

# 东兴兴晟混合型证券投资基金

## 2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:东兴基金管理有限公司

基金托管人:浙商银行股份有限公司

送出日期:2023 年 08 月 31 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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18日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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2023年6月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
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	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	44
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所有股票投资明细	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	69
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	72
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	72
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	72
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	72
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	73
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	73
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	73
7.12 投资组合报告附注	73
§8 基金份额持有人信息	74
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	74
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	74

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	74
§9 开放式基金份额变动	74
§10 重大事件揭示	75
10.1 基金份额持有人大会决议	75
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	75
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	75
10.4 基金投资策略的改变	75
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	75
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	75
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	76
10.8 其他重大事件	77
§11 影响投资者决策的其他重要信息	77
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	77
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	77
§12 备查文件目录	78
12.1 备查文件目录	78
12.2 存放地点	78
12.3 查阅方式	78

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	东兴兴晟混合型证券投资基金	
基金简称	东兴兴晟混合	
基金主代码	009327	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年08月05日	
基金管理人	东兴基金管理有限公司	
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	54,855,979.49份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	东兴兴晟混合A	东兴兴晟混合C
下属分级基金的交易代码	009327	009328
报告期末下属分级基金的份额总额	44,591,364.33份	10,264,615.16份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置和投资管理，追求超越基金业绩比较基准的投资回报和基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将根据对宏观经济运行情况的预判和对市场运行情况的分析，来确定投资组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。 本基金根据经济运行周期变动、市场利率变化、市场估值、证券市场变化等因素以及基金的风险评估等灵活调整股票等权益类、债券等固定收益类和现金资产分布，动态调整各类资产在基金投资组合中的比例。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中高风险水平的投资品种。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		东兴基金管理有限公司	浙商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李宛霖	朱巍
	联系电话	400-670-1800	0571-87659806
	电子邮箱	xxpl@dxamc.cn	zhuwei@czbank.com
客户服务电话		400-670-1800	95527
传真		010-57307388	0571-88268688
注册地址		北京市丰台区东管头1号院1 号楼1-190室	杭州市萧山区鸿宁路1788号
办公地址		北京市西城区平安里西大街2 8号中海国际中心6层	杭州市拱墅区环城西路76号
邮政编码		100035	310006
法定代表人		牛南洁	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	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人 互联网网址	<a href="http://www.dxamc.cn">http://www.dxamc.cn</a>
基金中期报告备置地点	北京市西城区平安里西大街28号中海国际中心6 层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	东兴基金管理有限公司	北京市西城区平安里西大街28号中 海国际中心6层

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 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)

	东兴兴晟混合A	东兴兴晟混合C
本期已实现收益	1,093,200.11	192,825.80
本期利润	1,962,260.85	405,493.71
加权平均基金份额本期利润	0.0479	0.0462
本期加权平均净值利润率	4.17%	4.08%
本期基金份额净值增长率	6.28%	5.97%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末 (2023年06月30日)	
期末可供分配利润	6,568,330.99	1,308,259.06
期末可供分配基金份额利润	0.1473	0.1275
期末基金资产净值	51,159,695.32	11,572,874.22
期末基金份额净值	1.1473	1.1275
<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	14.73%	12.75%

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东兴兴晟混合A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.96%	0.75%	0.78%	0.52%	0.18%	0.23%
过去三个月	-1.56%	0.68%	-2.71%	0.49%	1.15%	0.19%
过去六个月	6.28%	0.68%	0.13%	0.50%	6.15%	0.18%
过去一年	0.12%	0.86%	-8.10%	0.59%	8.22%	0.27%
自基金合同	14.73%	0.96%	-9.95%	0.69%	24.68%	0.27%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

## 东兴兴晟混合C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.91%	0.75%	0.78%	0.52%	0.13%	0.23%
过去三个月	-1.70%	0.68%	-2.71%	0.49%	1.01%	0.19%
过去六个月	5.97%	0.68%	0.13%	0.50%	5.84%	0.18%
过去一年	-0.47%	0.86%	-8.10%	0.59%	7.63%	0.27%
自基金合同生效起至今	12.75%	0.96%	-9.95%	0.69%	22.70%	0.27%

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

东兴兴晟混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020年08月05日-2023年06月30日)





东兴兴晟混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：1、本基金基金合同生效日为2020年8月5日，根据相关法律法规和基金合同，本基金建仓期为基金合同生效之日起6个月内；

2、建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

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

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

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

截至2023年6月30日，本公司管理东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金、东兴蓝海财富灵活配置混合型证券投资基金、东兴安盈宝货币市场基金、东兴兴利债券型证券投资基金、东兴兴福一年定期开放债券型证券投资基金、东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金、东兴兴瑞一年定期开放债券型证券投资基金、东兴兴财短债债券型证券投资基金、东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金、东兴中证消费50指数证券投资基金、东兴兴晟混合型证券投资基金、东兴宸瑞量化混合型证券投资基金、东兴鑫享6个月滚动持有债券型发起式证券投资基金、东兴兴盈三个月定期开放债券型证券投资基金、东兴兴源债券型证券投资基金、东兴宸祥量化混合型证券投资基金、东兴连裕6个月滚动持有债券型证券投资基金共17只开放式基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李晨辉先生	本基金基金经理	2020-08-05	-	11年	毕业于中国科学院研究生院信号与信息处理专业，硕士研究生学历。2011年7月至2014年1月，任职东兴证券股份有限公司研究所行业研究员、高级行业研究员；2014年2月至2021年5月，任职东兴证券股份有限公司基金业务部高级研究员、基金经理助理、基金经理；2021年5月至今，任职东兴基金管理有限公司权益投资部基金经理。现任东兴蓝海财富灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东兴兴晟混合型证券投资基金基金经理。

李兵 伟 先 生	本基 金基 金经 理	2020- 09-07	-	12年	毕业于中央财经大学金融学专业，硕士研究生学历。2010年7月至2015年9月，任职信达证券金融工程研究员、投资主办人；2015年9月至2021年5月，任职东兴证券股份有限公司基金业务部；2021年5月至今，任职东兴基金管理有限公司权益投资部基金经理。现任东兴中证消费50指数证券投资基金基金经理、东兴兴晟混合型证券投资基金基金经理、东兴宸瑞量化混合型证券投资基金基金经理、东兴宸祥量化混合型证券投资基金基金经理。
-------------------	---------------------	----------------	---	-----	--

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

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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、中国证券监督管理委员会和《东兴兴晟混合型证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

基金管理人实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于交易所公开竞价交易，基金管理人执行交易系统中的公平交易程序；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易，在参与申购之

前，各基金经理应在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量。在获配额度确定后，按照价格优先的原则对交易结果进行分配；如果申购价格相同，则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配。债券一级市场申购分配不足最小单位的，可由基金经理协商分配，协商不一致则由投资总监决定；对于银行间市场交易，应按照场外交易流程执行，由各基金经理给出询价区间，交易部根据询价区间在银行间市场上应该按照价格优先、时间优先的原则进行询价并完成交易，并留存询价交易记录备查。

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

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

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度，在国内经济全面复苏、美联储加息见顶的预期下，北向资金持续净流入，A股全线上涨。随后美联储加息见顶的预期转向，全球股市大幅波动，叠加美欧银行业危机持续发酵，国内部分高频经济数据有所回落，北向资金净流入放缓，A股呈现震荡调整走势。二季度国内经济复苏斜率放缓，经济高频数据有所回落，消费方面，4月和5月社零虽因去年低基数同比录得较高值，但不及市场预期，且从环比看消费动能有所走弱；出口方面，全球经济放缓对我国出口的抑制作用开始显现，5月出口录得负值，且显著低于市场预期；投资方面，制造业投资保持韧性、基建投资继续维持高增速，但房地产投资在4月和5月连续两个月降幅再次加深。整体而言，内生动力不强、需求驱动不足、美联储加息预期再强化等多重因素叠加，导致市场对经济修复的预期有所下降，A股呈现震荡下行走势。

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

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2023年1月1日起至2023年6月30日，本基金A类份额净值增长率为6.28%，业绩比较基准收益率为0.13%，高于业绩比较基准6.15%；本基金C类份额净值增长率为5.97%，业绩比较基准收益率为0.13%，高于业绩比较基准5.84%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

往后看，国内货币政策保持稳健，美联储加息周期接近尾声，未来随着人民币贬值压力缓解，北向资金也有望呈现净流入态势。盈利层面，随着稳增长政策的持续发力和内需的不断修复，下半年库存周期有望见底回升，企业盈利也将温和改善。估值层面，从A股主要指数的估值和风险溢价来看，当前市场已反映较多悲观预期，中长期配置性价比较高。整体而言，下半年流动性有望改善，国内经济也将温和复苏，当前A股市场整体估值已降至较低水平，安全边际较高，未来市场表现值得期待。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

#### 4.8 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

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日出现基金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遵规守信、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--东兴基金管理有限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

本托管人依法对东兴基金管理有限公司编制和披露的东兴兴晟混合型证券投资基金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：东兴兴晟混合型证券投资基金

