

东兴宸祥量化混合型证券投资基金

2024 年中期报告

2024 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:2024 年 08 月 30 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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2024年8月23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2024年1月1日起至2024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	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§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等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	63
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	66
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	66
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	66
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	67
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	67
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	67
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	67
7.12 投资组合报告附注	67
§8 基金份额持有人信息	68
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	68
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	68

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.....	68
§9 开放式基金份额变动.....	69
§10 重大事件揭示.....	69
10.1 基金份额持有人大会决议.....	69
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.....	69
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	69
10.4 基金投资策略的改变.....	70
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	70
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.....	70
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	70
10.8 其他重大事件.....	71
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	72
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.....	72
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	73
§12 备查文件目录.....	73
12.1 备查文件目录.....	73
12.2 存放地点.....	73
12.3 查阅方式.....	73

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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	168,488,635.50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	155,974,410.79份	12,514,224.71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</p>

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		东兴基金管理有限公司	长江证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李宛霖	江何立
	联系电话	400-670-1800	027-65795980
	电子邮箱	xxpl@dxc.com.cn	tgxp@cjsc.com.cn
客户服务电话		400-670-1800	027-65795980
传真		010-83770122	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		北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座15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		100033	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.dxc.com.cn
基金中期报告备置地点	北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座15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	北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座15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 (2024年01月01日-2024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	-11,187,655.64	-832,914.11
本期利润	-13,178,570.32	-1,113,647.61
加权平均基金份额本期利润	-0.0817	-0.0862
本期加权平均净值利润率	-8.68%	-9.17%
本期基金份额净值增长率	-8.13%	-8.18%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)	
期末可供分配利润	-13,124,753.01	-1,082,787.63
期末可供分配基金份额利润	-0.0841	-0.0865
期末基金资产净值	142,849,657.78	11,431,437.08
期末基金份额净值	0.9159	0.9135
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-8.41%	-8.65%

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

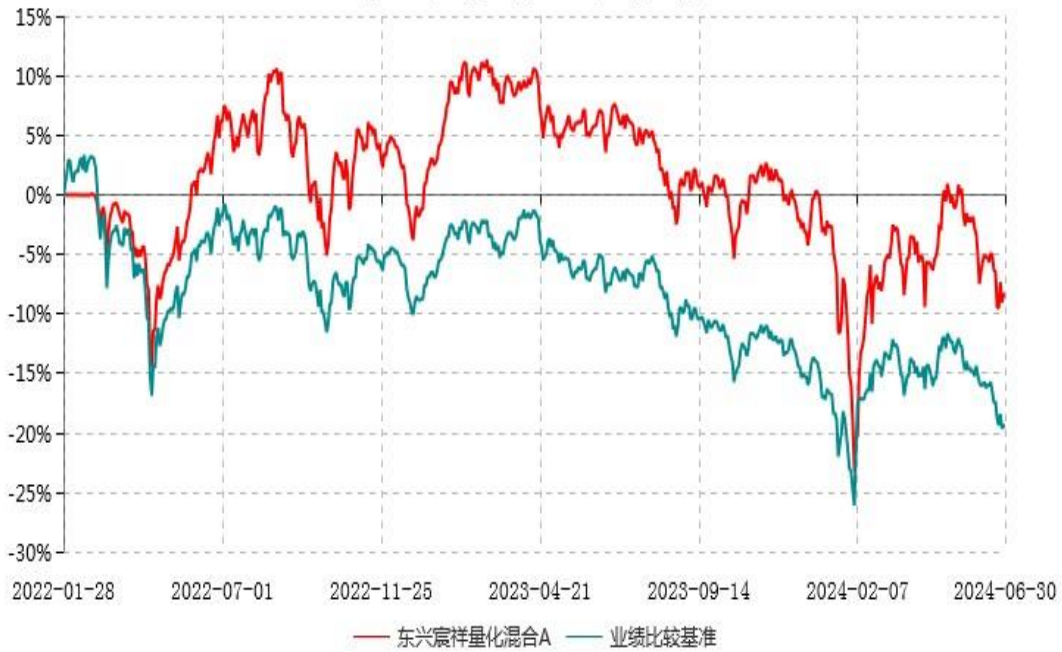
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-6.69%	1.33%	-5.41%	0.77%	-1.28%	0.56%
过去三个月	-3.24%	1.37%	-4.97%	0.91%	1.73%	0.46%
过去六个月	-8.13%	1.78%	-6.56%	1.28%	-1.57%	0.50%
过去一年	-14.56%	1.38%	-13.52%	1.02%	-1.04%	0.36%
自基金合同生效起至今	-8.41%	1.19%	-19.43%	0.99%	11.02%	0.20%

