

东兴宸祥量化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:长江证券股份有限公司

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。

基金托管人长江证券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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	14
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	66
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	74
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	74
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	75
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	75
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	75
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	75
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	75
7.12 投资组合报告附注	75
§8 基金份额持有人信息	76
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	76
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	76

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	77
§9 开放式基金份额变动	77
§10 重大事件揭示	77
10.1 基金份额持有人大会决议	77
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	77
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	77
10.4 基金投资策略的改变	78
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	78
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	78
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	78
10.8 其他重大事件	79
§11 影响投资者决策的其他重要信息	79
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	80
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	80
§12 备查文件目录	80
12.1 备查文件目录	80
12.2 存放地点	81
12.3 查阅方式	81

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东兴宸祥量化混合型证券投资基金	
基金简称	东兴宸祥量化混合	
基金主代码	013166	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022年01月28日	
基金管理人	东兴基金管理有限公司	
基金托管人	长江证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	207,197,079.79份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	东兴宸祥量化混合A	东兴宸祥量化混合C
下属分级基金的交易代码	013166	013167
报告期末下属分级基金的份额总额	187,778,153.04份	19,418,926.75份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制,力争实现达到或超越业绩比较基准的投资收益,谋求基金资产的长期增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金基于定量与定性相结合的方式跟踪国内外宏观经济数据及政策变化,密切关注市场流动性变化情况,动态评估不同资产的估值水平变化,合理确定组合中权益资产、债券资产及货币市场工具及其他金融工具的投资比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>(1) 多因子投资体系。因子涵盖估值、盈利、成长、财务质量、趋势、量价关系等,在底层大数据的基础上,通过多种形式计算形成不同种类的选股因子对每只股票进行打分形成股票组合。</p> <p>(2) 机器学习辅助投资体系。通过机器学习技术发现因子和收益之间潜在的隐含关系(如非线性关系),实现对因子进行动态预测,从而提供更强的投资信号。</p> <p>(3) 行业优化体系。在组合构建过程中,通过市场面、行业相对估值、资金流变动等一系列指标动态进行二级行业的小幅调整,将部分</p>

	可能出现负贡献的行业配置进行一定程度降低。 (4) 风险控制体系。在业绩比较基准--中证500指数的基础上, 通过量化策略提升收益水平, 控制股票组合与业绩比较基准的超额收益回撤风险。 3、债券投资策略; 4、资产支持证券投资策略; 5、股指期货投资策略; 6、股票期权投资策略; 7、可转换债券投资策略; 8、可交换债券投资策略; 9、国债期货投资策略
业绩比较基准	中证500指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金, 其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金, 但低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.dxamc.cn
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)	
	东兴宸祥量化混合A	东兴宸祥量化混合C
本期已实现收益	1,460,344.15	331,473.93
本期利润	2,806,703.11	1,071,504.15
加权平均基金份额本期利润	0.0320	0.0834
本期加权平均净值利润率	3.00%	7.82%
本期基金份额净值增长率	8.53%	8.47%
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	13,511,244.48	1,364,489.91
期末可供分配基金份额利润	0.0720	0.0703
期末基金资产净值	201,289,397.52	20,783,416.66
期末基金份额净值	1.0720	1.0703
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	7.20%	7.03%

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

东兴宸祥量化混合A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.08%	0.90%	-0.60%	0.74%	1.68%	0.16%
过去三个月	-1.72%	0.79%	-4.12%	0.66%	2.40%	0.13%
过去六个月	8.53%	0.78%	2.14%	0.63%	6.39%	0.15%
过去一年	0.95%	0.99%	-5.26%	0.77%	6.21%	0.22%
自基金合同生效起至今	7.20%	1.04%	-6.84%	0.97%	14.04%	0.07%

东兴宸祥量化混合C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.08%	0.90%	-0.60%	0.74%	1.68%	0.16%
过去三个月	-1.74%	0.79%	-4.12%	0.66%	2.38%	0.13%
过去六个月	8.47%	0.78%	2.14%	0.63%	6.33%	0.15%
过去一年	0.95%	0.99%	-5.26%	0.77%	6.21%	0.22%
自基金合同生效起至今	7.03%	1.04%	-6.84%	0.97%	13.87%	0.07%

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

东兴宸祥量化混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



东兴宸祥量化混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



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

§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		
李兵伟先生	本基金基金经理	2022-01-28	-	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《东兴宸祥量化混合型证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

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8.53%，业绩比较基准收益率为2.14%，高于业绩比较基准6.39%；本基金C类份额净值增长率为8.47%，业绩比较基准收益率为2.14%，高于业绩比较基准6.33%。

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

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

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

5.3 托管人对本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宸祥量化混合型证券投资基金中期报告的财务指标、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进行了核查，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：东兴宸祥量化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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,493,917.41	331,459.94
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	221,367,709.39	46,349,792.36
其中：股票投资		209,724,497.34	43,651,302.76
基金投资		-	-
债券投资		11,643,212.05	2,698,489.60

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	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		58,736.78	1,298.89
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		222,920,363.58	46,682,551.19
负债和净资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		39,054.60	-
应付赎回款		476,626.42	29,152.78
应付管理人报酬		256,024.44	61,022.18
应付托管费		17,068.30	4,068.16
应付销售服务费		2,137.76	711.57
应付投资顾问费		-	-

应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	56,637.88	89,000.00
负债合计		847,549.40	183,954.69
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	207,197,079.79	47,086,103.06
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	14,875,734.39	-587,506.56
净资产合计		222,072,814.18	46,498,596.50
负债和净资产总计		222,920,363.58	46,682,551.19

注：报告截止日2023年6月30日，东兴宸祥混合A基金份额净值1.0720元，基金份额总额187,778,153.04份，东兴宸祥混合C基金份额净值1.0703元，基金份额总额19,418,926.75份。

6.2 利润表

会计主体：东兴宸祥量化混合型证券投资基金

本报告期：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28日（基金 合同生效日）至2022 年06月30日
一、营业总收入		4,784,775.22	4,097,026.81
1.利息收入		5,417.67	284,456.68
其中：存款利息收入	6.4.7.9	4,917.27	199,944.17
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		500.40	84,512.51
证券出借利息收入		-	-

其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,482,503.57	686,056.24
其中：股票投资收益	6.4.7.10	374,821.96	-21,431.40
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	42,975.94	36,453.13
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	2,064,705.67	671,034.51
以摊余成本计量的 金融资产终止确认 产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.16	2,086,389.18	2,971,719.91
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	210,464.80	154,793.98
减：二、营业总支出		906,567.96	755,361.79
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	789,958.12	651,013.51
2. 托管费	6.4.10.2.2	52,663.86	43,400.91
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	6,654.12	19,693.37
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	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		1.80	304.26
8. 其他费用	6.4.7.19	57,290.06	40,949.74

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,878,207.26	3,341,665.02
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,878,207.26	3,341,665.02
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3,878,207.26	3,341,665.02

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：东兴宸祥量化混合型证券投资基金

本报告期：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）	47,086,103.06	-	-587,506.56	46,498,596.50
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）	47,086,103.06	-	-587,506.56	46,498,596.50
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	160,110,976.73	-	15,463,240.95	175,574,217.68
（一）、综合收益总额	-	-	3,878,207.26	3,878,207.26
（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）	160,110,976.73	-	11,585,033.69	171,696,010.42
其中：1.基金申购款	207,072,239.67	-	14,759,218.19	221,831,457.86
2.基金赎回款	-46,961,262.94	-	-3,174,184.50	-50,135,447.44
（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）	207,197,079.79	-	14,875,734.39	222,072,814.18
项目	上年度可比期间 2022年01月28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）	232,895,020.01	-	-	232,895,020.01
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-181,558,912.22	-	3,169,890.67	-178,389,021.55
（一）、综合收益总额	-	-	3,341,665.02	3,341,665.02
（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）	-181,558,912.22	-	-171,774.35	-181,730,686.57
其中：1.基金申购款	1,694,943.53	-	21,942.60	1,716,886.13
2.基金赎回款	-183,253,855.75	-	-193,716.95	-183,447,572.70
（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）	51,336,107.79	-	3,169,890.67	54,505,998.46

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

东兴宸祥量化混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据2021年5月27日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予东兴宸祥量化混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2021]1832号）的批复，自2021年11月26日至2022年1月25

日公开募集设立。本基金为混合型证券投资基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集232,847,454.05元人民币，经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）"普华永道中天验字(2022)第0065号"验资报告验证。经向中国证监会备案，《东兴宸祥量化混合型证券投资基金基金合同》于2021年1月28日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为232,895,020.01份，其中认购资金利息折合47,565.96份。本基金基金管理人为东兴基金管理有限公司，基金托管人长江证券股份有限公司。

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

基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的60%-95%，每个交易日日终在扣除国债期货合约、股票期权合约、股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

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和对应投资品种产生的交易费用后的差额确认。

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

(3) 公允价值变动损益

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

(4) 其他收入

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

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1.50%的年费率逐日计提；

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

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

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

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，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，暂免予缴纳印花税、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	163,065.14
等于：本金	162,993.43
加：应计利息	71.71
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	1,330,852.27
等于：本金	1,330,732.45
加：应计利息	119.82
减：坏账准备	-
合计	1,493,917.41