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	942,468.32	306,872.62
结算备付金		386,751.53	277,831.70
存出保证金		13,491.81	10,551.43
交易性金融资产	6.4.7.2	53,519,460.83	39,414,280.29
其中：股票投资		50,075,976.94	36,953,534.76
基金投资		-	-
债券投资		3,443,483.89	2,460,745.53
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	8,002,766.04	6,504,221.52
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		191,207.41	-
应收股利		-	-
应收申购款		119.85	230.49
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		63,056,265.79	46,513,988.05
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
		<b>2023年06月30日</b>	<b>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		78,090.33	358.08
应付管理人报酬		51,259.52	41,427.42
应付托管费		10,251.91	8,285.47
应付销售服务费		5,723.27	4,881.93
应付投资顾问费		-	-
应交税费		454.46	428.92
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	177,916.76	143,446.05
负债合计		323,696.25	198,827.87
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	54,855,979.49	43,011,290.71
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	7,876,590.05	3,303,869.47
净资产合计		62,732,569.54	46,315,160.18
负债和净资产总计		63,056,265.79	46,513,988.05

注：报告截止日2023年6月30日，东兴兴晟混合A基金份额净值1.1473 元，基金份额总额44,591,364.33份,东兴兴晟混合C基金份额净值1.1275 元，基金份额总额10,264,615.16份。

## 6.2 利润表

会计主体：东兴兴晟混合型证券投资基金

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
<b>一、营业总收入</b>		2,781,318.44	-1,289,591.76
1.利息收入		85,417.22	31,733.78
其中：存款利息收入	6.4.7.9	5,276.45	7,935.05
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		80,140.77	23,798.73
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,611,979.32	-3,120,511.56



其中：股票投资收益	6.4.7.10	1,037,989.11	-3,614,651.66
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	24,335.69	34,789.64
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	549,654.52	459,350.46
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	1,081,728.65	1,771,376.10
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	2,193.25	27,809.92
<b>减：二、营业总支出</b>		413,563.88	335,224.53
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	281,716.96	219,286.04
2. 托管费	6.4.10.2.2	56,343.47	43,857.25
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	29,492.10	26,472.84
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	368.22
其中：卖出回购金融资产 支出		-	368.22
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		288.51	85.68
8. 其他费用	6.4.7.19	45,722.84	45,154.50
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		2,367,754.56	-1,624,816.29
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,367,754.56	-1,624,816.29
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,367,754.56	-1,624,816.29

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：东兴兴晟混合型证券投资基金

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）	43,011,290.71	-	3,303,869.47	46,315,160.18
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）	43,011,290.71	-	3,303,869.47	46,315,160.18
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	11,844,688.78	-	4,572,720.58	16,417,409.36
（一）、综合收益总额	-	-	2,367,754.56	2,367,754.56
（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）	11,844,688.78	-	2,204,966.02	14,049,654.80
其中：1. 基金申购款	18,447,445.39	-	3,224,700.23	21,672,145.62
2. 基金赎回款	-6,602,756.61	-	-1,019,734.21	-7,622,490.82
（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）	54,855,979.49	-	7,876,590.05	62,732,569.54
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

		合收益		计
一、上期期末净资产（基金净值）	48,946,705.51	-	10,517,161.95	59,463,867.46
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）	48,946,705.51	-	10,517,161.95	59,463,867.46
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-4,226,015.48	-	-4,090,806.70	-8,316,822.18
（一）、综合收益总额	-	-	-1,624,816.29	-1,624,816.29
（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）	-4,226,015.48	-	-2,465,990.41	-6,692,005.89
其中：1. 基金申购款	21,380,204.76	-	508,182.38	21,888,387.14
2. 基金赎回款	-25,606,220.24	-	-2,974,172.79	-28,580,393.03
（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）	44,720,690.03	-	6,426,355.25	51,147,045.28

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：

牛南洁

郝洁

王广辉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

东兴兴晟混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据2020年3月17日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予东兴兴晟混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2020]455号）的批复，自2020年7月15日至2020年7月31日公开募集设立。本基金为混合型证券投资基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集384,935,258.14元人民币，业经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）“德师报(验)字(20)第00353号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《东兴兴晟混合型证券投资基金基金合同》于2020年8月5日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为384,994,177.87份，其中认购资金利息折合58,919.73份。本基金基金管理人为东兴基金管理有限公司（本基

金原基金管理人为东兴证券股份有限公司，自2021年5月24日起变更为东兴基金管理有限公司），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》和《东兴兴晟混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、股指期货、货币市场工具、同业存单、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为35%-80%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金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。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合企业会计准则及其他有关规定要求，真实、完整地反映了本基金2023年6月30日的财务状况以及2023年1月1日至2023年6月30日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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与上一年年度报告相一致。

#### 6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日。本期财务报表的实际编制期间为2023年1月1日至2023年6月30日。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### 1、金融资产的分类

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

基金持有的股票投资、债券投资、基金投资、资产支持证券投资等金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

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

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

##### 2、金融负债的分类

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

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按取得时的公允价值作为初始确认金额。取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包

含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

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

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

1、对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

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

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

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

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

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

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

##### （1）利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

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

##### （2）投资收益

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

债券、资产支持证券、同业存单等固定收益类金融资产的投资收益分为：

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

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

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

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

### (3) 公允价值变动损益

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

### (4) 其他收入

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

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 根据基金合同，基金管理费按前一日基金资产净值的1.00%的年费率逐日计提；

(2) 根据基金合同，基金托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率逐日计提；

(3) 根据基金合同，基金销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.60%的年费率逐日计提；

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

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的30%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

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

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



4、同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

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

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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

#### 6.4.4.12 分部报告

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

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他需要披露的重要会计政策和会计估计。

### 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

本基金在本报告期无需说明的重大会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期无需说明的重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期无需说明的重大会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税【2004】78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税【2005】103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税【2008】1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年4月23日发布的《上海、深圳证券交易所关于做好交易相关系统印花税率参数调整的通知》、2008年9月18日发布的《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税【2012】85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税【2015】101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税【2016】36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税【2016】70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》、

财税【2016】140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税【2017】2号《财政部、国家税务总局关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税【2017】56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作、财税【2017】90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

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

## 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	942,468.32
等于：本金	942,413.30
加：应计利息	55.02
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	942,468.32

#### 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	50,545,537.51	-	50,075,976.94	-469,560.57	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	3,392,107.00	44,083.89	3,443,483.89	7,293.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	3,392,107.00	44,083.89	3,443,483.89	7,293.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	53,937,644.51	44,083.89	53,519,460.83	-462,267.57	

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

**6.4.7.4 买入返售金融资产****6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	8,002,766.04	-
银行间市场	-	-
合计	8,002,766.04	-

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 其他资产**

本基金本报告期末未持有其他资产。

**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	132,193.92
其中：交易所市场	132,193.92
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	45,722.84
合计	177,916.76

注：预提费用为按日计提的审计费和信息披露费。

**6.4.7.7 实收基金****6.4.7.7.1 东兴兴晟混合A**

金额单位：人民币元

项目 (东兴兴晟混合A)	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	35,442,223.70	35,442,223.70
本期申购	12,811,458.88	12,811,458.88
本期赎回(以“-”号填列)	-3,662,318.25	-3,662,318.25
本期末	44,591,364.33	44,591,364.33

## 6.4.7.7.2 东兴兴晟混合C

金额单位：人民币元

项目 (东兴兴晟混合C)	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	7,569,067.01	7,569,067.01
本期申购	5,635,986.51	5,635,986.51
本期赎回(以“-”号填列)	-2,940,438.36	-2,940,438.36
本期末	10,264,615.16	10,264,615.16

## 6.4.7.8 未分配利润

## 6.4.7.8.1 东兴兴晟混合A

单位：人民币元

项目 (东兴兴晟混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,469,929.44	-3,650,740.20	2,819,189.24
本期利润	1,093,200.11	869,060.74	1,962,260.85
本期基金份额交易产生的变动数	2,082,188.65	-295,307.75	1,786,880.90
其中：基金申购款	2,865,122.83	-488,389.76	2,376,733.07
基金赎回款	-782,934.18	193,082.01	-589,852.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,645,318.20	-3,076,987.21	6,568,330.99

## 6.4.7.8.2 东兴兴晟混合C

单位：人民币元

项目 (东兴兴晟混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,256,246.64	-771,566.41	484,680.23
本期利润	192,825.80	212,667.91	405,493.71
本期基金份额交易产生的变动数	561,275.94	-143,190.82	418,085.12
其中：基金申购款	1,147,930.37	-299,963.21	847,967.16
基金赎回款	-586,654.43	156,772.39	-429,882.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,010,348.38	-702,089.32	1,308,259.06

## 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	2,490.83
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	2,691.91
其他	93.71
合计	5,276.45

注：其他为结算保证金利息收入。

## 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	148,529,791.62
减：卖出股票成本总额	147,095,818.06

减：交易费用	395,984.45
买卖股票差价收入	1,037,989.11

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
债券投资收益——利息收入	25,878.83
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,543.14
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	24,335.69

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,462,652.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,413,543.14
减：应计利息总额	50,652.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-1,543.14

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 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	549,654.52
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	549,654.52

#### 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	1,081,728.65
——股票投资	1,072,651.31
——债券投资	9,077.34
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	1,081,728.65

#### 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	2,138.93
转换费收入	54.32
合计	2,193.25

#### 6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.19 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	9,421.05
信息披露费	36,301.79
证券出借违约金	-
合计	45,722.84

### 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

本基金本报告期末不存在需要说明的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本基金报告报出日，本基金不存在需要说明的资产负债表日后事项。

### 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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 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
中国东方资产管理股份有限公司	基金管理人的实际控制人
东兴证券股份有限公司	基金管理人的控股股东、基金销售机构
东兴基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
浙商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

大连银行股份有限公司	与基金管理人同一实际控制人的关联方、基金销售机构
------------	--------------------------

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 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

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期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