东兴宸祥量化混合C

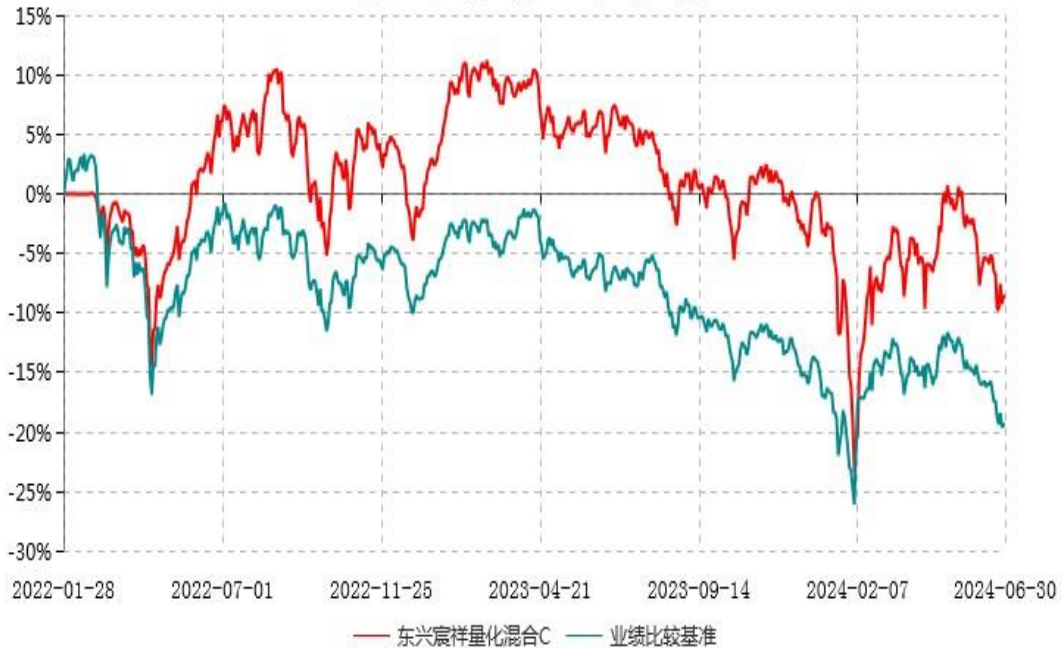
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-6.70%	1.33%	-5.41%	0.77%	-1.29%	0.56%
过去三个月	-3.27%	1.37%	-4.97%	0.91%	1.70%	0.46%
过去六个月	-8.18%	1.78%	-6.56%	1.28%	-1.62%	0.50%
过去一年	-14.65%	1.38%	-13.52%	1.02%	-1.13%	0.36%
自基金合同生效起至今	-8.65%	1.19%	-19.43%	0.99%	10.78%	0.20%

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
(2022年01月28日-2024年06月30日)



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
(2022年01月28日-2024年06月30日)



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；

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2024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、东兴连众一年持有期混合型证券投资基金、东兴数字经济混合型发起式证券投资基金共19只开放式基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)	证券从业	说明

		期限		年限	
		任职日期	离任日期		
李兵伟先生	本基金基金经理	2022-01-28	-	13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。现任东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东兴中证消费50指数证券投资基金基金经理、东兴兴晟混合型证券投资基金基金经理、东兴宸瑞量化混合型证券投资基金基金经理、东兴宸祥量化混合型证券投资基金基金经理、东兴连众一年持有期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，协商不一致则由分管投资的公司领导决定；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

上半年权益市场依旧处于寒冬腊月，上证指数相比去年年底虽然只微跌了0.25%，但个股跌幅十分明显，在经历了两年的震荡调整后，个股层面的再度下跌啃噬着投资者残存的信心。以分散投资见长的量化策略上半年受到了严峻的考验，分散投资是一种经典的风险控制措施，也就是我们常说的不要把鸡蛋放在一个篮子里，这也是我们产品在

投资中一贯坚持的风险控制手段，长期来看，这种做法无疑是正确的,但不可否认，在某些时间段，当上涨的股票集中在某一类板块中时，分散投资难以避免系统性的风险。上半年全市场5300多只股票近75%的股票出现了不同程度的下跌，市场中位数跌幅超过23%，从这个数据来看，上半年市场远远要比去年更残酷。

上半年，量化投资受到了比较多的关注，一是去年业绩不错的一些量化产品春节前出现了较大幅度的回撤，投资者对部分产品投资集中于小微盘表达了不满情绪。二是市场波动加剧，呈现较大的亏钱效应，部分投资者迁怒于高频程序化交易。客观来说，量化只是一种投资工具，没有好坏之分，都是主观想法付之于实践的一种辅助工具。从演进规律来看，从定性分析为主到定性定量分析相结合是一种必然，尤其是随着数据标准化程度的提高和数据量的增加。从公平的角度来说，依托交易速度和tick级别数据中衍生出的高频交易策略受到更多的监管无可厚非。但基于股票基本面数据进行的定量分析以及基于分散投资原则进行的组合投资理念我们应该去坚持。在日常的产品投资中，我们坚持基本面量化的指导思想，从多个角度去分析每只股票的投资价值，努力去构建一个极具性价比的股票组合，可能这个组合不适应特定的历史行情，但基于我们对大量数据的回溯分析，这样的组合长期来看是科学的。