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券资金账户的证券交易结算资金。

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	209,271,886.63	-	209,724,497.34	452,610.71	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	11,491,730.36	135,842.05	11,643,212.05	15,639.64
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	11,491,730.36	135,842.05	11,643,212.05	15,639.64
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	220,763,616.99	135,842.05	221,367,709.39	468,250.35	

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

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	147.82
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	56,490.06
合计	56,637.88

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 东兴宸祥量化混合A

金额单位：人民币元

项目 (东兴宸祥量化混合A)	本期 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	38,884,499.38	38,884,499.38

本期申购	159,208,006.50	159,208,006.50
本期赎回（以“-”号填列）	-10,314,352.84	-10,314,352.84
本期末	187,778,153.04	187,778,153.04

6.4.7.7.2 东兴宸祥量化混合C

金额单位：人民币元

项目 (东兴宸祥量化混合C)	本期 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	8,201,603.68	8,201,603.68
本期申购	47,864,233.17	47,864,233.17
本期赎回（以“-”号填列）	-36,646,910.10	-36,646,910.10
本期末	19,418,926.75	19,418,926.75

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 东兴宸祥量化混合A

单位：人民币元

项目 (东兴宸祥量化混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,731,989.78	-2,210,017.82	-478,028.04
本期利润	1,460,344.15	1,346,358.96	2,806,703.11
本期基金份额交易产生的变动数	12,210,365.49	-1,027,796.08	11,182,569.41
其中：基金申购款	13,012,646.31	-1,125,418.38	11,887,227.93
基金赎回款	-802,280.82	97,622.30	-704,658.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,402,699.42	-1,891,454.94	13,511,244.48

6.4.7.8.2 东兴宸祥量化混合C

单位：人民币元

项目 (东兴宸祥量化混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
-------------------	-------	-------	---------

上年度末	356,289.40	-465,767.92	-109,478.52
本期利润	331,473.93	740,030.22	1,071,504.15
本期基金份额交易产生的变动数	872,337.58	-469,873.30	402,464.28
其中：基金申购款	3,712,550.93	-840,560.67	2,871,990.26
基金赎回款	-2,840,213.35	370,687.37	-2,469,525.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,560,100.91	-195,611.00	1,364,489.91

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	1,819.33
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	3,097.94
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	4,917.27

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

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	178,349,965.71
减：卖出股票成本总额	177,366,472.81
减：交易费用	608,670.94
买卖股票差价收入	374,821.96

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	49,833.63
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入	-6,857.69
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	42,975.94

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	3,307,643.36
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,252,169.17
减：应计利息总额	59,773.36
减：交易费用	2,558.52
买卖债券差价收入	-6,857.69

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	2,064,705.67
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	2,064,705.67

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
1.交易性金融资产	2,086,389.18
——股票投资	2,066,534.11
——债券投资	19,855.07
——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	2,086,389.18

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	210,464.80
合计	210,464.80

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	47,069.01
证券出借违约金	-
汇划手续费	800.00
合计	57,290.06

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

根据相关法律法规和本基金基金合同要求，经与本基金托管行协商一致，并报中国证监会备案，本基金管理人决定自2023年7月24日起，将本基金管理费率从1.50%/年下调至1.20%/年。

截至本基金报告报出日，本基金不存在其他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
长江证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
大连银行股份有限公司	与基金管理人同一实际控制人的关联方、基金销售机

	构
--	---

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28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	789,958.12	651,013.51
其中：支付销售机构的客户维护费	253,295.79	238,472.56

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

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

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

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28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	52,663.86	43,400.91

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

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

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

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		
	东兴宸祥量化混合A	东兴宸祥量化混合C	合计
东兴基金管理有限公司	0.00	245.49	245.49
长江证券股份有限公司	0.00	0.00	0.00
大连银行股份有限公司	0.00	14.13	14.13
东兴证券股份有限公司	0.00	2,166.04	2,166.04
合计	0.00	2,425.66	2,425.66
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28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		
	东兴宸祥量化混合A	东兴宸祥量化混合C	合计
东兴基金管理有限公司	0.00	5,258.97	5,258.97
长江证券股份有限公司	0.00	929.60	929.60
大连银行股份有限公司	0.00	0.00	0.00
东兴证券股份有限公司	0.00	11,156.34	11,156.34
合计	0.00	17,344.91	17,344.91

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0.10%的年费率计提。C类基金份额销售服务费的计算方法如下：

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

H为C类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E为前一日的C类基金份额基金资产净值

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

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

东兴宸祥量化混合A

份额单位：份

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28日（基金 合同生效日）至2022年 06月30日
基金合同生效日（2022年01月28日）持有的基金份额	0.00	14,999,000.00
报告期初持有的基金份额	14,999,000.00	0.00
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	0.00
报告期末持有的基金份额	14,999,000.00	14,999,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	7.99%	37.56%

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度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

本报告期末及上期报告期末，本基金无由关联方保管的银行存款；本报告期及上年度可比期间本基金无当期产生的利息收入。

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

本基金本报告期末及上年度末持有的债券均为国债，未包含在按短期信用评级列示的债券投资中。

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

本基金本报告期末及上年度末持有的债券均为国债，未包含在按长期信用评级列示的债券投资中。

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。

6.4.13.1 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	1,493,725.88	-	-	-	-	191.53	1,493,917.41
交易性金融资产	2,199,780.00	-	9,307,590.00	-	-	209,860,339.39	221,367,709.39
应收申购款	-	-	-	-	-	58,736.78	58,736.78
资产总计	3,693,505.88	-	9,307,590.00	-	-	209,919,267.70	222,920,363.58
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	476,626.42	476,626.42
应付清算款	-	-	-	-	-	39,054.60	39,054.60
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	256,024.44	256,024.44
应付托管费	-	-	-	-	-	17,068.30	17,068.30
应付销售服务费	-	-	-	-	-	2,137.76	2,137.76
其他负债	-	-	-	-	-	56,637.88	56,637.88
负债总计	-	-	-	-	-	847,549.40	847,549.40
利率敏感度缺口	3,693,505.88	-	9,307,590.00	-	-	209,071,718.30	222,072,814.18
上年度末 2022年12月31日							
资产							
银行存款	331,427.60	-	-	-	-	32.34	331,459.94
交易性金融资产	2,318,768.10	131,052.40	197,748.60	-	-	43,702,223.26	46,349,792.36
应收申购款	-	-	-	-	-	1,298.89	1,298.89
资产总计	2,650,195.70	131,052.40	197,748.60	-	-	43,703,554.49	46,682,551.19
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	29,152.78	29,152.78
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	61,022.18	61,022.18
应付托管费	-	-	-	-	-	4,068.16	4,068.16
应付销售服务费	-	-	-	-	-	711.57	711.57
其他负债	-	-	-	-	-	89,000.00	89,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	183,954.69	183,954.69
利率敏感度缺口	2,650,195.70	131,052.40	197,748.60	-	-	43,519,599.80	46,498,596.50

注：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	-10,309.31	-408.40
	2、市场利率下降25个基点	10,332.13	408.70

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	209,724,497.34	94.44	43,651,302.76	93.88
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	11,643,212.05	5.24	2,698,489.60	5.80
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-

衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	221,367,709.39	99.68	46,349,792.36	99.68

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%	12,550,320.15	2,857,651.37
	业绩比较基准变动-5%	-12,550,320.15	-2,857,651.37

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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	209,724,497.34	43,651,302.76
第二层次	11,643,212.05	2,698,489.60
第三层次	-	-
合计	221,367,709.39	46,349,792.36

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本报告期内不存在持有的金融工具公允价值所属层次间发生重大变动的情况。

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	209,724,497.34	94.08
	其中：股票	209,724,497.34	94.08
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	11,643,212.05	5.22
	其中：债券	11,643,212.05	5.22
	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	1,493,917.41	0.67
8	其他各项资产	58,736.78	0.03
9	合计	222,920,363.58	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	928,490.00	0.42
B	采矿业	4,276,996.69	1.93
C	制造业	137,806,481.17	62.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,535,519.48	3.39
E	建筑业	4,059,047.50	1.83
F	批发和零售业	5,413,603.61	2.44
G	交通运输、仓储和邮政业	3,963,761.33	1.78
H	住宿和餐饮业	2,148,744.00	0.97
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,994,802.88	8.10
J	金融业	15,528,046.70	6.99
K	房地产业	1,741,497.00	0.78
L	租赁和商务服务业	3,294,521.40	1.48
M	科学研究和技术服务业	2,289,374.92	1.03
N	水利、环境和公共设施管理业	254,578.66	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	104,022.00	0.05
Q	卫生和社会工作	207,525.00	0.09
R	文化、体育和娱乐业	2,177,485.00	0.98
S	综合	-	-
	合计	209,724,497.34	94.44

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	600642	申能股份	359,700	2,514,303.00	1.13
2	600926	杭州银行	206,200	2,422,850.00	1.09