本基金本报告期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

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方的佣金费用，期末无应支付关联方的佣金。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	281,716.96	219,286.04
其中：支付销售机构的客户维护费	118,080.90	97,855.93

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.00%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

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

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年01月01日至2023年06月30日	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	56,343.47	43,857.25

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

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

#### 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		
	东兴兴晟混合A	东兴兴晟混合C	合计
东兴证券股份有限公司	0.00	7,865.26	7,865.26
浙商银行股份有限公司	0.00	16,234.11	16,234.11
大连银行股份有限公司	0.00	522.23	522.23
合计	0.00	24,621.60	24,621.60
获得销售服务费的各关	上年度可比期间		

关联方名称	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		
	东兴兴晟混 合A	东兴兴晟混合C	合计
东兴证券股份有限公司	0.00	11,224.95	11,224.95
浙商银行股份有限公司	0.00	12,343.76	12,343.76
大连银行股份有限公司	0.00	164.39	164.39
合计	0.00	23,733.10	23,733.10

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按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.60%的年费率计提。C类基金份额销售服务费的计算方法如下：

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

H为C类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E为前一日的C类基金份额基金资产净值

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

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间，未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

本基金本报告期及上年度可比期间，未发生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。

##### 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

本基金本报告期及上年度可比期间，未发生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。

#### 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**

东兴兴晟混合A

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2023年01月01日至 2023年06月30日	2022年01月01日至 2022年06月30日
报告期初持有的基金份额	0.00	12,999,000.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	12,999,000.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

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

**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**

本基金本报告期末及上年末除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

**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		上年度可比期间	
	2023年01月01日至2023年06月30日		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	942,468.32	2,490.83	1,416,280.34	4,856.19

注：由浙商银行股份有限公司保管的银行存款为活期存款，利息收入为活期存款利息收入。

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本报告期及上年度可比期间，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

本报告期及上年度可比期间，本基金无其他关联交易事项的说明。

#### 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

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

#### 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

###### 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在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

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

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

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

##### 6.4.13.2 信用风险

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

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

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

#### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末和上年度末持有债券为国债，未包含在按短期信用评级列示的债券投资中。

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

本基金本报告期末及上年度末未持有资产支持证券。

#### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度末未持有同业存单。

#### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末和上年度末持有债券为国债，未包含在按长期信用评级列示的债券投资中。

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

本基金本报告期末及上年度末未持有资产支持证券。

#### **6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度末未持有同业存单。

### **6.4.13.3 流动性风险**

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

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

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

于2023年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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

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

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

#### **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。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利



率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

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

#### 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	942,413.30	-	-	-	-	55.02	942,468.32
结算备付金	386,577.53	-	-	-	-	174.00	386,751.53
存出保证金	13,485.71	-	-	-	-	6.10	13,491.81
交易性金融资产	799,920.00	-	2,599,480.00	-	-	50,120,060.83	53,519,460.83
买入返售金融资产	8,000,000.00	-	-	-	-	2,766.04	8,002,766.04
应收清算款	-	-	-	-	-	191,207.41	191,207.41
应收申购款	-	-	-	-	-	119.85	119.85
资产总计	10,142,396.54	-	2,599,480.00	-	-	50,314,389.25	63,056,265.79
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	78,090.33	78,090.33
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	51,259.52	51,259.52
应付托管费	-	-	-	-	-	10,251.91	10,251.91
应付销售服务费	-	-	-	-	-	5,723.27	5,723.27
应交税费	-	-	-	-	-	454.46	454.46
其他负债	-	-	-	-	-	177,916.76	177,916.76
负债总计	-	-	-	-	-	323,696.25	323,696.25
利率敏感度缺口	10,142,396.54	-	2,599,480.00	-	-	49,990,693.00	62,732,569.54
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	306,807.62	-	-	-	-	65.00	306,872.62
结算备付金	277,694.20	-	-	-	-	137.50	277,831.70
存出保证金	10,546.15	-	-	-	-	5.28	10,551.43
交易性金融资产	2,411,758.80	-	-	-	-	37,002,521.49	39,414,280.29
买入返售金融资产	6,500,000.00	-	-	-	-	4,221.52	6,504,221.52
应收申购款	-	-	-	-	-	230.49	230.49
资产总计	9,506,806.77	-	-	-	-	37,007,181.28	46,513,988.05
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	358.08	358.08
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	41,427.42	41,427.42
应付托管费	-	-	-	-	-	8,285.47	8,285.47

应付销售服务费	-	-	-	-	-	4,881.93	4,881.93
应交税费	-	-	-	-	-	428.92	428.92
其他负债	-	-	-	-	-	143,446.05	143,446.05
负债总计	-	-	-	-	-	198,827.87	198,827.87
利率敏感度缺口	9,506,806.77	-	-	-	-	36,808,353.41	46,315,160.18

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况； 2、所有期限的利率均以相同幅度变动25个基点，其他市场变量均不发生变化； 3、银行存款、结算备付金、存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益、而对其本身的公允价值无重大影响； 4、该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	1、市场利率上升25个基点	-2,188.57	-214.63
2、市场利率下降25个基点	2,191.92	214.67	

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

##### 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	50,075,976.94	79.82	36,953,534.76	79.79
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	3,443,483.89	5.49	2,460,745.53	5.31
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	53,519,460.83	85.31	39,414,280.29	85.10

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	市场其他变量保持不变，只有业绩比较基准所对应的市场组合价格发生合理、可能的变动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	业绩比较基准变动+5%	3,051,785.72	2,384,048.73
	业绩比较基准变动-5%	-3,051,785.72	-2,384,048.73

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

##### 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

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末	上年度末
---------------	-----	------

	2023年06月30日	2022年12月31日
第一层次	50,075,976.94	36,953,534.76
第二层次	3,443,483.89	2,460,745.53
第三层次	-	-
合计	53,519,460.83	39,414,280.29

#### 6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本报告期内不存在持有的金融工具公允价值所属层次间发生重大变动的情况。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期内不存在持有非持续以公允价值计量的金融工具的情况。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金本报告期内不存在持有不以公允价值计量的金融工具的情况。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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

## §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	50,075,976.94	79.41
	其中：股票	50,075,976.94	79.41
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,443,483.89	5.46
	其中：债券	3,443,483.89	5.46
	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	8,002,766.04	12.69
	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	1,329,219.85	2.11
8	其他各项资产	204,819.07	0.32
9	合计	63,056,265.79	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	264,897.00	0.42
B	采矿业	1,242,985.70	1.98
C	制造业	32,111,385.14	51.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,028,425.31	3.23
E	建筑业	1,559,837.20	2.49
F	批发和零售业	1,166,370.99	1.86
G	交通运输、仓储和邮政业	897,672.71	1.43
H	住宿和餐饮业	285,420.00	0.45
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,946,875.51	4.70
J	金融业	5,184,105.76	8.26
K	房地产业	599,930.62	0.96
L	租赁和商务服务业	983,638.30	1.57
M	科学研究和技术服务业	380,384.90	0.61
N	水利、环境和公共设施管理业	194,094.00	0.31
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	47,066.00	0.08
Q	卫生和社会工作	30,200.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	131,791.80	0.21
S	综合	20,896.00	0.03
	合计	50,075,976.94	79.82

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	002025	航天电器	12,200	778,360.00	1.24
2	600642	申能股份	105,600	738,144.00	1.18
3	600057	厦门象屿	80,000	696,000.00	1.11
4	002885	京泉华	30,360	663,062.40	1.06
5	002929	润建股份	15,100	655,491.00	1.04
6	688599	天合光能	15,223	648,652.03	1.03
7	601618	中国中冶	161,800	642,346.00	1.02
8	603368	柳药集团	25,100	620,221.00	0.99
9	601169	北京银行	127,600	590,788.00	0.94
10	600745	闻泰科技	12,000	586,800.00	0.94
11	300791	仙乐健康	18,900	548,856.00	0.87
12	002737	葵花药业	22,500	547,650.00	0.87
13	000630	铜陵有色	179,900	519,911.00	0.83
14	600060	海信视像	20,700	512,325.00	0.82
15	688063	派能科技	2,540	503,555.00	0.80
16	002815	崇达技术	40,200	500,490.00	0.80
17	605090	九丰能源	21,700	484,561.00	0.77
18	601390	中国中铁	62,600	474,508.00	0.76
19	002768	国恩股份	19,500	471,705.00	0.75
20	600362	江西铜业	23,800	451,724.00	0.72
21	000728	国元证券	68,100	444,012.00	0.71
22	600582	天地科技	75,200	438,416.00	0.70
23	600548	深高速	48,800	438,224.00	0.70
24	002020	京新药业	33,960	435,367.20	0.69
25	600999	招商证券	32,000	434,240.00	0.69
26	600926	杭州银行	36,900	433,575.00	0.69
27	002461	珠江啤酒	48,700	429,047.00	0.68