目前来看，A股估值和交易指标已经在历史较为极端水平，估值水平处于底部位置，成交量也呈现缩量态势，防御板块与成长板块估值差在缩小，黎明前的黑暗往往是最为困难的，市场好转前的下跌也最为消磨投资人的意志。但从历史长河来看，市场涨跌都是周期性变化，估值不可能一直便宜下去，这个阶段我们能做的，就是保持战略定力，相比追高之前上涨的资产，俯身捡拾错估的优质便宜资产可能更具性价比。

东兴宸祥的投资策略依旧侧重于组合的构建而非择时，底层的选股逻辑为主要基于基本面多因子模型，坦白而言，过去几个季度基于基本面的投资逻辑面临较大的压力，主要是特定市场环境下短期市场底层的驱动因素并非业绩驱动，在这种情况下，我们组合构建过程中的风险控制模块发挥了极大的作用，将我们的回撤控制在可控的水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2024年1月1日起至2024年6月30日，本基金A类份额净值增长率为-8.13%，业绩比较基准收益率为-6.56%，低于业绩比较基准1.57%；本基金C类份额净值增长率为-8.18%，业绩比较基准收益率为-6.56%，低于业绩比较基准1.62%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年，国内出口在海外补库周期带动下表现较好，并带动制造业投资继续维持高速增长，基建投资保持稳定。内需方面，服务消费增长亮眼，居民出行意愿浓厚。房地产投资继续大幅拖累内需，从海外经验来看，目前国内新房销量已经回落至长期中枢水平，随着地产政策的进一步放松，目前地产销量有逐步企稳迹象。展望下半年，为实现全年

经济增速目标，积极财政政策将继续发力，结构性货币工具将围绕“三大工程”，制造业转型升级等领域精准支持。中央政府“加杠杆”下，基建投资仍将是经济增长重要压舱石。居民部门将继续修复资产负债表，消费继续结构性复苏。地产投资下半年仍有下行压力，但前瞻性销量等指标在基数影响下预计同比降幅将逐步收窄，环比逐步企稳。总量经济增速保持稳定下，A股盈利端将趋于平稳。

中期来看，国内经济转型是大势所趋。一方面需要进一步扩大内需，另一方面推动制造业转型升级。下半年关于改革的线索预计会更加明朗，届时有望改善市场风险偏好。

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：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	1,121,753.01	822,913.04
结算备付金		10,146.54	10,055.50
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	153,536,849.31	178,071,322.28
其中：股票投资		145,310,367.26	168,328,825.07
基金投资		-	-
债券投资		8,226,482.05	9,742,497.21
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	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-

应收申购款		293.97	53,323.81
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		154,669,042.83	178,957,614.63
负债和净资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023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		26,045.26	190.00
应付赎回款		122,537.62	142,789.07
应付管理人报酬		156,264.73	179,633.80
应付托管费		13,022.04	14,969.49
应付销售服务费		950.64	1,067.73
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	69,127.68	126,595.75
负债合计		387,947.97	465,245.84
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	168,488,635.50	179,052,188.89
未分配利润	6.4.7.8	-14,207,540.64	-559,820.10
净资产合计		154,281,094.86	178,492,368.79
负债和净资产总计		154,669,042.83	178,957,614.63

注：报告截止日2024年6月30日，东兴宸祥混合A基金份额净值0.9159元，基金份额总额155,974,410.79份，东兴宸祥混合C基金份额净值0.9135元，基金份额总额12,514,224.71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：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至202 3年06月30日
一、营业总收入		-13,159,547.44	4,784,775.22
1.利息收入		1,523.65	5,417.67
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,523.65	4,917.27
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
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		-10,897,013.01	2,482,503.57
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-13,734,951.33	374,821.96
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	79,514.59	42,975.94
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	2,758,423.73	2,064,705.67
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	-2,271,648.18	2,086,389.18
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”	6.4.7.17	7,590.10	210,464.80

号填列)			
减：二、营业总支出		1,132,670.49	906,567.96
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	976,190.82	789,958.12
2.托管费	6.4.10.2.2	81,349.24	52,663.86
3.销售服务费	6.4.10.2.3	6,010.47	6,654.12
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
8.其他费用	6.4.7.19	69,119.96	57,290.06
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-14,292,217.93	3,878,207.26
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-14,292,217.93	3,878,207.26
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-14,292,217.93	3,878,207.26

6.3 净资产变动表

会计主体：东兴宸祥量化混合型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	179,052,188.89	-559,820.10	178,492,368.79
二、本期期初净资产	179,052,188.89	-559,820.10	178,492,368.79

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-10,563,553.39	-13,647,720.54	-24,211,273.93
（一）、综合收益总额	-	-14,292,217.93	-14,292,217.93
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-10,563,553.39	644,497.39	-9,919,056.00
其中：1.基金申购款	4,642,562.48	-337,618.96	4,304,943.52
2.基金赎回款	-15,206,115.87	982,116.35	-14,223,999.52
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	168,488,635.50	-14,207,540.64	154,281,094.86
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	47,086,103.06	-587,506.56	46,498,596.50
二、本期期初净资产	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	160,110,976.73	11,585,033.69	171,696,010.42