3	002929	润建股份	52,800	2,292,048.00	1.03
4	605088	冠盛股份	129,300	2,217,495.00	1.00
5	600582	天地科技	372,700	2,172,841.00	0.98
6	601007	金陵饭店	252,200	2,148,744.00	0.97
7	000630	铜陵有色	733,800	2,120,682.00	0.95
8	002605	姚记科技	43,300	2,010,419.00	0.91
9	601211	国泰君安	137,100	1,918,029.00	0.86
10	688599	天合光能	44,598	1,900,320.78	0.86
11	603657	春光科技	106,600	1,870,830.00	0.84
12	000027	深圳能源	281,700	1,856,403.00	0.84
13	000682	东方电子	189,500	1,841,940.00	0.83
14	300636	同和药业	148,250	1,817,545.00	0.82
15	300791	仙乐健康	62,100	1,803,384.00	0.81
16	002737	葵花药业	73,900	1,798,726.00	0.81
17	603878	武进不锈	209,720	1,772,134.00	0.80
18	600057	厦门象屿	203,400	1,769,580.00	0.80
19	300181	佐力药业	142,900	1,744,809.00	0.79
20	300900	广联航空	60,000	1,728,600.00	0.78
21	688589	力合微	42,360	1,725,746.40	0.78
22	002649	博彦科技	120,200	1,698,426.00	0.76
23	002947	恒铭达	81,240	1,693,041.60	0.76
24	002829	星网宇达	38,400	1,686,912.00	0.76
25	603158	腾龙股份	219,620	1,682,289.20	0.76
26	603799	华友钴业	36,390	1,670,664.90	0.75
27	600745	闻泰科技	33,400	1,633,260.00	0.74
28	300452	山河药辅	92,000	1,604,480.00	0.72
29	002025	航天电器	25,100	1,601,380.00	0.72
30	600999	招商证券	117,200	1,590,404.00	0.72
31	600060	海信视像	63,400	1,569,150.00	0.71
32	688063	派能科技	7,869	1,560,029.25	0.70
33	002885	京泉华	71,260	1,556,318.40	0.70

34	603228	景旺电子	58,900	1,510,785.00	0.68
35	600362	江西铜业	78,600	1,491,828.00	0.67
36	000739	普洛药业	83,200	1,475,968.00	0.66
37	688217	睿昂基因	36,218	1,454,152.70	0.65
38	600285	羚锐制药	89,200	1,432,552.00	0.65
39	603300	华铁应急	257,436	1,403,026.20	0.63
40	688621	阳光诺和	23,180	1,363,447.60	0.61
41	603118	共进股份	102,300	1,359,567.00	0.61
42	605266	健之佳	16,210	1,358,884.30	0.61
43	002732	燕塘乳业	61,600	1,331,792.00	0.60
44	601688	华泰证券	96,300	1,326,051.00	0.60
45	002815	崇达技术	106,400	1,324,680.00	0.60
46	603309	维力医疗	85,500	1,322,685.00	0.60
47	605166	聚合顺	141,200	1,315,984.00	0.59
48	600548	深高速	145,400	1,305,692.00	0.59
49	300515	三德科技	80,900	1,304,108.00	0.59
50	300925	法本信息	92,200	1,302,786.00	0.59
51	601618	中国中冶	327,300	1,299,381.00	0.59
52	688226	威腾电气	59,236	1,292,529.52	0.58
53	301026	浩通科技	35,700	1,275,204.00	0.57
54	600875	东方电气	67,700	1,262,605.00	0.57
55	300796	贝斯美	102,900	1,237,887.00	0.56
56	603368	柳药集团	49,400	1,220,674.00	0.55
57	003043	华亚智能	21,400	1,208,458.00	0.54
58	688239	航宇科技	17,248	1,206,497.60	0.54
59	688663	新风光	37,758	1,200,326.82	0.54
60	601098	中南传媒	101,500	1,177,400.00	0.53
61	002237	恒邦股份	107,300	1,168,497.00	0.53
62	300750	宁德时代	4,960	1,134,798.40	0.51
63	300674	宇信科技	63,400	1,120,912.00	0.50
64	002768	国恩股份	45,700	1,105,483.00	0.50

65	601169	北京银行	237,100	1,097,773.00	0.49
66	603611	诺力股份	40,500	1,066,770.00	0.48
67	603883	老百姓	35,600	1,062,660.00	0.48
68	000534	万泽股份	62,500	1,048,125.00	0.47
69	603093	南华期货	94,600	1,030,194.00	0.46
70	600012	皖通高速	97,900	1,025,992.00	0.46
71	605287	德才股份	42,900	1,016,730.00	0.46
72	002130	沃尔核材	125,200	1,016,624.00	0.46
73	688517	金冠电气	44,707	981,765.72	0.44
74	003002	壶化股份	61,600	974,512.00	0.44
75	002381	双箭股份	125,100	965,772.00	0.43
76	603220	中贝通信	55,100	939,455.00	0.42
77	600600	青岛啤酒	9,000	932,670.00	0.42
78	688092	爱科科技	31,130	929,853.10	0.42
79	605218	伟时电子	59,800	926,900.00	0.42
80	002155	湖南黄金	74,800	912,560.00	0.41
81	000728	国元证券	139,700	910,844.00	0.41
82	002179	中航光电	19,868	901,013.80	0.41
83	603676	卫信康	64,100	885,862.00	0.40
84	300908	仲景食品	19,000	861,650.00	0.39
85	605123	派克新材	7,900	858,335.00	0.39
86	601600	中国铝业	155,000	850,950.00	0.38
87	603508	思维列控	48,500	826,925.00	0.37
88	300726	宏达电子	18,300	818,376.00	0.37
89	601898	中煤能源	94,600	798,424.00	0.36
90	000417	合肥百货	165,400	774,072.00	0.35
91	002461	珠江啤酒	87,600	771,756.00	0.35
92	002422	科伦药业	25,900	768,712.00	0.35
93	688682	霍莱沃	9,038	756,842.12	0.34
94	002020	京新药业	58,700	752,534.00	0.34
95	300884	狄耐克	55,900	740,116.00	0.33

96	300450	先导智能	20,300	734,251.00	0.33
97	600583	海油工程	124,300	727,155.00	0.33
98	605090	九丰能源	32,300	721,259.00	0.32
99	300705	九典制药	27,220	719,424.60	0.32
100	600886	国投电力	56,600	715,990.00	0.32
101	600967	内蒙一机	70,300	710,030.00	0.32
102	603506	南都物业	59,900	708,617.00	0.32
103	605177	东亚药业	28,600	704,704.00	0.32
104	002443	金洲管道	105,800	704,628.00	0.32
105	002772	众兴菌业	61,400	693,820.00	0.31
106	002249	大洋电机	120,300	685,710.00	0.31
107	002782	可立克	44,300	677,347.00	0.31
108	002396	星网锐捷	29,700	670,923.00	0.30
109	300642	透景生命	32,900	663,593.00	0.30
110	688819	天能股份	17,857	657,851.88	0.30
111	002335	科华数据	17,900	643,505.00	0.29
112	300389	艾比森	31,300	637,581.00	0.29
113	300532	今天国际	30,400	625,024.00	0.28
114	600633	浙数文化	38,000	615,980.00	0.28
115	601658	邮储银行	124,800	610,272.00	0.27
116	603369	今世缘	11,500	607,200.00	0.27
117	688329	艾隆科技	18,523	600,145.20	0.27
118	300438	鹏辉能源	12,300	590,892.00	0.27
119	603896	寿仙谷	13,300	589,190.00	0.27
120	002276	万马股份	48,300	584,913.00	0.26
121	600459	贵研铂业	37,680	576,504.00	0.26
122	688687	凯因科技	19,528	576,076.00	0.26
123	600066	宇通客车	38,200	563,068.00	0.25
124	002429	兆驰股份	100,600	553,300.00	0.25
125	603198	迎驾贡酒	8,400	535,920.00	0.24
126	600039	四川路桥	54,420	533,860.20	0.24

127	605398	新炬网络	13,560	528,297.60	0.24
128	300504	天邑股份	25,700	515,799.00	0.23
129	601229	上海银行	89,500	514,625.00	0.23
130	601390	中国中铁	67,800	513,924.00	0.23
131	002752	昇兴股份	104,200	494,950.00	0.22
132	002899	英派斯	32,700	489,519.00	0.22
133	300232	洲明科技	53,500	488,990.00	0.22
134	000001	平安银行	43,200	485,136.00	0.22
135	688037	芯源微	2,822	482,420.90	0.22
136	600566	济川药业	16,600	482,064.00	0.22
137	000869	张裕 A	15,500	475,230.00	0.21
138	002409	雅克科技	6,200	451,856.00	0.20
139	688138	清溢光电	21,291	449,453.01	0.20
140	601818	光大银行	144,700	444,229.00	0.20
141	002594	比亚迪	1,700	439,059.00	0.20
142	601318	中国平安	9,300	431,520.00	0.19
143	002423	中粮资本	53,900	431,200.00	0.19
144	600908	无锡银行	80,300	430,408.00	0.19
145	002843	泰嘉股份	19,700	412,912.00	0.19
146	600795	国电电力	104,700	401,001.00	0.18
147	002991	甘源食品	5,200	398,840.00	0.18
148	002056	横店东磁	21,900	398,799.00	0.18
149	603444	吉比特	800	392,888.00	0.18
150	603527	众源新材	31,700	387,374.00	0.17
151	300481	濮阳惠成	18,600	382,416.00	0.17
152	601717	郑煤机	30,700	382,215.00	0.17
153	300319	麦捷科技	44,300	379,208.00	0.17
154	603919	金徽酒	15,800	370,984.00	0.17
155	600007	中国国贸	20,000	370,400.00	0.17
156	002391	长青股份	53,400	366,858.00	0.17
157	600741	华域汽车	18,800	347,048.00	0.16