28	300925	法本信息	29,500	416,835.00	0.66
29	603309	维力医疗	22,900	354,263.00	0.56
30	600528	中铁工业	35,700	352,716.00	0.56
31	603369	今世缘	6,600	348,480.00	0.56
32	000001	平安银行	30,600	343,638.00	0.55
33	601658	邮储银行	69,700	340,833.00	0.54
34	300232	洲明科技	37,200	340,008.00	0.54
35	000682	东方电子	34,400	334,368.00	0.53
36	002276	万马股份	27,600	334,236.00	0.53
37	603878	武进不锈	39,380	332,761.00	0.53
38	300636	同和药业	26,968	330,627.68	0.53
39	688819	天能股份	8,813	324,670.92	0.52
40	603639	海利尔	18,020	322,918.40	0.51
41	600875	东方电气	17,300	322,645.00	0.51
42	601318	中国平安	6,900	320,160.00	0.51
43	605088	冠盛股份	18,300	313,845.00	0.50
44	600583	海油工程	52,600	307,710.00	0.49
45	600908	无锡银行	57,100	306,056.00	0.49
46	300389	艾比森	15,000	305,550.00	0.49
47	300900	广联航空	10,400	299,624.00	0.48
48	603198	迎驾贡酒	4,600	293,480.00	0.47
49	002732	燕塘乳业	13,500	291,870.00	0.47
50	002249	大洋电机	50,900	290,130.00	0.46
51	601818	光大银行	93,000	285,510.00	0.46
52	601007	金陵饭店	33,500	285,420.00	0.45
53	002409	雅克科技	3,900	284,232.00	0.45
54	601211	国泰君安	20,100	281,199.00	0.45
55	000027	深圳能源	42,489	280,002.51	0.45
56	600061	国投资本	38,800	276,256.00	0.44
57	002829	星网宇达	6,200	272,366.00	0.43
58	603657	春光科技	14,500	254,475.00	0.41

59	600566	济川药业	8,700	252,648.00	0.40
60	601717	郑煤机	20,200	251,490.00	0.40
61	688589	力合微	5,965	243,014.10	0.39
62	603300	华铁应急	44,476	242,394.20	0.39
63	600285	羚锐制药	14,881	238,988.86	0.38
64	605166	聚合顺	25,500	237,660.00	0.38
65	601898	中煤能源	27,700	233,788.00	0.37
66	603158	腾龙股份	30,400	232,864.00	0.37
67	688217	睿昂基因	5,698	228,774.70	0.36
68	002705	新宝股份	12,300	221,769.00	0.35
69	002065	东华软件	30,600	216,036.00	0.34
70	002947	恒铭达	10,300	214,652.00	0.34
71	300750	宁德时代	920	210,486.80	0.34
72	002237	恒邦股份	18,800	204,732.00	0.33
73	688239	航宇科技	2,909	203,484.55	0.32
74	002772	众兴菌业	17,400	196,620.00	0.31
75	605266	健之佳	2,321	194,569.43	0.31
76	002649	博彦科技	12,800	180,864.00	0.29
77	601600	中国铝业	32,800	180,072.00	0.29
78	002752	昇兴股份	37,400	177,650.00	0.28
79	603919	金徽酒	7,400	173,752.00	0.28
80	600741	华域汽车	9,400	173,524.00	0.28
81	600223	福瑞达	16,200	166,212.00	0.26
82	002155	湖南黄金	13,300	162,260.00	0.26
83	688621	阳光诺和	2,756	162,107.92	0.26
84	300231	银信科技	17,800	158,598.00	0.25
85	000166	申万宏源	34,100	157,542.00	0.25
86	603611	诺力股份	5,800	152,772.00	0.24
87	002381	双箭股份	19,700	152,084.00	0.24
88	603676	卫信康	10,800	149,256.00	0.24
89	300452	山河药辅	8,300	144,752.00	0.23



90	601965	中国汽研	7,000	144,550.00	0.23
91	600109	国金证券	16,500	143,055.00	0.23
92	300884	狄耐克	10,700	141,668.00	0.23
93	600479	千金药业	12,500	141,000.00	0.22
94	002396	星网锐捷	6,200	140,058.00	0.22
95	688226	威腾电气	6,194	135,153.08	0.22
96	688517	金冠电气	6,126	134,526.96	0.21
97	603220	中贝通信	7,400	126,170.00	0.20
98	600012	皖通高速	12,000	125,760.00	0.20
99	688663	新风光	3,894	123,790.26	0.20
100	605177	东亚药业	5,000	123,200.00	0.20
101	600039	四川路桥	12,420	121,840.20	0.19
102	300504	天邑股份	6,000	120,420.00	0.19
103	603093	南华期货	11,000	119,790.00	0.19
104	688611	杭州柯林	2,774	118,865.90	0.19
105	300450	先导智能	3,200	115,744.00	0.18
106	300908	仲景食品	2,500	113,375.00	0.18
107	600665	天地源	27,600	111,780.00	0.18
108	600967	内蒙一机	10,800	109,080.00	0.17
109	603987	康德莱	8,300	107,236.00	0.17
110	600007	中国国贸	5,600	103,712.00	0.17
111	002594	比亚迪	400	103,308.00	0.16
112	300224	正海磁材	8,000	102,880.00	0.16
113	300136	信维通信	5,000	100,400.00	0.16
114	603187	海容冷链	5,000	99,950.00	0.16
115	688093	世华科技	4,888	98,053.28	0.16
116	601688	华泰证券	7,100	97,767.00	0.16
117	600483	福能股份	8,400	97,020.00	0.15
118	300034	钢研高纳	2,400	94,536.00	0.15
119	600600	青岛啤酒	900	93,267.00	0.15
120	603687	大胜达	10,800	92,016.00	0.15

121	000534	万泽股份	5,200	87,204.00	0.14
122	300674	宇信科技	4,900	86,632.00	0.14
123	688006	杭可科技	2,826	86,108.22	0.14
124	002782	可立克	5,600	85,624.00	0.14
125	300823	建科机械	4,100	84,255.00	0.13
126	603508	思维列控	4,900	83,545.00	0.13
127	688138	清溢光电	3,885	82,012.35	0.13
128	600820	隧道股份	13,400	80,534.00	0.13
129	688329	艾隆科技	2,422	78,472.80	0.13
130	000733	振华科技	800	76,680.00	0.12
131	002443	金洲管道	11,500	76,590.00	0.12
132	300181	佐力药业	6,100	74,481.00	0.12
133	002179	中航光电	1,626	73,739.10	0.12
134	002851	麦格米特	2,000	72,940.00	0.12
135	688687	凯因科技	2,454	72,393.00	0.12
136	603630	拉芳家化	4,500	71,865.00	0.11
137	002130	沃尔核材	8,700	70,644.00	0.11
138	002695	煌上煌	6,600	70,554.00	0.11
139	603506	南都物业	5,900	69,797.00	0.11
140	300109	新开源	2,800	69,636.00	0.11
141	002446	盛路通信	7,300	68,985.00	0.11
142	003043	华亚智能	1,200	67,764.00	0.11
143	605189	富春染织	4,120	67,609.20	0.11
144	002335	科华数据	1,880	67,586.00	0.11
145	603799	华友钴业	1,400	64,274.00	0.10
146	301076	新瀚新材	3,200	62,784.00	0.10
147	603896	寿仙谷	1,400	62,020.00	0.10
148	003002	壶化股份	3,900	61,698.00	0.10
149	605287	德才股份	2,600	61,620.00	0.10
150	600795	国电电力	15,900	60,897.00	0.10
151	301026	浩通科技	1,700	60,724.00	0.10

152	300796	贝斯美	5,000	60,150.00	0.10
153	300723	一品红	2,000	58,600.00	0.09
154	688257	新锐股份	2,136	56,625.36	0.09
155	688092	爱科科技	1,826	54,542.62	0.09
156	605218	伟时电子	3,500	54,250.00	0.09
157	605058	澳弘电子	2,400	53,880.00	0.09
158	300453	三鑫医疗	7,700	52,591.00	0.08
159	000417	合肥百货	11,200	52,416.00	0.08
160	601229	上海银行	9,000	51,750.00	0.08
161	300258	精锻科技	3,500	50,715.00	0.08
162	002540	亚太科技	8,700	50,286.00	0.08
163	300705	九典制药	1,900	50,217.00	0.08
164	002968	新大正	3,300	49,863.00	0.08
165	300443	金雷股份	1,400	49,630.00	0.08
166	603203	快克智能	1,580	48,632.40	0.08
167	300014	亿纬锂能	800	48,400.00	0.08
168	300319	麦捷科技	5,600	47,936.00	0.08
169	300861	美畅股份	1,100	47,707.00	0.08
170	688195	腾景科技	885	47,285.55	0.08
171	600435	北方导航	4,100	47,109.00	0.08
172	603787	新日股份	2,800	47,068.00	0.08
173	600030	中信证券	2,370	46,878.60	0.07
174	600765	中航重机	1,760	46,657.60	0.07
175	301004	嘉益股份	1,200	46,560.00	0.07
176	688698	伟创电气	1,164	46,536.72	0.07
177	300073	当升科技	900	45,297.00	0.07
178	603527	众源新材	3,700	45,214.00	0.07
179	300639	凯普生物	4,488	44,969.76	0.07
180	300105	龙源技术	6,700	44,957.00	0.07
181	603136	天目湖	1,700	43,860.00	0.07
182	688616	西力科技	3,288	43,500.24	0.07