份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）			
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净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	207,197,079.79	14,875,734.39	222,072,814.18

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

黄言

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2024年6月30日的财务状况以及2024年1月1日至2024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2024年1月1日至2024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；自2023年7月24日起按前一日基金资产净值的1.20%年费率计提；

(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》、财税【2023】39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，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；自2023年8月28日起证券交易印花税实施减半征收。

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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
活期存款	233,148.58
等于：本金	233,118.25
加：应计利息	30.33
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	888,604.43
等于：本金	888,556.98
加：应计利息	47.45
减：坏账准备	-
合计	1,121,753.01

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 2024年06月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	151,225,606.71	-	145,310,367.26	-5,915,239.45	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	8,097,676.00	124,862.05	8,226,482.05	3,944.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	8,097,676.00	124,862.05	8,226,482.05	3,944.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	159,323,282.71	124,862.05	153,536,849.31	-5,911,295.45	

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 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	7.72
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	69,119.96
合计	69,127.68

注：预提费用为按日计提的审计费、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 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	165,430,353.20	165,430,353.20
本期申购	2,066,845.31	2,066,845.31
本期赎回(以“-”号填列)	-11,522,787.72	-11,522,787.72
本期末	155,974,410.79	155,974,410.79

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 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	13,621,835.69	13,621,835.69
本期申购	2,575,717.17	2,575,717.17
本期赎回（以“-”号填列）	-3,683,328.15	-3,683,328.15
本期末	12,514,224.71	12,514,224.71

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	3,704,197.92	-4,195,149.68	-490,951.76
本期期初	3,704,197.92	-4,195,149.68	-490,951.76
本期利润	-11,187,655.64	-1,990,914.68	-13,178,570.32
本期基金份额交易产生的变动数	516,739.06	28,030.01	544,769.07
其中：基金申购款	-87,521.41	-36,706.15	-124,227.56
基金赎回款	604,260.47	64,736.16	668,996.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-6,966,718.66	-6,158,034.35	-13,124,753.01

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	276,351.43	-345,219.77	-68,868.34
本期期初	276,351.43	-345,219.77	-68,868.34
本期利润	-832,914.11	-280,733.50	-1,113,647.61

本期基金份额交易产生的变动数	-32,849.25	132,577.57	99,728.32
其中：基金申购款	-168,807.34	-44,584.06	-213,391.40
基金赎回款	135,958.09	177,161.63	313,119.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-589,411.93	-493,375.70	-1,082,787.63

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年01月01日至2024年06月30日	
活期存款利息收入		580.96
定期存款利息收入		-
其他存款利息收入		851.65
结算备付金利息收入		91.04
其他		-
合计		1,523.65

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	
	2024年01月01日至2024年06月30日	
卖出股票成交总额		519,848,065.92
减：卖出股票成本总额		532,448,857.38
减：交易费用		1,134,159.87
买卖股票差价收入		-13,734,951.33

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
	2024年01月01日至2024年06月30日
债券投资收益——利息收入	85,419.03
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-5,904.44
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	79,514.59

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
	2024年01月01日至2024年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	13,874,536.79
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	13,606,942.78
减：应计利息总额	273,396.79
减：交易费用	101.66
买卖债券差价收入	-5,904.44

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 2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	2,758,423.73
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	2,758,423.73

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	-2,271,648.18
——股票投资	-2,272,154.96
——债券投资	506.78
——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	-2,271,648.18

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
基金赎回费收入	7,326.61
转换费收入	263.49

合计	7,590.10
----	----------

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
	2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	9,447.62
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
合计	69,119.96

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
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**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06 月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06 月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股 票成交总 额的比例
长江证券股份有限公司	894,695.93	0.09%	366,843,975.97	70.58%

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06 月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06 月30日	
	成交金额	占当期债券买 卖成交总额 的比例	成交金额	占当期债 券买卖成 交总额的 比例
长江证券股份有限公司	406,533.81	2.95%	12,792,637.24	100.00%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月3 0日

	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
长江证券股份有限公司	-	-	3,800,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
长江证券股份有限公司	1,391.46	0.17%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
长江证券股份有限公司	269,690.19	68.80%	-	-

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 2024年01月01日至2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	976,190.82	789,958.12
其中：应支付销售机构的客户维护费	323,778.77	253,295.79
应支付基金管理人的净管理费	652,412.05	536,662.33

注：根据基金合同以及后续修订，基金管理费在2023年7月24日前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

自2023年7月24日起按前一日基金资产净值的1.20%年费率逐日计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

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 2024年01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	81,349.24	52,663.86

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 2024年01月01日至2024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	0.00	0.00
长江证券股份有限公司	0.00	4.44	4.44
大连银行股份有限公司	0.00	529.63	529.63
东兴证券股份有限公司	0.00	1,744.57	1,744.57
合计	0.00	2,278.64	2,278.64
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	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

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 2024年01月01日 至2024年06月30 日	上年度可比期间 2023年01月01日至 2023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
报告期初持有的基金份额	14,999,000.00	14,999,000.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
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	9.62%	7.99%