158	000596	古井贡酒	1,400	346,332.00	0.16
159	300696	爱乐达	14,020	344,892.00	0.16
160	603639	海利尔	19,100	342,272.00	0.15
161	600985	淮北矿业	28,400	327,168.00	0.15
162	000733	振华科技	3,400	325,890.00	0.15
163	300136	信维通信	16,200	325,296.00	0.15
164	600765	中航重机	12,060	319,710.60	0.14
165	688005	容百科技	5,780	312,235.60	0.14
166	601012	隆基绿能	10,700	306,769.00	0.14
167	600820	隧道股份	50,700	304,707.00	0.14
168	002993	奥海科技	8,900	301,888.00	0.14
169	300723	一品红	10,250	300,325.00	0.14
170	603630	拉芳家化	18,700	298,639.00	0.13
171	001205	盛航股份	14,000	297,080.00	0.13
172	600489	中金黄金	28,500	294,405.00	0.13
173	603059	倍加洁	12,700	288,798.00	0.13
174	600223	福瑞达	27,400	281,124.00	0.13
175	603259	药明康德	4,500	280,395.00	0.13
176	000878	云南铜业	24,700	272,935.00	0.12
177	688335	复洁环保	11,080	271,903.20	0.12
178	603689	皖天然气	30,500	267,485.00	0.12
179	600109	国金证券	30,800	267,036.00	0.12
180	601965	中国汽研	12,900	266,385.00	0.12
181	002459	晶澳科技	6,268	261,375.60	0.12
182	002065	东华软件	36,900	260,514.00	0.12
183	603659	璞泰来	6,705	256,265.10	0.12
184	600150	中国船舶	7,700	253,407.00	0.11
185	600760	中航沈飞	5,600	252,000.00	0.11
186	600784	鲁银投资	34,800	251,952.00	0.11
187	603579	荣泰健康	12,000	251,040.00	0.11
188	600036	招商银行	7,600	248,976.00	0.11

189	688611	杭州柯林	5,644	241,845.40	0.11
190	300121	阳谷华泰	24,700	235,885.00	0.11
191	002643	万润股份	13,400	233,294.00	0.11
192	601006	大秦铁路	31,200	231,816.00	0.10
193	002560	通达股份	24,200	230,384.00	0.10
194	600756	浪潮软件	13,800	229,356.00	0.10
195	605222	起帆电缆	11,100	229,326.00	0.10
196	600435	北方导航	19,900	228,651.00	0.10
197	003033	征和工业	6,510	228,501.00	0.10
198	603600	永艺股份	23,900	227,289.00	0.10
199	603690	至纯科技	6,520	227,156.80	0.10
200	688166	博瑞医药	10,325	227,046.75	0.10
201	600098	广州发展	36,700	226,806.00	0.10
202	603233	大参林	8,040	225,200.40	0.10
203	603890	春秋电子	26,200	224,272.00	0.10
204	603535	嘉诚国际	13,800	224,112.00	0.10
205	002203	海亮股份	18,600	223,386.00	0.10
206	002448	中原内配	31,800	222,600.00	0.10
207	002014	永新股份	25,500	221,340.00	0.10
208	300699	光威复材	7,160	220,886.00	0.10
209	688345	博力威	5,945	220,618.95	0.10
210	603687	大胜达	25,700	218,964.00	0.10
211	688350	富淼科技	12,877	218,780.23	0.10
212	300138	晨光生物	12,200	218,380.00	0.10
213	688559	海目星	4,633	217,797.33	0.10
214	300672	国科微	2,600	216,710.00	0.10
215	688557	兰剑智能	6,099	215,172.72	0.10
216	002318	久立特材	12,500	212,875.00	0.10
217	688123	聚辰股份	3,962	212,838.64	0.10
218	601126	四方股份	14,000	212,660.00	0.10
219	688597	煜邦电力	21,042	212,524.20	0.10

220	600030	中信证券	10,700	211,646.00	0.10
221	000513	丽珠集团	5,400	210,114.00	0.09
222	300870	欧陆通	3,500	209,755.00	0.09
223	601899	紫金矿业	18,400	209,208.00	0.09
224	300407	凯发电气	22,900	209,077.00	0.09
225	002661	克明食品	18,900	208,089.00	0.09
226	688122	西部超导	3,721	207,371.33	0.09
227	002955	鸿合科技	8,800	207,240.00	0.09
228	002870	香山股份	6,200	205,654.00	0.09
229	603096	新经典	10,100	205,636.00	0.09
230	601901	方正证券	31,400	205,356.00	0.09
231	603993	洛阳钼业	38,500	205,205.00	0.09
232	688499	利元亨	3,226	204,915.52	0.09
233	002120	韵达股份	21,400	204,584.00	0.09
234	605189	富春染织	12,400	203,484.00	0.09
235	002917	金奥博	16,300	201,468.00	0.09
236	300109	新开源	8,100	201,447.00	0.09
237	300373	扬杰科技	4,900	198,793.00	0.09
238	600059	古越龙山	19,000	197,220.00	0.09
239	300453	三鑫医疗	28,656	195,720.48	0.09
240	688677	海泰新光	3,436	194,958.64	0.09
241	000885	城发环境	14,603	194,365.93	0.09
242	002262	恩华药业	6,300	194,229.00	0.09
243	002949	华阳国际	13,600	193,392.00	0.09
244	603712	七一二	6,400	193,344.00	0.09
245	002968	新大正	12,720	192,199.20	0.09
246	300443	金雷股份	5,300	187,885.00	0.08
247	300833	浩洋股份	1,700	186,031.00	0.08
248	603203	快克智能	5,900	181,602.00	0.08
249	603027	千禾味业	8,500	179,520.00	0.08
250	000591	太阳能	26,400	178,992.00	0.08

251	600971	恒源煤电	22,971	178,944.09	0.08
252	603901	永创智能	11,900	173,264.00	0.08
253	600061	国投资本	24,300	173,016.00	0.08
254	601801	皖新传媒	18,400	172,776.00	0.08
255	300258	精锻科技	11,900	172,431.00	0.08
256	600803	新奥股份	8,900	168,922.00	0.08
257	688655	迅捷兴	10,160	167,030.40	0.08
258	002702	海欣食品	31,500	165,375.00	0.07
259	600479	千金药业	14,400	162,432.00	0.07
260	603040	新坐标	6,100	162,199.00	0.07
261	603697	有友食品	17,640	161,758.80	0.07
262	300231	银信科技	18,100	161,271.00	0.07
263	300777	中简科技	3,400	160,684.00	0.07
264	300988	津荣天宇	7,300	156,804.00	0.07
265	300130	新国都	5,500	155,815.00	0.07
266	300596	利安隆	3,800	154,546.00	0.07
267	300772	运达股份	11,996	154,508.48	0.07
268	003030	祖名股份	6,400	154,496.00	0.07
269	002978	安宁股份	4,800	154,128.00	0.07
270	688658	悦康药业	7,340	152,745.40	0.07
271	600097	开创国际	15,800	150,574.00	0.07
272	600284	浦东建设	24,600	150,552.00	0.07
273	601615	明阳智能	8,700	146,856.00	0.07
274	000060	中金岭南	30,900	146,775.00	0.07
275	300360	炬华科技	8,200	146,616.00	0.07
276	300224	正海磁材	11,400	146,604.00	0.07
277	300105	龙源技术	21,700	145,607.00	0.07
278	300916	朗特智能	4,200	144,858.00	0.07
279	603882	金域医学	1,900	143,450.00	0.06
280	300541	先进数通	11,000	143,330.00	0.06
281	300035	中科电气	11,900	143,038.00	0.06

282	002910	庄园牧场	13,000	143,000.00	0.06
283	003020	立方制药	3,861	142,895.61	0.06
284	002937	兴瑞科技	5,800	142,680.00	0.06
285	300775	三角防务	4,200	141,876.00	0.06
286	002036	联创电子	14,600	141,766.00	0.06
287	600073	上海梅林	19,300	140,890.00	0.06
288	002851	麦格米特	3,700	134,939.00	0.06
289	600901	江苏金租	32,480	134,142.40	0.06
290	688616	西力科技	10,138	134,125.74	0.06
291	601019	山东出版	14,600	133,882.00	0.06
292	002826	易明医药	12,100	133,221.00	0.06
293	300382	斯莱克	10,100	133,219.00	0.06
294	002518	科士达	3,300	132,033.00	0.06
295	603267	鸿远电子	2,000	130,600.00	0.06
296	000915	华特达因	3,700	130,573.00	0.06
297	002734	利民股份	14,100	130,002.00	0.06
298	000156	华数传媒	14,800	128,760.00	0.06
299	002873	新天药业	9,500	128,440.00	0.06
300	300401	花园生物	11,000	127,820.00	0.06
301	002956	西麦食品	8,100	126,603.00	0.06
302	603321	梅轮电梯	16,200	126,198.00	0.06
303	688556	高测股份	2,362	125,516.68	0.06
304	688078	龙软科技	2,432	125,369.60	0.06
305	600050	中国联通	25,900	124,320.00	0.06
306	600833	第一医药	8,800	122,320.00	0.06
307	600887	伊利股份	4,300	121,776.00	0.05
308	688678	福立旺	5,590	118,787.50	0.05
309	600863	内蒙华电	28,400	117,860.00	0.05
310	000778	新兴铸管	28,700	117,096.00	0.05
311	600976	健民集团	1,500	115,635.00	0.05
312	300666	江丰电子	1,700	115,532.00	0.05