183	605123	派克新材	400	43,460.00	0.07
184	002507	涪陵榨菜	2,340	42,845.40	0.07
185	300777	中简科技	900	42,534.00	0.07
186	601126	四方股份	2,800	42,532.00	0.07
187	300382	斯莱克	3,200	42,208.00	0.07
188	002917	金奥博	3,400	42,024.00	0.07
189	000568	泸州老窖	200	41,914.00	0.07
190	603690	至纯科技	1,200	41,808.00	0.07
191	300532	今天国际	2,000	41,120.00	0.07
191	300481	濮阳惠成	2,000	41,120.00	0.07
193	301031	中熔电气	300	40,713.00	0.06
194	002429	兆驰股份	7,400	40,700.00	0.06
195	688345	博力威	1,092	40,524.12	0.06
196	300693	盛弘股份	1,096	40,464.32	0.06
197	603233	大参林	1,440	40,334.40	0.06
198	600833	第一医药	2,900	40,310.00	0.06
199	002391	长青股份	5,800	39,846.00	0.06
200	000153	丰原药业	3,900	39,390.00	0.06
201	002937	兴瑞科技	1,600	39,360.00	0.06
202	603809	豪能股份	3,500	39,305.00	0.06
203	603712	七一二	1,300	39,273.00	0.06
204	002459	晶澳科技	940	39,198.00	0.06
205	002014	永新股份	4,500	39,060.00	0.06
206	000550	江铃汽车	2,800	38,752.00	0.06
207	000885	城发环境	2,900	38,599.00	0.06
208	300438	鹏辉能源	800	38,432.00	0.06
209	600123	兰花科创	4,680	38,282.40	0.06
210	000776	广发证券	2,600	38,246.00	0.06
211	001205	盛航股份	1,800	38,196.00	0.06
212	601899	紫金矿业	3,300	37,521.00	0.06
213	002826	易明医药	3,400	37,434.00	0.06

214	002899	英派斯	2,500	37,425.00	0.06
215	600941	中国移动	400	37,320.00	0.06
216	300839	博汇股份	2,800	37,212.00	0.06
217	300775	三角防务	1,100	37,158.00	0.06
218	688566	吉贝尔	950	37,059.50	0.06
219	688556	高测股份	694	36,879.16	0.06
220	600284	浦东建设	6,000	36,720.00	0.06
221	002643	万润股份	2,100	36,561.00	0.06
222	601006	大秦铁路	4,900	36,407.00	0.06
223	300121	阳谷华泰	3,800	36,290.00	0.06
224	603507	振江股份	1,000	36,260.00	0.06
225	300771	智莱科技	3,300	35,937.00	0.06
226	002216	三全食品	2,300	35,834.00	0.06
227	600129	太极集团	600	35,694.00	0.06
228	603456	九洲药业	1,300	35,594.00	0.06
229	301258	富士莱	900	35,388.00	0.06
230	300684	中石科技	1,600	35,360.00	0.06
231	002955	鸿合科技	1,500	35,325.00	0.06
232	002978	安宁股份	1,100	35,321.00	0.06
233	688559	海目星	751	35,304.51	0.06
234	300059	东方财富	2,468	35,045.60	0.06
235	688628	优利德	720	34,984.80	0.06
236	002803	吉宏股份	1,700	34,782.00	0.06
237	601288	农业银行	9,800	34,594.00	0.06
238	603697	有友食品	3,740	34,295.80	0.05
239	300772	运达股份	2,656	34,209.28	0.05
240	600803	新奥股份	1,800	34,164.00	0.05
240	600206	有研新材	2,600	34,164.00	0.05
242	605507	国邦医药	1,600	34,032.00	0.05
243	600863	内蒙华电	8,200	34,030.00	0.05
244	688358	祥生医疗	663	33,813.00	0.05

245	601601	中国太保	1,300	33,774.00	0.05
246	600968	海油发展	11,000	33,770.00	0.05
247	688711	宏微科技	574	33,487.16	0.05
248	600973	宝胜股份	6,900	33,465.00	0.05
249	603228	景旺电子	1,300	33,345.00	0.05
250	600036	招商银行	1,000	32,760.00	0.05
251	603267	鸿远电子	500	32,650.00	0.05
252	600419	天润乳业	2,000	32,440.00	0.05
253	601689	拓普集团	400	32,280.00	0.05
254	300811	铂科新材	540	32,097.60	0.05
255	688122	西部超导	575	32,044.75	0.05
256	603768	常青股份	1,800	31,986.00	0.05
257	600901	江苏金租	7,700	31,801.00	0.05
258	600028	中国石化	5,000	31,800.00	0.05
259	002938	鹏鼎控股	1,300	31,577.00	0.05
260	300856	科思股份	400	31,508.00	0.05
261	002560	通达股份	3,300	31,416.00	0.05
262	688658	悦康药业	1,502	31,256.62	0.05
263	301028	东亚机械	2,800	31,220.00	0.05
264	600998	九州通	2,980	30,932.40	0.05
265	603883	老百姓	1,034	30,864.90	0.05
266	688682	霍莱沃	368	30,816.32	0.05
267	002910	庄园牧场	2,800	30,800.00	0.05
268	603086	先达股份	4,480	30,688.00	0.05
269	002991	甘源食品	400	30,680.00	0.05
270	002993	奥海科技	900	30,528.00	0.05
271	688037	芯源微	178	30,429.10	0.05
272	603105	芯能科技	1,800	30,402.00	0.05
273	601138	工业富联	1,200	30,240.00	0.05
274	603882	金域医学	400	30,200.00	0.05
275	002448	中原内配	4,300	30,100.00	0.05

276	688659	元琛科技	1,777	30,084.61	0.05
277	300696	爱乐达	1,220	30,012.00	0.05
278	300870	欧陆通	500	29,965.00	0.05
279	300873	海晨股份	1,500	29,835.00	0.05
280	002478	常宝股份	4,000	29,800.00	0.05
281	603699	纽威股份	2,000	29,760.00	0.05
282	601918	新集能源	7,000	29,750.00	0.05
283	600784	鲁银投资	4,100	29,684.00	0.05
284	002422	科伦药业	1,000	29,680.00	0.05
285	688166	博瑞医药	1,343	29,532.57	0.05
286	300797	钢研纳克	1,600	29,504.00	0.05
287	688390	固德威	176	29,367.36	0.05
288	603535	嘉诚国际	1,800	29,232.00	0.05
289	300514	友讯达	2,000	29,180.00	0.05
290	603388	元成股份	2,900	29,174.00	0.05
291	688596	正帆科技	673	29,140.90	0.05
292	601857	中国石油	3,900	29,133.00	0.05
293	300881	盛德鑫泰	880	28,996.00	0.05
294	605183	确成股份	1,600	28,960.00	0.05
295	601890	亚星锚链	2,500	28,950.00	0.05
296	601985	中国核电	4,100	28,905.00	0.05
297	605158	华达新材	3,800	28,880.00	0.05
298	603993	洛阳钼业	5,400	28,782.00	0.05
299	600458	时代新材	2,400	28,776.00	0.05
300	300890	翔丰华	700	28,770.00	0.05
301	603586	金麒麟	1,800	28,746.00	0.05
302	603118	共进股份	2,160	28,706.40	0.05
303	300815	玉禾田	1,920	28,569.60	0.05
304	002149	西部材料	1,700	28,543.00	0.05
305	688378	奥来德	577	28,503.80	0.05
306	002957	科瑞技术	1,400	28,378.00	0.05

307	688677	海泰新光	500	28,370.00	0.05
308	688597	煜邦电力	2,806	28,340.60	0.05
309	000099	中信海直	3,000	28,320.00	0.05
310	603890	春秋电子	3,300	28,248.00	0.05
311	300769	德方纳米	256	28,218.88	0.04
312	300511	雪榕生物	3,700	28,120.00	0.04
313	601137	博威合金	1,800	28,008.00	0.04
314	601881	中国银河	2,400	27,864.00	0.04
315	300470	中密控股	600	27,732.00	0.04
316	600132	重庆啤酒	300	27,648.00	0.04
317	002412	汉森制药	4,200	27,594.00	0.04
318	000888	峨眉山 A	2,400	27,504.00	0.04
319	601901	方正证券	4,200	27,468.00	0.04
320	300642	透景生命	1,360	27,431.20	0.04
321	002057	中钢天源	2,600	27,300.00	0.04
322	603059	倍加洁	1,200	27,288.00	0.04
323	000661	长春高新	200	27,260.00	0.04
324	000513	丽珠集团	700	27,237.00	0.04
325	600210	紫江企业	5,100	27,132.00	0.04
326	601238	广汽集团	2,600	27,092.00	0.04
327	603006	联明股份	2,300	27,048.00	0.04
328	600425	青松建化	6,100	26,962.00	0.04
329	688557	兰剑智能	764	26,953.92	0.04
330	603613	国联股份	728	26,885.04	0.04
331	688625	呈和科技	686	26,884.34	0.04
332	600846	同济科技	2,400	26,880.00	0.04
333	300447	全信股份	1,400	26,866.00	0.04
334	300138	晨光生物	1,500	26,850.00	0.04
335	300643	万通智控	2,000	26,720.00	0.04
336	600380	健康元	2,100	26,691.00	0.04
337	000060	中金岭南	5,600	26,600.00	0.04



338	600098	广州发展	4,300	26,574.00	0.04
339	600883	博闻科技	3,500	26,565.00	0.04
340	600229	城市传媒	3,100	26,412.00	0.04
341	603609	禾丰股份	2,900	26,390.00	0.04
342	000552	甘肃能化	7,900	26,307.00	0.04
343	600580	卧龙电驱	1,800	26,298.00	0.04
344	002304	洋河股份	200	26,270.00	0.04
345	688016	心脉医疗	146	26,262.48	0.04
346	603161	科华控股	1,800	26,226.00	0.04
347	600929	雪天盐业	3,300	26,202.00	0.04
348	002140	东华科技	2,900	26,187.00	0.04
349	601500	通用股份	6,400	26,176.00	0.04
350	603939	益丰药房	707	26,159.00	0.04
351	002327	富安娜	3,100	26,102.00	0.04
352	688678	福立旺	1,228	26,095.00	0.04
353	688799	华纳药厂	639	25,956.18	0.04
354	600059	古越龙山	2,500	25,950.00	0.04
355	002821	凯莱英	220	25,929.20	0.04
356	002790	瑞尔特	2,700	25,920.00	0.04
357	300699	光威复材	840	25,914.00	0.04
358	300801	泰和科技	1,600	25,760.00	0.04
358	002452	长高电新	3,500	25,760.00	0.04
360	600971	恒源煤电	3,300	25,707.00	0.04
361	000975	银泰黄金	2,184	25,552.80	0.04
362	002847	盐津铺子	300	25,515.00	0.04
363	300218	安利股份	2,700	25,434.00	0.04
364	603027	千禾味业	1,200	25,344.00	0.04
365	600064	南京高科	3,800	25,118.00	0.04
366	603579	荣泰健康	1,200	25,104.00	0.04
367	603279	景津装备	800	25,088.00	0.04
368	002765	蓝黛科技	3,000	25,080.00	0.04