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

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（2024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2024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 2024年06月3 0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							
货币资金	1,121,675.23	-	-	-	-	77.78	1,121,753.01
结算备付金	10,141.50	-	-	-	-	5.04	10,146.54
交易性金融 资产	8,101,620.00	-	-	-	-	145,435,229.31	153,536,849.31
应收申购款	-	-	-	-	-	293.97	293.97
资产总计	9,233,436.73	-	-	-	-	145,435,606.10	154,669,042.83
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	122,537.62	122,537.62
应付管理人 报酬	-	-	-	-	-	156,264.73	156,264.73
应付托管费	-	-	-	-	-	13,022.04	13,022.04
应付销售服 务费	-	-	-	-	-	950.64	950.64
其他负债	-	-	-	-	-	69,127.68	69,127.68
应付清算款	-	-	-	-	-	26,045.26	26,045.26
负债总计	-	-	-	-	-	387,947.97	387,947.97
利率敏感度	9,233,436.73	-	-	-	-	145,047,658.13	154,281,094.86

缺口							
上年度末 2023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							
货币资金	822,887.55	-	-	-	-	25.49	822,913.04
结算备付金	10,050.00	-	-	-	-	5.50	10,055.50
交易性金融资产	2,800,280.00	300,240.00	6,498,340.00	-	-	168,472,462.28	178,071,322.28
应收申购款	-	-	-	-	-	53,323.81	53,323.81
资产总计	3,633,217.55	300,240.00	6,498,340.00	-	-	168,525,817.08	178,957,614.63
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	142,789.07	142,789.07
应付清算款	-	-	-	-	-	190.00	190.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	179,633.80	179,633.80
应付托管费	-	-	-	-	-	14,969.49	14,969.49
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,067.73	1,067.73
其他负债	-	-	-	-	-	126,595.75	126,595.75
负债总计	-	-	-	-	-	465,245.84	465,245.84
利率敏感度缺口	3,633,217.55	300,240.00	6,498,340.00	-	-	168,060,571.24	178,492,368.79

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

本报告期末及上年度末，市场利率上升或下降25个基点，对本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要是市场价格风险。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 2024年06月30日		上年度末 2023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	145,310,367.26	94.19	168,328,825.07	94.31
交易性金融资产 — 基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产 — 债券投资	8,226,482.05	5.33	9,742,497.21	5.46
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	153,536,849.31	99.52	178,071,322.28	99.76

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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	业绩比较基准变动+5%	8,295,202.38	10,552,607.17

	业绩比较基准变动-5%	-8,295,202.38	-10,552,607.17
--	-------------	---------------	----------------

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，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

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	145,310,367.26	168,328,825.07
第二层次	8,226,482.05	9,742,497.21
第三层次	-	-
合计	153,536,849.31	178,071,322.28

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

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括货币资金、结算备付金、应收申购款和其他应付款项，其账面价值与公允价值相若。

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	145,310,367.26	93.95
	其中：股票	145,310,367.26	93.95
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,226,482.05	5.32
	其中：债券	8,226,482.05	5.32
	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	1,131,899.55	0.73
8	其他各项资产	293.97	0.00
9	合计	154,669,042.83	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	98,760.00	0.06
B	采矿业	2,869,426.00	1.86
C	制造业	120,241,228.85	77.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,597,095.50	1.04
E	建筑业	253,441.20	0.16
F	批发和零售业	1,281,584.44	0.83
G	交通运输、仓储和邮政业	5,133,523.00	3.33
H	住宿和餐饮业	49,308.00	0.03

I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,756,508.37	4.38
J	金融业	913,678.00	0.59
K	房地产业	21,398.84	0.01
L	租赁和商务服务业	1,372,778.00	0.89
M	科学研究和技术服务业	3,074,019.70	1.99
N	水利、环境和公共设施管理业	1,104,093.36	0.72
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	63,930.00	0.04
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	479,594.00	0.31
S	综合	-	-
	合计	145,310,367.26	94.19

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	688080	映翰通	183,465	5,564,493.45	3.61
2	002237	恒邦股份	338,100	3,891,531.00	2.52
3	603112	华翔股份	354,400	3,724,744.00	2.41
4	605158	华达新材	571,700	3,676,031.00	2.38
5	001206	依依股份	282,100	3,672,942.00	2.38
6	000404	长虹华意	624,700	3,329,651.00	2.16
7	688332	中科蓝讯	46,654	2,752,119.46	1.78
8	688601	力芯微	56,213	2,455,945.97	1.59
9	605050	福然德	271,600	2,392,796.00	1.55
10	300562	乐心医疗	259,300	2,310,363.00	1.50
11	688013	天臣医疗	150,391	2,231,802.44	1.45
12	688513	苑东生物	42,897	2,157,290.13	1.40
13	000550	江铃汽车	98,200	2,131,922.00	1.38