313	300881	盛德鑫泰	3,480	114,666.00	0.05
314	600580	卧龙电驱	7,800	113,958.00	0.05
315	688577	浙海德曼	2,394	113,906.52	0.05
316	300639	凯普生物	11,355	113,777.10	0.05
317	300873	海晨股份	5,720	113,770.80	0.05
318	688093	世华科技	5,666	113,659.96	0.05
319	000550	江铃汽车	8,200	113,488.00	0.05
320	300628	亿联网络	3,220	112,925.40	0.05
321	603050	科林电气	7,000	112,770.00	0.05
322	300684	中石科技	5,100	112,710.00	0.05
323	301004	嘉益股份	2,900	112,520.00	0.05
324	603185	弘元绿能	1,500	111,825.00	0.05
325	600123	兰花科创	13,650	111,657.00	0.05
326	000932	华菱钢铁	23,400	111,618.00	0.05
327	300570	太辰光	2,033	111,225.43	0.05
328	603365	水星家纺	7,900	111,074.00	0.05
329	300358	楚天科技	7,400	110,482.00	0.05
330	600528	中铁工业	11,100	109,668.00	0.05
331	002938	鹏鼎控股	4,500	109,305.00	0.05
332	603556	海兴电力	4,300	108,532.00	0.05
333	600998	九州通	10,430	108,263.40	0.05
334	688315	诺禾致源	4,016	106,624.80	0.05
335	600846	同济科技	9,500	106,400.00	0.05
336	300457	赢合科技	6,000	105,960.00	0.05
337	300059	东方财富	7,356	104,455.20	0.05
338	002803	吉宏股份	5,100	104,346.00	0.05
339	002557	洽洽食品	2,500	103,875.00	0.05
340	603966	法兰泰克	8,200	103,566.00	0.05
341	002765	蓝黛科技	12,200	101,992.00	0.05
342	300073	当升科技	2,000	100,660.00	0.05
343	600873	梅花生物	11,200	100,016.00	0.05

344	002507	涪陵榨菜	5,460	99,972.60	0.05
345	603999	读者传媒	14,000	97,860.00	0.04
346	300839	博汇股份	7,280	96,751.20	0.04
347	300801	泰和科技	6,000	96,600.00	0.04
348	688799	华纳药厂	2,376	96,513.12	0.04
349	601601	中国太保	3,700	96,126.00	0.04
350	002777	久远银海	2,710	96,123.70	0.04
351	603086	先达股份	14,000	95,900.00	0.04
352	000933	神火股份	7,300	94,900.00	0.04
353	603787	新日股份	5,500	92,455.00	0.04
354	002304	洋河股份	700	91,945.00	0.04
355	605058	澳弘电子	4,000	89,800.00	0.04
356	002478	常宝股份	11,900	88,655.00	0.04
357	002216	三全食品	5,600	87,248.00	0.04
358	603019	中科曙光	1,700	86,530.00	0.04
359	603855	华荣股份	3,200	85,120.00	0.04
360	688087	英科再生	3,564	84,858.84	0.04
361	300494	盛天网络	3,420	84,781.80	0.04
362	603711	香飘飘	4,100	84,173.00	0.04
363	300970	华绿生物	3,600	84,096.00	0.04
364	002801	微光股份	3,100	83,886.00	0.04
365	300298	三诺生物	3,100	83,824.00	0.04
366	688377	迪威尔	3,334	83,516.70	0.04
367	600129	太极集团	1,400	83,286.00	0.04
368	300470	中密控股	1,800	83,196.00	0.04
369	600929	雪天盐业	10,400	82,576.00	0.04
370	600438	通威股份	2,400	82,344.00	0.04
371	688560	明冠新材	2,962	82,313.98	0.04
372	603681	永冠新材	5,700	81,396.00	0.04
373	688566	吉贝尔	2,082	81,218.82	0.04
374	300629	新劲刚	3,900	80,457.00	0.04

375	300514	友讯达	5,400	78,786.00	0.04
376	600219	南山铝业	25,900	78,218.00	0.04
377	300890	翔丰华	1,900	78,090.00	0.04
378	600888	新疆众和	9,700	76,824.00	0.03
379	300034	钢研高纳	1,900	74,841.00	0.03
380	300394	天孚通信	700	74,781.00	0.03
381	603968	醋化股份	4,200	74,592.00	0.03
382	600167	联美控股	10,700	74,579.00	0.03
383	605183	确成股份	4,100	74,210.00	0.03
384	601869	长飞光纤	2,000	74,020.00	0.03
385	300845	捷安高科	3,400	73,882.00	0.03
386	600132	重庆啤酒	800	73,728.00	0.03
387	000028	国药一致	1,690	73,700.90	0.03
388	603927	中科软	1,900	73,264.00	0.03
389	300788	中信出版	2,200	73,062.00	0.03
390	603161	科华控股	5,000	72,850.00	0.03
391	603613	国联股份	1,936	71,496.48	0.03
392	600089	特变电工	3,200	71,328.00	0.03
393	601995	中金公司	2,000	71,040.00	0.03
394	601137	博威合金	4,400	68,464.00	0.03
395	000661	长春高新	500	68,150.00	0.03
396	600377	宁沪高速	6,900	67,827.00	0.03
397	600968	海油发展	22,000	67,540.00	0.03
398	605098	行动教育	1,700	67,303.00	0.03
399	003017	大洋生物	2,000	67,300.00	0.03
400	601985	中国核电	9,500	66,975.00	0.03
401	000153	丰原药业	6,600	66,660.00	0.03
402	600419	天润乳业	4,100	66,502.00	0.03
403	600236	桂冠电力	11,800	65,726.00	0.03
404	300244	迪安诊断	2,500	64,075.00	0.03
405	002847	盐津铺子	750	63,787.50	0.03

406	600919	江苏银行	8,600	63,210.00	0.03
407	002705	新宝股份	3,500	63,105.00	0.03
408	601009	南京银行	7,600	60,800.00	0.03
409	003019	宸展光电	2,964	60,762.00	0.03
410	688466	金科环境	3,041	60,698.36	0.03
411	601872	招商轮船	10,400	60,216.00	0.03
412	002315	焦点科技	1,500	60,000.00	0.03
413	300624	万兴科技	500	58,575.00	0.03
414	603728	鸣志电器	700	56,210.00	0.03
415	600028	中国石化	8,800	55,968.00	0.03
416	601900	南方传媒	2,700	55,377.00	0.02
417	002275	桂林三金	3,000	54,030.00	0.02
418	688668	鼎通科技	536	52,420.80	0.02
419	600814	杭州解百	6,100	52,155.00	0.02
420	000726	鲁泰 A	7,600	51,984.00	0.02
421	002180	纳思达	1,500	51,375.00	0.02
422	300593	新雷能	2,236	51,226.76	0.02
423	000567	海德股份	3,915	50,190.30	0.02
424	002401	中远海科	1,900	50,008.00	0.02
425	300951	博硕科技	900	49,167.00	0.02
426	000521	长虹美菱	6,400	48,896.00	0.02
427	603319	湘油泵	2,830	47,911.90	0.02
428	600305	恒顺醋业	4,400	47,784.00	0.02
429	300856	科思股份	600	47,262.00	0.02
430	601077	渝农商行	13,100	47,029.00	0.02
431	601518	吉林高速	19,740	46,981.20	0.02
432	688090	瑞松科技	1,266	46,753.38	0.02
433	603859	能科科技	900	46,017.00	0.02
434	300634	彩讯股份	1,700	44,880.00	0.02
435	600557	康缘药业	1,600	43,936.00	0.02
436	603136	天目湖	1,700	43,860.00	0.02