369	603856	东宏股份	1,900	25,061.00	0.04
370	600066	宇通客车	1,700	25,058.00	0.04
371	002959	小熊电器	300	25,050.00	0.04
372	603966	法兰泰克	1,980	25,007.40	0.04
373	600919	江苏银行	3,400	24,990.00	0.04
374	603305	旭升集团	896	24,971.52	0.04
375	688278	特宝生物	568	24,940.88	0.04
376	600436	片仔癀	87	24,913.32	0.04
377	002449	国星光电	2,800	24,892.00	0.04
378	603416	信捷电气	600	24,786.00	0.04
378	600459	贵研铂业	1,620	24,786.00	0.04
380	002637	赞宇科技	2,400	24,744.00	0.04
381	000596	古井贡酒	100	24,738.00	0.04
382	002709	天赐材料	600	24,714.00	0.04
383	000915	华特达因	700	24,703.00	0.04
384	002825	纳尔股份	1,980	24,690.60	0.04
385	300476	胜宏科技	1,024	24,688.64	0.04
386	000883	湖北能源	5,400	24,624.00	0.04
387	600831	广电网络	4,100	24,600.00	0.04
388	002873	新天药业	1,816	24,552.32	0.04
389	300556	丝路视觉	1,000	24,540.00	0.04
390	601958	金钼股份	2,200	24,530.00	0.04
391	600764	中国海防	900	24,498.00	0.04
392	300040	九洲集团	3,900	24,453.00	0.04
393	300596	利安隆	600	24,402.00	0.04
394	688067	爱威科技	1,109	24,398.00	0.04
395	002687	乔治白	5,075	24,360.00	0.04
396	300373	扬杰科技	600	24,342.00	0.04
397	002003	伟星股份	2,600	24,336.00	0.04
398	688550	瑞联新材	613	24,274.80	0.04
399	000880	潍柴重机	2,100	24,255.00	0.04

400	688350	富淼科技	1,422	24,159.78	0.04
401	003030	祖名股份	1,000	24,140.00	0.04
402	300211	亿通科技	2,400	24,120.00	0.04
403	600886	国投电力	1,900	24,035.00	0.04
404	601009	南京银行	3,000	24,000.00	0.04
405	603855	华荣股份	900	23,940.00	0.04
406	603926	铁流股份	2,340	23,938.20	0.04
407	002881	美格智能	700	23,905.00	0.04
408	603659	璞泰来	625	23,887.50	0.04
409	002318	久立特材	1,400	23,842.00	0.04
410	300909	汇创达	900	23,778.00	0.04
411	600475	华光环能	2,000	23,760.00	0.04
412	600489	中金黄金	2,300	23,759.00	0.04
413	605098	行动教育	600	23,754.00	0.04
414	002863	今飞凯达	3,800	23,712.00	0.04
415	300593	新雷能	1,035	23,711.85	0.04
416	603319	湘油泵	1,400	23,702.00	0.04
417	000419	通程控股	4,300	23,607.00	0.04
418	600639	浦东金桥	1,900	23,579.00	0.04
419	603889	新澳股份	3,136	23,551.36	0.04
420	300057	万顺新材	2,800	23,520.00	0.04
421	002728	特一药业	1,540	23,485.00	0.04
422	300541	先进数通	1,800	23,454.00	0.04
423	002311	海大集团	500	23,420.00	0.04
424	300692	中环环保	3,200	23,392.00	0.04
425	300970	华绿生物	1,000	23,360.00	0.04
426	000960	锡业股份	1,500	23,325.00	0.04
427	003032	传智教育	1,600	23,312.00	0.04
428	605006	山东玻纤	3,100	23,250.00	0.04
429	002415	海康威视	700	23,177.00	0.04
430	600976	健民集团	300	23,127.00	0.04

431	605077	华康股份	871	23,064.08	0.04
432	002843	泰嘉股份	1,100	23,056.00	0.04
433	600150	中国船舶	700	23,037.00	0.04
434	603968	醋化股份	1,296	23,016.96	0.04
435	300789	唐源电气	1,115	22,991.30	0.04
436	600295	鄂尔多斯	2,548	22,855.56	0.04
437	600063	皖维高新	4,500	22,725.00	0.04
438	603556	海兴电力	900	22,716.00	0.04
439	000156	华数传媒	2,600	22,620.00	0.04
440	603040	新坐标	850	22,601.50	0.04
441	300515	三德科技	1,400	22,568.00	0.04
442	002286	保龄宝	2,400	22,536.00	0.04
443	301039	中集车辆	1,700	22,491.00	0.04
444	002392	北京利尔	6,200	22,444.00	0.04
445	002036	联创电子	2,300	22,333.00	0.04
446	000906	浙商中拓	2,500	22,300.00	0.04
447	002407	多氟多	1,120	22,243.20	0.04
448	601869	长飞光纤	600	22,206.00	0.04
449	688577	浙海德曼	465	22,124.70	0.04
450	600177	雅戈尔	3,500	22,085.00	0.04
451	002985	北摩高科	500	22,060.00	0.04
452	002182	云海金属	1,000	21,990.00	0.04
453	688367	工大高科	1,242	21,958.56	0.04
454	601615	明阳智能	1,300	21,944.00	0.03
455	688181	八亿时空	778	21,931.82	0.03
456	600761	安徽合力	1,100	21,923.00	0.03
457	000629	钒钛股份	5,600	21,896.00	0.03
458	600985	淮北矿业	1,900	21,888.00	0.03
459	300833	浩洋股份	200	21,886.00	0.03
460	603600	永艺股份	2,300	21,873.00	0.03
461	601908	京运通	3,600	21,780.00	0.03

462	300845	捷安高科	1,000	21,730.00	0.03
463	003020	立方制药	586	21,687.86	0.03
464	002039	黔源电力	1,540	21,667.80	0.03
465	300035	中科电气	1,800	21,636.00	0.03
466	688513	苑东生物	394	21,614.84	0.03
467	002275	桂林三金	1,200	21,612.00	0.03
468	002262	恩华药业	700	21,581.00	0.03
469	002801	微光股份	796	21,539.76	0.03
470	600426	华鲁恒升	700	21,441.00	0.03
471	603681	永冠新材	1,500	21,420.00	0.03
472	003000	劲仔食品	1,700	21,403.00	0.03
473	300661	圣邦股份	260	21,353.80	0.03
474	300835	龙磁科技	680	21,338.40	0.03
475	002949	华阳国际	1,500	21,330.00	0.03
476	002484	江海股份	1,000	21,290.00	0.03
477	300316	晶盛机电	300	21,270.00	0.03
478	300719	安达维尔	1,500	21,180.00	0.03
479	603096	新经典	1,040	21,174.40	0.03
480	600073	上海梅林	2,900	21,170.00	0.03
481	688499	利元亨	333	21,152.16	0.03
482	003033	征和工业	600	21,060.00	0.03
483	603689	皖天然气	2,400	21,048.00	0.03
484	300407	凯发电气	2,300	20,999.00	0.03
485	002466	天齐锂业	300	20,973.00	0.03
486	002788	鹭燕医药	2,200	20,966.00	0.03
487	601231	环旭电子	1,400	20,944.00	0.03
488	002661	克明食品	1,900	20,919.00	0.03
489	603043	广州酒家	740	20,912.40	0.03
490	600167	联美控股	3,000	20,910.00	0.03
491	300358	楚天科技	1,400	20,902.00	0.03
492	000833	粤桂股份	3,200	20,896.00	0.03

493	002655	共达电声	1,600	20,784.00	0.03
494	688260	昀冢科技	1,129	20,751.02	0.03
495	603301	振德医疗	700	20,734.00	0.03
496	300916	朗特智能	600	20,694.00	0.03
497	603386	骏亚科技	1,820	20,657.00	0.03
498	002258	利尔化学	1,600	20,656.00	0.03
499	000521	长虹美菱	2,700	20,628.00	0.03
500	002797	第一创业	3,600	20,592.00	0.03
501	600438	通威股份	600	20,586.00	0.03
502	300378	鼎捷软件	600	20,550.00	0.03
503	002049	紫光国微	220	20,515.00	0.03
504	688586	江航装备	1,474	20,503.34	0.03
505	600096	云天化	1,200	20,484.00	0.03
506	000778	新兴铸管	5,000	20,400.00	0.03
507	300666	江丰电子	300	20,388.00	0.03
508	300786	国林科技	1,080	20,293.20	0.03
509	003004	声迅股份	700	20,209.00	0.03
510	002961	瑞达期货	1,400	20,174.00	0.03
511	600497	驰宏锌锗	4,000	20,080.00	0.03
512	601012	隆基绿能	700	20,069.00	0.03
513	600236	桂冠电力	3,600	20,052.00	0.03
514	300621	维业股份	2,000	20,020.00	0.03
515	601225	陕西煤业	1,100	20,009.00	0.03
516	002315	焦点科技	500	20,000.00	0.03
517	000541	佛山照明	3,500	19,985.00	0.03
518	002738	中矿资源	392	19,968.48	0.03
519	002158	汉钟精机	800	19,968.00	0.03
520	002702	海欣食品	3,800	19,950.00	0.03
521	600219	南山铝业	6,600	19,932.00	0.03
522	600256	广汇能源	2,900	19,894.00	0.03
523	600328	中盐化工	2,210	19,890.00	0.03