14	603855	华荣股份	94,300	2,084,973.00	1.35
15	603507	振江股份	63,200	2,074,224.00	1.34
16	300908	仲景食品	74,226	2,061,998.28	1.34
17	688049	炬芯科技	93,038	2,058,000.56	1.33
18	300389	艾比森	165,300	2,029,884.00	1.32
19	603151	邦基科技	175,000	2,019,500.00	1.31
20	605058	澳弘电子	98,500	1,938,480.00	1.26
21	688571	杭华股份	364,410	1,927,728.90	1.25
22	603367	辰欣药业	134,700	1,877,718.00	1.22
23	301195	北路智控	62,600	1,861,724.00	1.21
24	688551	科威尔	58,918	1,855,917.00	1.20
25	301266	宇邦新材	60,000	1,838,400.00	1.19
26	002955	鸿合科技	78,500	1,835,330.00	1.19
27	603031	安孚科技	80,400	1,815,432.00	1.18
28	301122	采纳股份	96,400	1,815,212.00	1.18
29	688616	西力科技	157,570	1,786,843.80	1.16
30	600285	羚锐制药	72,500	1,755,225.00	1.14
31	001205	盛航股份	96,000	1,551,360.00	1.01
32	603238	诺邦股份	153,300	1,526,868.00	0.99
33	601137	博威合金	99,500	1,516,380.00	0.98
34	603408	建霖家居	114,300	1,507,617.00	0.98
35	002998	优彩资源	261,100	1,480,437.00	0.96
36	000543	皖能电力	165,700	1,466,445.00	0.95
37	301096	百诚医药	24,600	1,428,768.00	0.93
38	300791	仙乐健康	55,770	1,405,404.00	0.91
39	601857	中国石油	130,000	1,341,600.00	0.87
40	603518	锦泓集团	145,100	1,276,880.00	0.83
41	300705	九典制药	45,700	1,222,018.00	0.79
42	605288	凯迪股份	39,300	1,216,728.00	0.79
43	603556	海兴电力	25,400	1,189,482.00	0.77
44	002991	甘源食品	19,600	1,188,740.00	0.77

45	000951	中国重汽	82,900	1,187,128.00	0.77
46	003017	大洋生物	70,400	1,144,704.00	0.74
47	300873	海晨股份	77,700	1,132,866.00	0.73
48	000999	华润三九	25,480	1,084,938.40	0.70
49	300898	熊猫乳品	59,600	995,916.00	0.65
50	002540	亚太科技	187,000	989,230.00	0.64
51	603611	诺力股份	56,900	969,576.00	0.63
52	603579	荣泰健康	57,750	892,815.00	0.58
53	603590	康辰药业	34,100	870,914.00	0.56
54	300643	万通智控	61,500	867,150.00	0.56
55	300674	宇信科技	76,500	847,620.00	0.55
56	301222	浙江恒威	33,600	831,936.00	0.54
57	002088	鲁阳节能	68,300	825,747.00	0.54
58	605166	聚合顺	77,700	815,073.00	0.53
59	002788	鹭燕医药	102,200	805,336.00	0.52
60	688036	传音控股	9,917	759,047.18	0.49
61	300951	博硕科技	24,280	756,322.00	0.49
62	301257	普蕊斯	25,090	708,792.50	0.46
63	002937	兴瑞科技	30,000	699,300.00	0.45
64	603300	华铁应急	127,100	693,966.00	0.45
65	002179	中航光电	17,300	658,265.00	0.43
66	000661	长春高新	6,900	633,213.00	0.41
67	688621	阳光诺和	14,778	631,020.60	0.41
68	603979	金诚信	12,400	626,572.00	0.41
69	300442	润泽科技	25,400	608,330.00	0.39
70	601878	浙商证券	55,300	592,816.00	0.38
71	688078	龙软科技	25,599	589,544.97	0.38
72	688663	新风光	24,418	568,206.86	0.37
73	600475	华光环能	64,800	564,408.00	0.37
74	603897	长城科技	31,600	554,580.00	0.36
75	301149	隆华新材	59,900	553,476.00	0.36

76	688398	赛特新材	31,074	546,280.92	0.35
77	002884	凌霄泵业	28,300	543,360.00	0.35
78	603041	美思德	50,100	501,000.00	0.32
79	688252	天德钰	34,150	496,199.50	0.32
80	001228	永泰运	22,600	476,408.00	0.31
81	603192	汇得科技	35,400	475,422.00	0.31
82	300408	三环集团	15,600	455,364.00	0.30
83	301187	欧圣电气	18,200	441,350.00	0.29
84	300832	新产业	6,500	438,360.00	0.28
85	301219	腾远钴业	11,200	428,512.00	0.28
86	688678	福立旺	38,182	413,511.06	0.27
87	300539	横河精密	51,200	412,160.00	0.27
88	688219	会通股份	47,467	368,818.59	0.24
89	301033	迈普医学	9,400	367,634.00	0.24
90	603600	永艺股份	35,100	366,444.00	0.24
91	003041	真爱美家	29,700	362,637.00	0.24
92	603697	有友食品	60,500	350,900.00	0.23
93	605577	龙版传媒	22,500	349,425.00	0.23
94	300002	神州泰岳	42,300	343,476.00	0.22
95	002978	安宁股份	11,700	325,962.00	0.21
96	603903	中持股份	44,000	308,440.00	0.20
97	688226	威腾电气	17,540	306,599.20	0.20
98	300884	狄耐克	34,700	299,114.00	0.19
99	688772	珠海冠宇	16,692	248,710.80	0.16
100	002623	亚玛顿	14,900	247,787.00	0.16
101	688389	普门科技	14,821	240,989.46	0.16
102	688239	航宇科技	6,903	240,224.40	0.16
103	003028	振邦智能	6,400	230,784.00	0.15
104	300545	联得装备	8,800	216,040.00	0.14
105	688117	圣诺生物	8,782	215,510.28	0.14
106	000403	派林生物	8,000	213,280.00	0.14

