40	2.30
14	300266	兴源环境	5,545,050.00	2.30
15	603305	旭升集团	5,461,471.59	2.27
16	600583	海油工程	5,415,230.00	2.25
17	002324	普利特	5,378,572.47	2.23
18	688408	中信博	5,373,183.24	2.23
19	300765	新诺威	5,302,030.00	2.20
20	301035	润丰股份	5,098,511.00	2.12
21	000488	晨鸣纸业	5,088,474.00	2.11
22	001696	宗申动力	5,024,276.00	2.09
23	300657	弘信电子	4,912,210.00	2.04
24	300666	江丰电子	4,895,090.08	2.03
25	000823	超声电子	4,878,005.00	2.03
26	300602	飞荣达	4,837,070.00	2.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出 金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300735	光弘科技	12,337,233.56	5.12
2	300379	东方通	10,831,278.00	4.50
3	002463	沪电股份	8,869,015.80	3.68
4	600458	时代新材	7,869,777.78	3.27
5	002126	银轮股份	7,732,269.96	3.21
6	600114	东睦股份	7,437,861.52	3.09
7	300327	中颖电子	7,339,673.00	3.05
8	002833	弘亚数控	7,041,888.40	2.92
9	688019	安集科技	6,635,996.25	2.75
10	300602	飞荣达	6,509,749.06	2.70
11	002695	煌上煌	6,311,051.00	2.62
12	688526	科前生物	6,104,706.39	2.53
13	603489	八方股份	6,052,185.87	2.51
14	003021	兆威机电	5,933,017.68	2.46
15	002324	普利特	5,927,539.00	2.46
16	301039	中集车辆	5,871,150.51	2.44
17	603305	旭升集团	5,772,429.64	2.40
18	688100	威胜信息	5,767,306.34	2.39
19	301035	润丰股份	5,749,108.00	2.39
20	300266	兴源环境	5,672,128.00	2.35
21	300131	英唐智控	5,601,563.00	2.33
22	300872	天阳科技	5,580,753.40	2.32
23	688598	金博股份	5,485,918.72	2.28
24	300765	新诺威	5,387,004.35	2.24
25	688037	芯源微	5,342,064.60	2.22
26	300657	弘信电子	5,250,775.00	2.18
27	600098	广州发展	5,231,926.44	2.17
28	688408	中信博	5,180,625.79	2.15
29	300394	天孚通信	5,142,848.00	2.13
30	000488	晨鸣纸业	5,101,148.00	2.12
31	603313	梦百合	5,094,460.90	2.11
32	002516	旷达科技	4,938,552.00	2.05
33	300666	江丰电子	4,886,959.09	2.03
34	600305	恒顺醋业	4,825,137.00	2.00
35	603118	共进股份	4,824,927.80	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	1,843,950,691.12
卖出股票收入（成交）总额	1,859,739,794.27

## 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。

## 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。

## 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	1,104,566.40
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	79,742.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,184,309.06

**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不存在流通受限情况。

**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不存在流通受限情况。

**7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

**§ 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 1000 指	2,766	51,858.48	6,056,442.41	4.22%	137,384,116.90	95.78%

数增强 A						
兴银中证 1000 指 数增强 C	3,163	32,792.56	248,528.88	0.24%	103,474,325.12	99.76%
合计	5,929	41,687.2	6,304,971.29	2.55%	240,858,442.02	97.45%

## 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 1000 指数增强 A	9.90	0.000007%
	兴银中证 1000 指数增强 C	24,154.06	0.023287%
	合计	24,163.96	0.009777%

## 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 1000 指数增强 A	0
	兴银中证 1000 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	兴银中证 1000 指数增强 A	0
	兴银中证 1000 指数增强 C	0~10
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	兴银中证 1000 指数 增强 A	兴银中证 1000 指数 增强 C
基金合同生效日（2022 年 01 月 26 日）基金份额总额	170,524,346.65	97,896,229.17
本报告期期初基金份额总额	165,443,457.50	119,162,627.45
本报告期基金总申购份额	20,602,916.86	35,488,386.36
减：本报告期基金总赎回份额	42,605,815.05	50,928,159.81
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	143,440,559.31	103,722,854.00

## § 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) 报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

无。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本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: 报告期内, 基金托管人及其高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位: 人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华福证券	2	3,700,093,801.94	100.00%	925,204.59	100.00%	-

注: 基金租用证券公司交易单元的选择标准是:

(1) 内部管理规范、严谨; 具备健全的内控制度, 并能满足基金运作高度保密的要求;

(2) 研究实力较强, 有固定的研究机构和专门研究人员, 能够针对基金业务需要, 提供高质量的研究报告和较为全面的服务;

(3) 能够积极推动多边业务合作, 最大限度地调动资源, 协助基金投资;

(4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。选择程序: 本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选证券公司的服务质量和研究实力进行评估, 确定选用交易单元的证券公司。

## 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 1000 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
5	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
6	兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金 2022 年年度报告	指定网站	2023-03-30
7	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
8	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
9	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
10	兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	指定网站	2023-04-22
11	关于旗下部分基金在平安银行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	2023-05-11
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	中国证券报、证券时报、证券	2023-05-27



	于董事长变更的公告	日报、上海证券报、指定网站	
--	-----------	---------------	--

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

### 12.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处。

### 12.3 查阅方式

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

兴银基金管理有限责任公司  
二〇二三年八月三十日