523	000878	云南铜业	1,800	19,890.00	0.03
525	002332	仙琚制药	1,500	19,875.00	0.03
526	601117	中国化学	2,400	19,872.00	0.03
527	688777	中控技术	316	19,838.48	0.03
528	002206	海利得	3,700	19,832.00	0.03
529	601101	昊华能源	3,400	19,788.00	0.03
530	688087	英科再生	829	19,738.49	0.03
531	603365	水星家纺	1,400	19,684.00	0.03
532	601139	深圳燃气	2,700	19,683.00	0.03
533	002105	信隆健康	3,300	19,635.00	0.03
534	603489	八方股份	280	19,633.60	0.03
535	002842	翔鹭钨业	2,300	19,619.00	0.03
536	688005	容百科技	361	19,501.22	0.03
537	688196	卓越新能	420	19,425.00	0.03
538	600969	郴电国际	2,600	19,422.00	0.03
539	603938	三孚股份	980	19,394.20	0.03
540	688680	海优新材	159	19,369.38	0.03
541	600160	巨化股份	1,400	19,292.00	0.03
542	002812	恩捷股份	200	19,270.00	0.03
543	000567	海德股份	1,494	19,153.08	0.03
544	002913	奥士康	500	19,090.00	0.03
545	603738	泰晶科技	1,148	19,068.28	0.03
546	600116	三峡水利	2,100	19,068.00	0.03
547	601077	渝农商行	5,300	19,027.00	0.03
548	601518	吉林高速	7,980	18,992.40	0.03
549	688558	国盛智科	531	18,988.56	0.03
550	600760	中航沈飞	420	18,900.00	0.03
551	002556	辉隆股份	2,600	18,876.00	0.03
552	603999	读者传媒	2,700	18,873.00	0.03
553	300409	道氏技术	1,500	18,855.00	0.03
554	601166	兴业银行	1,200	18,780.00	0.03

555	600023	浙能电力	3,700	18,759.00	0.03
556	603212	赛伍技术	900	18,729.00	0.03
557	600888	新疆众和	2,360	18,691.20	0.03
558	300401	花园生物	1,600	18,592.00	0.03
559	603871	嘉友国际	1,183	18,584.93	0.03
560	300813	泰林生物	650	18,570.50	0.03
561	601098	中南传媒	1,600	18,560.00	0.03
562	603359	东珠生态	1,800	18,540.00	0.03
563	002073	软控股份	2,800	18,536.00	0.03
564	600809	山西汾酒	100	18,507.00	0.03
565	000625	长安汽车	1,430	18,489.90	0.03
566	600873	梅花生物	2,069	18,476.17	0.03
567	002960	青鸟消防	1,014	18,464.94	0.03
568	002953	日丰股份	1,430	18,461.30	0.03
569	600173	卧龙地产	3,500	18,445.00	0.03
570	600513	联环药业	1,900	18,354.00	0.03
571	688669	聚石化学	1,011	18,329.43	0.03
572	688123	聚辰股份	341	18,318.52	0.03
573	300709	精研科技	740	18,255.80	0.03
574	300628	亿联网络	520	18,236.40	0.03
575	688335	复洁环保	743	18,233.22	0.03
576	601456	国联证券	2,000	18,200.00	0.03
577	300982	苏文电能	300	18,168.00	0.03
578	002384	东山精密	700	18,130.00	0.03
579	002807	江阴银行	4,900	18,081.00	0.03
580	600101	明星电力	1,900	18,069.00	0.03
581	002833	弘亚数控	916	18,008.56	0.03
582	603936	博敏电子	1,500	18,000.00	0.03
583	000989	九芝堂	1,300	17,992.00	0.03
584	600885	宏发股份	560	17,836.00	0.03
585	603713	密尔克卫	200	17,818.00	0.03



586	600348	华阳股份	2,250	17,797.50	0.03
587	002824	和胜股份	600	17,718.00	0.03
588	600508	上海能源	1,200	17,616.00	0.03
589	601609	金田股份	2,700	17,523.00	0.03
590	002132	恒星科技	4,900	17,493.00	0.03
591	600486	扬农化工	200	17,484.00	0.03
592	603901	永创智能	1,200	17,472.00	0.03
593	600305	恒顺醋业	1,600	17,376.00	0.03
594	300196	长海股份	1,250	17,312.50	0.03
595	002340	格林美	2,500	17,275.00	0.03
596	603876	鼎胜新材	900	17,271.00	0.03
597	300129	泰胜风能	1,800	17,262.00	0.03
598	603678	火炬电子	500	17,230.00	0.03
599	688131	皓元医药	301	17,150.98	0.03
600	601838	成都银行	1,400	17,094.00	0.03
601	600621	华鑫股份	1,600	17,008.00	0.03
602	603986	兆易创新	160	17,000.00	0.03
603	601066	中信建投	700	16,940.00	0.03
604	000830	鲁西化工	1,600	16,896.00	0.03
605	002889	东方嘉盛	840	16,816.80	0.03
606	002041	登海种业	1,100	16,797.00	0.03
607	000407	胜利股份	4,600	16,790.00	0.03
608	600481	双良节能	1,200	16,776.00	0.03
609	600377	宁沪高速	1,700	16,711.00	0.03
610	600067	冠城大通	6,300	16,695.00	0.03
611	003019	宸展光电	814	16,687.00	0.03
612	688028	沃尔德	741	16,598.40	0.03
613	603538	美诺华	900	16,578.00	0.03
614	600557	康缘药业	600	16,476.00	0.03
615	688233	神工股份	521	16,453.18	0.03
616	603585	苏利股份	1,100	16,368.00	0.03

617	000519	中兵红箭	900	16,281.00	0.03
618	603599	广信股份	600	16,248.00	0.03
619	688096	京源环保	1,651	16,245.84	0.03
620	603236	移远通信	280	16,158.80	0.03
621	600879	航天电子	1,900	16,131.00	0.03
622	600997	开滦股份	2,700	16,119.00	0.03
623	002549	凯美特气	1,400	16,100.00	0.03
624	002054	德美化工	2,300	16,054.00	0.03
625	002518	科士达	400	16,004.00	0.03
626	002497	雅化集团	900	16,002.00	0.03
627	002878	元隆雅图	900	15,966.00	0.03
628	002880	卫光生物	420	15,834.00	0.03
629	603067	振华股份	1,300	15,795.00	0.03
630	605376	博迁新材	500	15,690.00	0.03
631	601872	招商轮船	2,700	15,633.00	0.02
632	002648	卫星化学	1,040	15,558.40	0.02
633	300721	怡达股份	950	15,466.00	0.02
634	688199	久日新材	518	15,446.76	0.02
635	002120	韵达股份	1,600	15,296.00	0.02
636	688360	德马科技	683	15,155.77	0.02
637	603185	弘元绿能	200	14,910.00	0.02
638	601975	招商南油	5,100	14,586.00	0.02
639	688500	*ST慧辰	843	14,583.90	0.02
640	688004	博汇科技	417	14,582.49	0.02
641	600368	五洲交通	3,960	14,414.40	0.02
642	002001	新和成	932	14,352.80	0.02
643	002946	新乳业	1,000	14,350.00	0.02
644	688078	龙软科技	278	14,330.90	0.02
645	000933	神火股份	1,100	14,300.00	0.02
646	600850	电科数字	600	14,154.00	0.02
647	603392	万泰生物	203	13,554.31	0.02

648	300474	景嘉微	150	13,498.50	0.02
649	300629	新劲刚	650	13,409.50	0.02
650	300953	震裕科技	181	13,327.03	0.02
651	603825	华扬联众	1,000	13,290.00	0.02
652	605398	新炬网络	340	13,246.40	0.02
653	002225	濮耐股份	3,433	12,976.74	0.02
654	601995	中金公司	364	12,929.28	0.02
655	003005	竞业达	420	12,889.80	0.02
656	605168	三人行	145	12,461.30	0.02
657	002129	TCL中环	375	12,450.00	0.02
658	300852	四会富仕	300	12,438.00	0.02
659	603010	万盛股份	1,140	12,391.80	0.02
660	603588	高能环境	1,320	12,368.40	0.02
661	600596	新安股份	1,120	12,241.60	0.02
662	002111	威海广泰	1,280	12,211.20	0.02
663	300997	欢乐家	823	11,991.11	0.02
664	300681	英搏尔	555	11,815.95	0.02
665	300762	上海瀚讯	1,000	11,770.00	0.02
666	300837	浙矿股份	300	11,520.00	0.02
667	600757	长江传媒	1,334	11,472.40	0.02
668	300509	新美星	1,500	11,325.00	0.02
669	300645	正元智慧	400	10,928.00	0.02
670	300597	吉大通信	1,100	10,901.00	0.02
671	300993	玉马遮阳	928	10,625.60	0.02
672	300830	金现代	1,100	10,450.00	0.02
673	000951	中国重汽	620	10,447.00	0.02
674	002876	三利谱	300	9,951.00	0.02
675	300747	锐科激光	325	9,906.00	0.02
676	300785	值得买	375	9,817.50	0.02
677	688330	宏力达	279	9,787.32	0.02
678	000603	盛达资源	800	9,672.00	0.02