436	600757	长江传媒	5,100	43,860.00	0.02
438	300820	英杰电气	525	43,249.50	0.02
439	300811	铂科新材	720	42,796.80	0.02
440	300573	兴齐眼药	200	42,760.00	0.02
441	688128	中国电研	1,657	42,253.50	0.02
442	000568	泸州老窖	200	41,914.00	0.02
443	603456	九洲药业	1,500	41,070.00	0.02
444	000975	银泰黄金	3,500	40,950.00	0.02
445	000099	中信海直	4,300	40,592.00	0.02
446	000921	海信家电	1,500	40,425.00	0.02
447	603516	淳中科技	1,800	39,690.00	0.02
448	300556	丝路视觉	1,600	39,264.00	0.02
449	002889	东方嘉盛	1,960	39,239.20	0.02
450	002896	中大力德	840	38,782.80	0.02
451	603699	纽威股份	2,600	38,688.00	0.02
452	002913	奥士康	1,000	38,180.00	0.02
453	600969	郴电国际	5,100	38,097.00	0.02
454	300621	维业股份	3,800	38,038.00	0.02
455	688521	芯原股份	525	37,758.00	0.02
456	002236	大华股份	1,900	37,525.00	0.02
457	300852	四会富仕	900	37,314.00	0.02
458	603277	银都股份	1,700	37,128.00	0.02
459	300909	汇创达	1,400	36,988.00	0.02
460	002675	东诚药业	2,500	36,775.00	0.02
461	688118	普元信息	1,065	36,774.45	0.02
462	002340	格林美	5,300	36,623.00	0.02
463	688590	新致软件	1,603	36,436.19	0.02
464	300474	景嘉微	400	35,996.00	0.02
465	601881	中国银河	3,100	35,991.00	0.02
466	600458	时代新材	3,000	35,970.00	0.02
467	002997	瑞鹄模具	1,200	35,676.00	0.02

468	603856	东宏股份	2,700	35,613.00	0.02
469	688080	映翰通	721	35,256.90	0.02
470	000719	中原传媒	3,000	35,100.00	0.02
471	002479	富春环保	7,500	34,950.00	0.02
472	688312	燕麦科技	1,783	34,608.03	0.02
473	002957	科瑞技术	1,700	34,459.00	0.02
474	002946	新乳业	2,400	34,440.00	0.02
475	688550	瑞联新材	868	34,372.80	0.02
476	601975	招商南油	12,000	34,320.00	0.02
477	000960	锡业股份	2,200	34,210.00	0.02
478	600883	博闻科技	4,500	34,155.00	0.02
479	600665	天地源	8,400	34,020.00	0.02
480	000977	浪潮信息	700	33,950.00	0.02
481	603279	景津装备	1,080	33,868.80	0.02
482	601088	中国神华	1,100	33,825.00	0.02
483	688618	三旺通信	490	33,182.80	0.01
484	000541	佛山照明	5,800	33,118.00	0.01
485	688358	祥生医疗	649	33,099.00	0.01
486	000552	甘肃能化	9,800	32,634.00	0.01
487	600686	金龙汽车	4,000	32,560.00	0.01
488	688069	德林海	1,532	32,539.68	0.01
489	688314	康拓医疗	868	32,497.92	0.01
490	002973	侨银股份	2,800	32,480.00	0.01
491	603129	春风动力	200	32,380.00	0.01
492	601857	中国石油	4,300	32,121.00	0.01
493	688100	威胜信息	1,076	32,075.56	0.01
494	688278	特宝生物	727	31,922.57	0.01
495	605158	华达新材	4,200	31,920.00	0.01
496	600761	安徽合力	1,600	31,888.00	0.01
497	603609	禾丰股份	3,500	31,850.00	0.01
498	000895	双汇发展	1,300	31,837.00	0.01

499	002452	长高电新	4,300	31,648.00	0.01
500	688669	聚石化学	1,741	31,564.33	0.01
501	688679	通源环境	2,166	31,558.62	0.01
502	300785	值得买	1,200	31,416.00	0.01
503	002655	共达电声	2,400	31,176.00	0.01
504	002384	东山精密	1,200	31,080.00	0.01
505	688659	元琛科技	1,811	30,660.23	0.01
506	002697	红旗连锁	5,200	30,368.00	0.01
507	688586	江航装备	2,177	30,282.07	0.01
508	300982	苏文电能	500	30,280.00	0.01
509	002916	深南电路	400	30,148.00	0.01
510	688367	工大高科	1,700	30,056.00	0.01
511	002158	汉钟精机	1,200	29,952.00	0.01
512	300947	德必集团	2,050	29,909.50	0.01
513	002345	潮宏基	3,800	29,868.00	0.01
514	600639	浦东金桥	2,400	29,784.00	0.01
515	000090	天健集团	5,900	29,736.00	0.01
516	688008	澜起科技	517	29,686.14	0.01
517	300953	震裕科技	400	29,452.00	0.01
518	688004	博汇科技	836	29,234.92	0.01
519	600425	青松建化	6,600	29,172.00	0.01
520	002133	广宇集团	8,600	29,154.00	0.01
521	002332	仙琚制药	2,200	29,150.00	0.01
522	601225	陕西煤业	1,600	29,104.00	0.01
523	002129	TCL中环	875	29,050.00	0.01
524	603507	振江股份	800	29,008.00	0.01
525	688181	八亿时空	1,026	28,922.94	0.01
526	600297	广汇汽车	13,900	28,912.00	0.01
527	002709	天赐材料	700	28,833.00	0.01
528	000888	峨眉山 A	2,500	28,650.00	0.01
529	002738	中矿资源	560	28,526.40	0.01

530	688199	久日新材	948	28,269.36	0.01
531	000767	晋控电力	8,900	28,213.00	0.01
532	002311	海大集团	600	28,104.00	0.01
533	603192	汇得科技	1,470	28,062.30	0.01
534	688378	奥来德	568	28,059.20	0.01
535	605168	三人行	325	27,930.50	0.01
536	002965	祥鑫科技	500	27,840.00	0.01
537	600067	冠城大通	10,500	27,825.00	0.01
538	003032	传智教育	1,900	27,683.00	0.01
539	002881	美格智能	810	27,661.50	0.01
540	300693	盛弘股份	748	27,616.16	0.01
541	002202	金风科技	2,600	27,612.00	0.01
542	600708	光明地产	12,900	27,606.00	0.01
543	688685	迈信林	1,300	27,508.00	0.01
544	600997	开滦股份	4,600	27,462.00	0.01
545	000729	燕京啤酒	2,200	27,434.00	0.01
546	601928	凤凰传媒	2,400	27,360.00	0.01
547	002749	国光股份	2,400	27,192.00	0.01
548	600879	航天电子	3,200	27,168.00	0.01
549	002091	江苏国泰	3,600	27,144.00	0.01
550	600513	联环药业	2,800	27,048.00	0.01
551	002797	第一创业	4,700	26,884.00	0.01
552	002637	赞宇科技	2,600	26,806.00	0.01
553	002845	同兴达	1,680	26,796.00	0.01
554	601958	金钼股份	2,400	26,760.00	0.01
555	601166	兴业银行	1,700	26,605.00	0.01
556	002054	德美化工	3,800	26,524.00	0.01
557	002985	北摩高科	600	26,472.00	0.01
558	002392	北京利尔	7,300	26,426.00	0.01
559	600229	城市传媒	3,100	26,412.00	0.01
560	600309	万华化学	300	26,352.00	0.01

561	600486	扬农化工	300	26,226.00	0.01
562	002049	紫光国微	280	26,110.00	0.01
563	002132	恒星科技	7,300	26,061.00	0.01
564	003004	声迅股份	900	25,983.00	0.01
565	002821	凯莱英	220	25,929.20	0.01
566	603939	益丰药房	700	25,900.00	0.01
567	000166	申万宏源	5,600	25,872.00	0.01
568	603987	康德莱	2,000	25,840.00	0.01
569	601598	中国外运	5,500	25,630.00	0.01
570	605006	山东玻纤	3,400	25,500.00	0.01
571	600380	健康元	2,000	25,420.00	0.01
572	688299	长阳科技	1,621	25,401.07	0.01
573	603825	华扬联众	1,900	25,251.00	0.01
574	603380	易德龙	1,100	24,882.00	0.01
575	002878	元隆雅图	1,400	24,836.00	0.01
576	000803	山高环能	2,400	24,792.00	0.01
577	688096	京源环保	2,519	24,786.96	0.01
578	002788	鹭燕医药	2,600	24,778.00	0.01
579	600101	明星电力	2,600	24,726.00	0.01
580	300769	德方纳米	224	24,691.52	0.01
581	688013	天臣医疗	1,041	24,682.11	0.01
582	603115	海星股份	1,600	24,592.00	0.01
583	603317	天味食品	1,680	24,544.80	0.01
584	601500	通用股份	6,000	24,540.00	0.01
585	603663	三祥新材	1,640	24,518.00	0.01
586	601918	新集能源	5,700	24,225.00	0.01
587	601668	中国建筑	4,200	24,108.00	0.01
588	300786	国林科技	1,280	24,051.20	0.01
589	601231	环旭电子	1,600	23,936.00	0.01
590	603128	华贸物流	2,600	23,686.00	0.01
591	300416	苏试试验	1,092	23,543.52	0.01