107	002801	微光股份	11,100	210,456.00	0.14
108	002580	圣阳股份	33,900	208,485.00	0.14
109	603206	嘉环科技	16,500	208,395.00	0.14
110	603059	倍加洁	10,500	207,270.00	0.13
111	601728	中国电信	33,600	206,640.00	0.13
112	600482	中国动力	10,600	206,488.00	0.13
113	002027	分众传媒	33,400	202,404.00	0.13
114	300824	北鼎股份	27,900	202,275.00	0.13
115	300388	节能国祯	36,400	201,656.00	0.13
116	301208	中亦科技	7,320	200,275.20	0.13
117	688213	思特威	4,010	194,485.00	0.13
118	300265	通光线缆	27,800	194,044.00	0.13
119	688550	瑞联新材	8,315	192,824.85	0.12
120	300532	今天国际	15,500	190,495.00	0.12
121	300980	祥源新材	12,000	189,120.00	0.12
122	300618	寒锐钴业	7,000	185,150.00	0.12
123	603676	卫信康	22,800	182,628.00	0.12
124	600573	惠泉啤酒	20,800	182,208.00	0.12
125	688120	华海清科	961	182,186.38	0.12
126	002737	葵花药业	7,600	177,688.00	0.12
127	688656	浩欧博	7,734	177,340.62	0.11
128	605377	华旺科技	13,300	176,225.00	0.11
129	300298	三诺生物	6,900	174,846.00	0.11
130	002401	中远海科	11,700	174,798.00	0.11
131	688419	耐科装备	5,719	171,112.48	0.11
132	002697	红旗连锁	36,500	168,995.00	0.11
133	688123	聚辰股份	2,754	167,525.82	0.11
134	601958	金钼股份	16,000	166,560.00	0.11
135	688002	睿创微纳	5,880	164,463.60	0.11
136	300842	帝科股份	4,200	162,960.00	0.11
137	300433	蓝思科技	8,800	160,600.00	0.10

138	300919	中伟股份	5,180	160,528.20	0.10
139	301156	美农生物	13,040	159,348.80	0.10
140	688138	清溢光电	7,389	158,863.50	0.10
141	300457	赢合科技	8,900	158,687.00	0.10
142	002823	凯中精密	13,000	158,600.00	0.10
143	002056	横店东磁	12,600	157,122.00	0.10
144	688283	坤恒顺维	4,555	156,600.90	0.10
145	603583	捷昌驱动	7,600	154,888.00	0.10
146	603909	建发合诚	18,500	153,920.00	0.10
147	002155	湖南黄金	8,500	153,850.00	0.10
148	603093	南华期货	17,700	153,282.00	0.10
149	688475	萤石网络	4,491	153,188.01	0.10
150	002860	星帅尔	18,700	153,153.00	0.10
151	600066	宇通客车	5,900	152,220.00	0.10
152	300407	凯发电气	20,000	152,000.00	0.10
153	000768	中航西飞	6,300	151,389.00	0.10
154	600941	中国移动	1,400	150,500.00	0.10
155	002381	双箭股份	22,000	147,620.00	0.10
156	000552	甘肃能化	41,200	142,964.00	0.09
157	688401	路维光电	5,353	140,248.60	0.09
158	301297	富乐德	6,900	140,139.00	0.09
159	002782	可立克	12,500	138,500.00	0.09
160	002264	新华都	27,100	138,481.00	0.09
161	002138	顺络电子	4,900	134,554.00	0.09
162	301003	江苏博云	6,200	133,362.00	0.09
163	688618	三旺通信	5,316	133,059.48	0.09
164	600875	东方电气	7,200	132,840.00	0.09
165	603225	新凤鸣	8,400	130,956.00	0.08
166	688379	华光新材	9,458	129,669.18	0.08
167	300866	安克创新	1,820	129,602.20	0.08
168	600750	江中药业	5,500	127,105.00	0.08