679	300604	长川科技	200	9,498.00	0.02
680	300695	兆丰股份	200	9,316.00	0.01
681	300770	新媒股份	200	9,172.00	0.01
682	601019	山东出版	1,000	9,170.00	0.01
683	300806	斯迪克	448	8,386.56	0.01
684	688099	晶晨股份	96	8,094.72	0.01
685	300587	天铁股份	1,046	8,054.20	0.01
686	002028	思源电气	170	7,942.40	0.01
687	600622	光大嘉宝	2,692	7,860.64	0.01
688	600176	中国巨石	489	6,924.24	0.01
689	600692	亚通股份	1,231	6,868.98	0.01
690	603995	甬金股份	285	6,814.35	0.01
691	300625	三雄极光	500	6,250.00	0.01
692	603317	天味食品	420	6,136.20	0.01
693	300363	博腾股份	200	5,918.00	0.01
694	300630	普利制药	300	5,865.00	0.01
695	300482	万孚生物	220	5,858.60	0.01
696	300327	中颖电子	209	5,843.64	0.01
697	300759	康龙化成	150	5,742.00	0.01
698	688314	康拓医疗	150	5,616.00	0.01
699	301010	晶雪节能	272	5,518.88	0.01
700	301007	德迈仕	322	4,968.46	0.01
701	603529	爱玛科技	150	4,833.00	0.01
702	601388	怡球资源	1,500	4,320.00	0.01
703	300995	奇德新材	209	4,263.60	0.01
704	300955	嘉亨家化	200	4,260.00	0.01
705	002557	洽洽食品	100	4,155.00	0.01
706	603985	恒润股份	169	3,543.93	0.01
707	000719	中原传媒	300	3,510.00	0.01
708	300656	民德电子	110	3,425.40	0.01
709	000425	徐工机械	500	3,385.00	0.01

710	603385	惠达卫浴	400	3,012.00	0.00
711	688560	明冠新材	97	2,695.63	0.00
712	600392	盛和资源	200	2,574.00	0.00
713	000553	安道麦A	300	2,532.00	0.00
714	000783	长江证券	400	2,320.00	0.00
715	000968	蓝焰控股	300	2,268.00	0.00
716	000090	天健集团	300	1,512.00	0.00
717	688521	芯原股份	21	1,510.32	0.00
718	002536	飞龙股份	100	1,500.00	0.00
719	300101	振芯科技	76	1,473.64	0.00
720	300711	广哈通信	80	1,196.80	0.00
721	603810	丰山集团	84	1,156.68	0.00
722	300687	赛意信息	40	1,111.20	0.00
723	002184	海得控制	65	1,066.00	0.00
724	603056	德邦股份	69	1,063.98	0.00
725	300638	广和通	40	907.20	0.00
726	000990	诚志股份	100	762.00	0.00
727	002849	威星智能	40	745.60	0.00
728	002777	久远银海	20	709.40	0.00
729	002886	沃特股份	30	608.40	0.00
730	002580	圣阳股份	60	563.40	0.00
731	300737	科顺股份	60	549.60	0.00
732	600731	湖南海利	70	543.90	0.00
733	002763	汇洁股份	60	531.60	0.00
734	603955	大千生态	30	456.00	0.00
735	002498	汉缆股份	100	401.00	0.00
736	002228	合兴包装	100	323.00	0.00
737	688018	乐鑫科技	2	259.64	0.00
738	600390	五矿资本	40	215.20	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	601007	金陵饭店	1,672,579.00	3.61
2	600057	厦门象屿	1,528,586.00	3.30
3	600285	羚锐制药	1,346,496.00	2.91
4	600908	无锡银行	1,265,963.00	2.73
5	603309	维力医疗	1,088,981.00	2.35
6	688138	清溢光电	1,057,413.40	2.28
7	688092	爱科科技	1,045,094.71	2.26
8	600566	济川药业	1,008,594.00	2.18
9	688621	阳光诺和	990,891.78	2.14
10	301026	浩通科技	990,659.00	2.14
11	002461	珠江啤酒	977,451.00	2.11
12	002020	京新药业	974,834.00	2.10
13	000630	铜陵有色	973,917.00	2.10
14	002237	恒邦股份	970,657.00	2.10
15	600926	杭州银行	954,083.00	2.06
16	000027	深圳能源	953,470.20	2.06
17	600642	申能股份	947,296.00	2.05
18	600036	招商银行	890,784.00	1.92
19	605287	德才股份	883,589.00	1.91
20	600489	中金黄金	879,718.00	1.90

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

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

**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	601007	金陵饭店	1,355,393.00	2.93
2	688138	清溢光电	1,230,834.00	2.66
3	600285	羚锐制药	1,187,051.00	2.56
4	002649	博彦科技	1,180,053.00	2.55
5	000550	江铃汽车	1,088,457.00	2.35
6	688589	力合微	1,077,483.50	2.33
7	688621	阳光诺和	1,066,722.58	2.30
8	300532	今天国际	1,049,363.00	2.27
9	603993	洛阳钼业	1,041,882.00	2.25
10	688092	爱科科技	1,023,560.54	2.21
11	002155	湖南黄金	994,003.00	2.15
12	603676	卫信康	982,619.00	2.12
13	603611	诺力股份	966,949.00	2.09
14	600908	无锡银行	958,323.00	2.07
15	002391	长青股份	913,545.00	1.97
16	600489	中金黄金	912,238.00	1.97
17	600057	厦门象屿	912,202.00	1.97
18	300908	仲景食品	910,950.00	1.97
19	600073	上海梅林	895,431.00	1.93
20	301026	浩通科技	891,674.00	1.93

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

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

#### 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	159,145,608.93
卖出股票收入（成交）总额	148,529,791.62

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

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	3,443,483.89	5.49
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,443,483.89	5.49

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019688	22国债23	26,000	2,629,100.77	4.19
2	019679	22国债14	8,000	814,383.12	1.30
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

### 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

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

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**

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**

本基金本报告期末未投资股指期货。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**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中，本期末出现被监管部门立案调查的情形；北京银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

**7.12.2**

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

**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	13,491.81
2	应收清算款	191,207.41
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	119.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	204,819.07

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## §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
东兴兴晟混合A	716	62,278.44	22,984,144.65	51.54%	21,607,219.68	48.46%
东兴兴晟混合C	315	32,586.08	108,186.08	1.05%	10,156,429.08	98.95%
合计	1,031	53,206.58	23,092,330.73	42.10%	31,763,648.76	57.90%

### 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	东兴兴晟混合A	86,986.75	0.20%
	东兴兴晟混合C	0.00	0.00%
	合计	86,986.75	0.16%

### 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	东兴兴晟混合A	0
	东兴兴晟混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基 金	东兴兴晟混合A	0
	东兴兴晟混合C	0
	合计	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

	东兴兴晟混合A	东兴兴晟混合C
基金合同生效日(2020年08月05日)基金份额总额	281,613,922.92	103,380,254.95
本报告期期初基金份额总额	35,442,223.70	7,569,067.01
本报告期基金总申购份额	12,811,458.88	5,635,986.51
减：本报告期基金总赎回份额	3,662,318.25	2,940,438.36
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	44,591,364.33	10,264,615.16

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 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

本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动：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

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未更换会计师事务所。

### 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

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人未受到对本行经营管理有重大影响的行政处罚。基金托管人高级管理人员无受处罚情况。

## 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	
广发证券股份有限公司	1	130,537,036.76	42.43%	95,463.93	42.76%	-
兴业证券股份有限公司	1	177,138,363.79	57.57%	127,769.37	57.24%	-
长江证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

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

#### 2、交易单元的选择标准和程序

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

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

#### 3、本基金本报告期内未新增交易单元。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	3,392,107.00	100.00%	190,900,000.00	100.00%	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-

## 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	东兴兴晟混合型证券投资基金2022年第4季度报告	指定报刊、指定网站	2023-01-20
2	关于增加中证金牛（北京）基金销售有限公司为东兴基金管理有限公司公开募集证券投资基金的销售机构的公告	指定报刊、指定网站	2023-01-30
3	关于增加浙江同花顺基金销售有限公司为东兴基金管理有限公司公开募集证券投资基金的销售机构的公告	指定报刊、指定网站	2023-03-15
4	东兴兴晟混合型证券投资基金2022年年度报告	指定报刊、指定网站	2023-03-31
5	东兴兴晟混合型证券投资基金2023年第1季度报告	指定报刊、指定网站	2023-04-21
6	东兴兴晟混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	指定报刊、指定网站	2023-05-24
7	东兴兴晟混合型证券投资基金基金招募说明书（更新）（2023年第1号）	指定报刊、指定网站	2023-05-24
8	关于增加麦高证券有限责任公司为东兴基金管理有限公司公开募集证券投资基金的销售机构的公告	指定报刊、指定网站	2023-05-25

## §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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2023 年 1 月 1 日 - 2023 年 6 月 30 日	14,606,096.02	-	-	14,606,096.02	26.63%

#### 产品特有风险

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

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

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

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 存放地点

北京市西城区平安里西大街28号中海国际中心6层

### 12.3 查阅方式

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

东兴基金管理有限公司  
二〇二三年八月三十一日