592	603920	世运电路	1,200	23,436.00	0.01
593	688099	晶晨股份	276	23,272.32	0.01
594	600831	广电网络	3,800	22,800.00	0.01
595	002142	宁波银行	900	22,770.00	0.01
596	600428	中远海特	3,600	22,680.00	0.01
597	603043	广州酒家	800	22,608.00	0.01
598	600368	五洲交通	6,160	22,422.40	0.01
599	601512	中新集团	2,400	22,392.00	0.01
600	603938	三孚股份	1,120	22,164.80	0.01
601	600114	东睦股份	2,900	22,098.00	0.01
602	603871	嘉友国际	1,400	21,994.00	0.01
603	002460	赣锋锂业	360	21,945.60	0.01
604	600850	电科数字	930	21,938.70	0.01
605	600196	复星医药	700	21,630.00	0.01
606	002687	乔治白	4,495	21,576.00	0.01
607	002833	弘亚数控	1,080	21,232.80	0.01
608	300709	精研科技	860	21,216.20	0.01
609	603305	旭升集团	756	21,069.72	0.01
610	603876	鼎胜新材	1,080	20,725.20	0.01
611	688233	神工股份	654	20,653.32	0.01
612	600386	北巴传媒	4,900	20,041.00	0.01
613	301076	新瀚新材	1,000	19,620.00	0.01
614	002407	多氟多	980	19,462.80	0.01
615	300861	美畅股份	440	19,082.80	0.01
616	603392	万泰生物	280	18,695.60	0.01
617	600941	中国移动	200	18,660.00	0.01
618	603599	广信股份	680	18,414.40	0.01
619	002987	京北方	840	18,412.80	0.01
620	002940	昂利康	957	18,383.97	0.01
621	600064	南京高科	2,780	18,375.80	0.01
622	300014	亿纬锂能	300	18,150.00	0.01

623	600295	鄂尔多斯	2,016	18,083.52	0.01
624	603386	骏亚科技	1,540	17,479.00	0.01
625	002953	日丰股份	1,350	17,428.50	0.01
626	600116	三峡水利	1,856	16,852.48	0.01
627	300835	龙磁科技	530	16,631.40	0.01
628	002648	卫星化学	1,103	16,500.88	0.01
629	002825	纳尔股份	1,320	16,460.40	0.01
630	603693	江苏新能	1,170	16,380.00	0.01
631	603926	铁流股份	1,560	15,958.80	0.01
632	300656	民德电子	506	15,756.84	0.01
633	300613	富瀚微	270	15,319.80	0.01
634	603995	甬金股份	630	15,063.30	0.01
635	601101	昊华能源	2,580	15,015.60	0.01
636	002695	煌上煌	1,400	14,966.00	0.01
637	603738	泰晶科技	812	13,487.32	0.01
638	002839	张家港行	3,160	13,366.80	0.01
639	300327	中颖电子	470	13,141.20	0.01
640	300681	英搏尔	555	11,815.95	0.01
641	002001	新和成	760	11,704.00	0.01
642	000498	山东路桥	1,765	11,331.30	0.01
643	300759	康龙化成	250	9,570.00	0.00
644	600455	博通股份	400	9,036.00	0.00
645	000657	中钨高新	910	8,817.90	0.00
646	600596	新安股份	780	8,525.40	0.00
647	688516	奥特维	39	7,347.60	0.00
648	605003	众望布艺	300	5,769.00	0.00
649	603822	嘉澳环保	100	3,255.00	0.00
650	600096	云天化	100	1,707.00	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	3,667,237.00	7.89
2	600057	厦门象屿	3,277,901.00	7.05
3	600926	杭州银行	2,828,286.00	6.08
4	002237	恒邦股份	2,595,444.00	5.58
5	301026	浩通科技	2,584,862.00	5.56
6	603309	维力医疗	2,572,513.00	5.53
7	000027	深圳能源	2,548,878.00	5.48
8	600642	申能股份	2,507,733.00	5.39
9	000630	铜陵有色	2,438,331.00	5.24
10	002155	湖南黄金	2,405,866.00	5.17
11	605287	德才股份	2,388,971.00	5.14
12	002649	博彦科技	2,356,081.00	5.07
13	600582	天地科技	2,321,372.00	4.99
14	300791	仙乐健康	2,216,323.00	4.77
15	603657	春光科技	2,187,848.00	4.71
16	002929	润建股份	2,186,124.00	4.70
17	601211	国泰君安	2,185,187.00	4.70
18	688621	阳光诺和	2,148,126.58	4.62
19	605088	冠盛股份	2,143,129.00	4.61
20	300452	山河药辅	2,134,740.00	4.59
21	688589	力合微	2,109,842.59	4.54
22	600285	羚锐制药	2,104,049.00	4.52
23	000682	东方电子	2,092,906.00	4.50
24	000739	普洛药业	2,083,079.00	4.48
25	002605	姚记科技	2,079,043.00	4.47
26	300636	同和药业	2,077,012.00	4.47
27	300900	广联航空	2,075,028.00	4.46
28	002732	燕塘乳业	2,073,062.00	4.46

29	003043	华亚智能	2,053,711.00	4.42
30	688226	威腾电气	2,021,142.52	4.35
31	688217	睿昂基因	1,983,099.84	4.26
32	600036	招商银行	1,976,523.00	4.25
33	601688	华泰证券	1,963,675.00	4.22
34	603799	华友钴业	1,944,479.00	4.18
35	002737	葵花药业	1,938,249.00	4.17
36	688599	天合光能	1,931,114.59	4.15
37	603300	华铁应急	1,916,751.80	4.12
38	605218	伟时电子	1,898,960.00	4.08
39	002947	恒铭达	1,898,895.07	4.08
40	603878	武进不锈	1,895,091.00	4.08
41	605166	聚合顺	1,879,374.00	4.04
42	002829	星网宇达	1,829,201.00	3.93
43	002020	京新药业	1,827,170.11	3.93
44	603158	腾龙股份	1,805,204.40	3.88
45	000417	合肥百货	1,790,338.00	3.85
46	300181	佐力药业	1,774,760.00	3.82
47	002179	中航光电	1,766,571.00	3.80
48	002396	星网锐捷	1,749,387.00	3.76
49	600999	招商证券	1,718,319.00	3.70
50	600745	闻泰科技	1,703,923.00	3.66
51	600875	东方电气	1,695,410.00	3.65
52	688063	派能科技	1,688,967.83	3.63
53	601098	中南传媒	1,686,910.00	3.63
54	688819	天能股份	1,668,041.95	3.59
55	603118	共进股份	1,617,840.00	3.48
56	600600	青岛啤酒	1,608,094.00	3.46
57	600566	济川药业	1,602,687.00	3.45
58	688345	博力威	1,585,294.66	3.41
59	300873	海晨股份	1,565,172.00	3.37

60	603527	众源新材	1,565,152.00	3.37
61	688092	爱科科技	1,556,245.15	3.35
62	300908	仲景食品	1,552,445.00	3.34
63	600073	上海梅林	1,534,359.00	3.30
64	688239	航宇科技	1,517,781.60	3.26
65	603896	寿仙谷	1,511,060.00	3.25
66	002885	京泉华	1,505,519.40	3.24
67	600362	江西铜业	1,503,625.00	3.23
68	300925	法本信息	1,503,566.00	3.23
69	603883	老百姓	1,502,911.00	3.23
70	688597	煜邦电力	1,491,180.88	3.21
71	688329	艾隆科技	1,489,761.43	3.20
72	300515	三德科技	1,488,746.00	3.20
73	603228	景旺电子	1,473,421.00	3.17
74	600967	内蒙一机	1,459,324.00	3.14
75	603676	卫信康	1,454,277.00	3.13
76	002025	航天电器	1,452,780.00	3.12
77	600060	海信视像	1,452,413.00	3.12
78	601618	中国中冶	1,449,590.00	3.12
79	603579	荣泰健康	1,440,441.00	3.10
80	002815	崇达技术	1,437,625.00	3.09
81	605266	健之佳	1,427,668.00	3.07
82	601901	方正证券	1,425,482.00	3.07
83	601898	中煤能源	1,424,532.00	3.06
84	002461	珠江啤酒	1,411,670.00	3.04
85	002768	国恩股份	1,398,536.00	3.01
86	600548	深高速	1,398,088.00	3.01
87	600123	兰花科创	1,387,961.00	2.98
88	600489	中金黄金	1,386,979.00	2.98
89	600908	无锡银行	1,371,970.00	2.95
90	002391	长青股份	1,371,312.00	2.95

91	000878	云南铜业	1,353,590.00	2.91
92	000728	国元证券	1,352,244.00	2.91
93	688138	清溢光电	1,352,145.22	2.91
94	603689	皖天然气	1,339,174.00	2.88
95	600583	海油工程	1,336,277.00	2.87
96	300705	九典制药	1,335,263.00	2.87
97	002661	克明食品	1,301,722.00	2.80
98	000885	城发环境	1,293,902.00	2.78
99	300532	今天国际	1,292,643.00	2.78
100	688499	利元亨	1,292,078.51	2.78
101	603267	鸿远电子	1,285,705.00	2.77
102	300750	宁德时代	1,277,358.00	2.75
103	603611	诺力股份	1,261,507.00	2.71
104	603890	春秋电子	1,256,897.00	2.70
105	688557	兰剑智能	1,245,223.85	2.68
106	300796	贝斯美	1,223,410.88	2.63
107	002459	晶澳科技	1,216,578.00	2.62
108	002782	可立克	1,200,122.00	2.58
109	300373	扬杰科技	1,196,584.00	2.57
110	603712	七一二	1,189,260.00	2.56
111	300699	光威复材	1,162,479.00	2.50
112	688663	新风光	1,146,719.77	2.47
113	002381	双箭股份	1,144,019.00	2.46
114	601169	北京银行	1,143,349.00	2.46
115	002955	鸿合科技	1,134,484.00	2.44
116	688682	霍莱沃	1,132,162.65	2.43
117	688658	悦康药业	1,130,804.66	2.43
118	002448	中原内配	1,128,000.00	2.43
119	300674	宇信科技	1,124,855.00	2.42
120	002422	科伦药业	1,105,817.00	2.38
121	688517	金冠电气	1,098,220.01	2.36

122	603993	洛阳钼业	1,095,394.00	2.36
123	605398	新炬网络	1,085,812.00	2.34
124	003002	壶化股份	1,084,208.00	2.33
125	601600	中国铝业	1,076,264.00	2.31
126	000733	振华科技	1,075,432.00	2.31
127	603690	至纯科技	1,059,749.00	2.28
128	600012	皖通高速	1,053,223.00	2.27
129	000550	江铃汽车	1,043,732.00	2.24
130	688687	凯因科技	1,043,477.90	2.24
131	603882	金城医学	1,042,227.98	2.24
132	603368	柳药集团	1,030,523.00	2.22
133	300138	晨光生物	1,025,511.00	2.21
134	000534	万泽股份	1,014,513.00	2.18
135	600459	贵研铂业	1,008,062.00	2.17
136	603093	南华期货	1,001,690.00	2.15
137	002318	久立特材	999,577.00	2.15
138	688335	复洁环保	998,818.00	2.15
139	688350	富淼科技	994,299.44	2.14
140	605123	派克新材	985,353.00	2.12
141	003020	立方制药	984,821.00	2.12
142	603506	南都物业	984,683.00	2.12
143	001205	盛航股份	982,170.00	2.11
144	600971	恒源煤电	970,681.39	2.09
145	300407	凯发电气	964,233.00	2.07
146	600030	中信证券	939,402.00	2.02

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	600036	招商银行	1,669,196.00	3.59
2	603993	洛阳钼业	1,558,002.00	3.35
3	003020	立方制药	1,546,358.00	3.33
4	600073	上海梅林	1,498,480.00	3.22
5	002661	克明食品	1,487,527.00	3.20
6	688819	天能股份	1,430,022.86	3.08
7	600057	厦门象屿	1,406,837.00	3.03
8	688658	悦康药业	1,394,561.50	3.00
9	002391	长青股份	1,386,166.00	2.98
10	603890	春秋电子	1,382,769.00	2.97
11	300873	海晨股份	1,380,191.00	2.97
12	002237	恒邦股份	1,375,447.00	2.96
13	002155	湖南黄金	1,362,511.00	2.93
14	605287	德才股份	1,335,591.00	2.87
15	000550	江铃汽车	1,325,611.00	2.85
16	601007	金陵饭店	1,296,757.00	2.79
17	300908	仲景食品	1,293,890.00	2.78
18	301026	浩通科技	1,286,567.00	2.77
19	688597	煜邦电力	1,282,786.96	2.76
20	600489	中金黄金	1,279,438.00	2.75
21	688138	清溢光电	1,275,817.06	2.74
22	688616	西力科技	1,263,000.48	2.72
23	300777	中简科技	1,258,801.00	2.71
24	603527	众源新材	1,245,604.00	2.68
25	000878	云南铜业	1,244,080.00	2.68
26	603896	寿仙谷	1,235,814.00	2.66
27	002955	鸿合科技	1,233,717.00	2.65
28	000885	城发环境	1,233,182.00	2.65
29	601901	方正证券	1,230,948.00	2.65

30	600967	内蒙一机	1,229,509.00	2.64
31	603689	皖天然气	1,220,674.00	2.63
32	600566	济川药业	1,212,424.00	2.61
33	688345	博力威	1,198,978.95	2.58
34	600123	兰花科创	1,181,169.00	2.54
35	300532	今天国际	1,176,579.00	2.53
36	002396	星网锐捷	1,124,855.00	2.42
37	002020	京新药业	1,120,940.00	2.41
38	603579	荣泰健康	1,118,997.00	2.41
39	002649	博彦科技	1,115,942.00	2.40
40	603676	卫信康	1,069,140.00	2.30
41	603611	诺力股份	1,065,487.00	2.29
42	603712	七一二	1,059,815.00	2.28
43	603300	华铁应急	1,040,618.00	2.24
44	603309	维力医疗	1,040,496.00	2.24
45	002605	姚记科技	1,033,116.00	2.22
46	300059	东方财富	1,026,355.00	2.21
47	300453	三鑫医疗	1,014,626.30	2.18
48	600784	鲁银投资	1,003,956.00	2.16
49	688557	兰剑智能	1,001,545.40	2.15
50	000417	合肥百货	996,398.00	2.14
51	688589	力合微	978,658.64	2.10
52	605218	伟时电子	978,307.00	2.10
53	688335	复洁环保	964,241.98	2.07
54	002448	中原内配	957,405.00	2.06
55	603267	鸿远电子	955,664.00	2.06
56	002459	晶澳科技	947,785.00	2.04

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	341,373,133.28
卖出股票收入（成交）总额	178,349,965.71

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	11,643,212.05	5.24
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	11,643,212.05	5.24

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	48,000	4,853,724.49	2.19
2	019694	23国债01	45,000	4,549,933.97	2.05

3	019679	22国债14	22,000	2,239,553.59	1.01
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；杭州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	-
2	应收清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	58,736.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	58,736.78

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
东兴宸祥量化混合A	944	198,917.54	144,794,075.40	77.11%	42,984,077.64	22.89%
东兴宸祥量化混合C	618	31,422.21	932,976.46	4.80%	18,485,950.29	95.20%
合计	1,562	132,648.58	145,727,051.86	70.33%	61,470,027.93	29.67%

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	东兴宸祥量化混合A	0.99	0.00%
	东兴宸祥量化混合C	4,785.75	0.02%

	合计	4,786.74	0.00%
--	----	----------	-------

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	东兴宸祥量化混合A	东兴宸祥量化混合C
基金合同生效日(2022年01月28 日)基金份额总额	84,044,614.48	148,850,405.53
本报告期期初基金份额总额	38,884,499.38	8,201,603.68
本报告期基金总申购份额	159,208,006.50	47,864,233.17
减：本报告期基金总赎回份额	10,314,352.84	36,646,910.10
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	187,778,153.04	19,418,926.75

§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

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，本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券股份有限公司	2	366,843,975.97	70.58%	269,690.19	68.80%	-
东方财富证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	2	152,879,123.02	29.42%	122,303.28	31.20%	-

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

2、交易单元的选择标准和程序

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

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

双方的权利义务等。

3、本基金本报告期内新增租用2个交易单元，分别为华西证券股份有限公司上海交易所交易单元及深圳交易所交易单元。

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
长江证券股份有限公司	12,792,637.24	100.00%	3,800,000.00	100.00%	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-

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	东兴宸祥量化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	东兴宸祥量化混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2023年第1号）	指定报刊、指定网站	2023-02-09
4	东兴宸祥量化混合型证券投资基金产品资料概要更新	指定报刊、指定网站	2023-02-09
5	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
6	东兴宸祥量化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
7	东兴宸祥量化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
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 日至 2023 年 3 月 6 日	14,999,000.00	-	-	14,999,000.00	7.24%
	2	2023 年 1 月 31 日至 2023 年 3 月 6 日、 2023 年 3 月 23 日至 2023 年 5 月 21 日、 2023 年 5 月 29 日至 2023 年 6 月 30 日	9,383,445.95	84,473,859.43	-	93,857,305.38	45.30%
	3	2023 年 3 月 7 日至 2023 年 5 月 28 日、 2023 年 6 月 2 日至 2023 年 6 月 8 日	-	35,928,321.21	-	35,928,321.21	17.34%
产品特有风险							
<p>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。</p> <p>2、本基金可投资国债期货，可能引发如下风险：国债期货交易采用保证金交易方式，基金资产可能由于无法及时筹措资金满足建立或者维持国债期货头寸所要求的保证金而面临保证金风险。同时，该潜在损失可能成倍放大，具有杠杆性风险。另外，期货在对冲市场风险的使用过程中，基金资产可能因为国债期货合约与合约标的价格波动不一致而面临基差风险。</p> <p>3、本基金可投资股指期货，股指期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，指数微小的变动就可能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。</p> <p>4、本基金可投资于在全国银行间债券市场或证券交易所交易的资产支持证券，基金管理人将本着谨慎和控制风险的原则进行资产支持证券投资，但由于资产支持证券具有一定的信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿还风险等风险，可能导致包括基金净值波动在内的各项风险。</p> <p>5、本基金投资股票期权，可能引发如下风险：股票期权作为一种金融衍生品，具备一些特有的风险点。投资股票期权所面临的主要风险是衍生品价格波动带来的市场风险；衍生品基础资产交易量大于市场可报价的交易量而产生的流动性风险；衍生品合约价格和标的指数价格之间的价格差的波动而造成基差风险；无法及时筹措资金满足建立或者维持衍生品合约头寸所要求的保证金而带来的保证金风险；交易对手不愿或无法履行契约而产生的信用风险以及各类操作风险。</p>							

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

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）查阅。

东兴基金管理有限公司
二〇二三年八月三十一日