169	301278	快可电子	3,900	126,828.00	0.08
170	603158	腾龙股份	18,000	126,720.00	0.08
171	000922	佳电股份	10,600	126,458.00	0.08
172	002275	桂林三金	10,100	125,341.00	0.08
173	300782	卓胜微	1,600	124,384.00	0.08
174	300997	欢乐家	10,500	124,110.00	0.08
175	300017	网宿科技	15,400	121,660.00	0.08
176	001207	联科科技	8,357	121,343.64	0.08
177	002484	江海股份	9,100	120,575.00	0.08
178	601555	东吴证券	20,400	120,360.00	0.08
179	603939	益丰药房	4,800	117,840.00	0.08
180	300743	天地数码	8,500	115,090.00	0.07
181	002375	亚厦股份	35,200	114,400.00	0.07
182	000090	天健集团	28,300	113,766.00	0.07
183	300922	天秦装备	8,700	113,013.00	0.07
184	300105	龙源技术	17,200	111,112.00	0.07
185	688636	智明达	4,856	110,716.80	0.07
186	300909	汇创达	4,900	109,466.00	0.07
187	601098	中南传媒	8,800	109,296.00	0.07
188	002732	燕塘乳业	7,500	108,525.00	0.07
189	603290	斯达半导	1,260	108,498.60	0.07
190	300789	唐源电气	8,190	108,435.60	0.07
191	000960	锡业股份	7,000	108,430.00	0.07
192	001218	丽臣实业	7,094	106,197.18	0.07
193	000933	神火股份	5,200	105,196.00	0.07
194	003036	泰坦股份	13,100	104,669.00	0.07
195	301085	亚康股份	2,500	103,800.00	0.07
196	603439	贵州三力	8,100	103,356.00	0.07
197	600697	欧亚集团	10,200	102,510.00	0.07
198	603309	维力医疗	9,300	102,393.00	0.07
199	605088	冠盛股份	4,900	102,116.00	0.07

200	605169	洪通燃气	12,800	100,352.00	0.07
201	600097	开创国际	12,000	98,760.00	0.06
202	688503	聚和材料	3,513	98,715.30	0.06
203	000737	北方铜业	10,500	97,440.00	0.06
204	603369	今世缘	2,100	97,020.00	0.06
205	688448	磁谷科技	5,032	95,004.16	0.06
206	301319	唯特偶	3,145	94,444.35	0.06
207	600446	金证股份	9,500	94,335.00	0.06
208	603725	天安新材	15,120	93,895.20	0.06
209	688819	天能股份	3,929	93,745.94	0.06
210	000100	TCL科技	21,200	91,584.00	0.06
211	600312	平高电气	4,600	89,470.00	0.06
212	300900	广联航空	4,760	89,154.80	0.06
213	000807	云铝股份	5,500	74,305.00	0.05
214	603170	宝立食品	6,100	72,468.00	0.05
215	603187	海容冷链	6,000	69,960.00	0.05
216	601579	会稽山	6,300	64,512.00	0.04
217	605098	行动教育	1,500	63,930.00	0.04
218	605189	富春染织	5,900	62,894.00	0.04
219	600729	重庆百货	2,700	60,372.00	0.04
220	603829	洛凯股份	4,800	56,784.00	0.04
221	600489	中金黄金	3,800	56,240.00	0.04
222	000935	四川双马	4,500	54,045.00	0.04
223	002519	银河电子	10,500	51,555.00	0.03
224	603739	蔚蓝生物	3,800	49,096.00	0.03
225	001308	康冠科技	2,100	47,250.00	0.03
226	002983	芯瑞达	2,759	45,937.35	0.03
227	688510	航亚科技	2,440	44,920.40	0.03
228	605108	同庆楼	2,100	44,856.00	0.03
229	003038	鑫铂股份	2,980	44,014.60	0.03
230	603993	洛阳钼业	5,100	43,350.00	0.03

231	688395	正弦电气	2,995	42,678.75	0.03
232	688084	晶品特装	955	41,733.50	0.03
233	605123	派克新材	700	39,326.00	0.03
234	688273	麦澜德	1,948	38,570.40	0.03
235	688687	凯因科技	1,417	36,147.67	0.02
236	600794	保税科技	11,300	35,821.00	0.02
237	600420	国药现代	2,600	27,768.00	0.02
238	605259	绿田机械	1,420	27,704.20	0.02
239	300915	海融科技	900	23,526.00	0.02
240	603506	南都物业	2,400	20,112.00	0.01
241	300435	中泰股份	1,700	20,009.00	0.01
242	002615	哈尔斯	3,200	19,840.00	0.01
243	688682	霍莱沃	629	18,454.86	0.01
244	603989	艾华集团	1,300	18,278.00	0.01
245	300589	江龙船艇	1,500	17,820.00	0.01
246	603320	迪贝电气	1,200	16,968.00	0.01
247	603201	常润股份	700	16,940.00	0.01
248	688679	通源环境	2,366	16,467.36	0.01
249	300703	创源股份	1,900	15,352.00	0.01
250	603102	百合股份	500	15,055.00	0.01
251	688599	天合光能	812	13,739.04	0.01
252	300925	法本信息	1,300	13,117.00	0.01
253	605338	巴比食品	900	11,925.00	0.01
254	688566	吉贝尔	491	11,047.50	0.01
255	300628	亿联网络	300	11,031.00	0.01
256	003020	立方制药	600	10,968.00	0.01
257	002600	领益智造	1,500	10,680.00	0.01
258	000878	云南铜业	800	9,968.00	0.01
259	601921	浙版传媒	1,300	9,932.00	0.01
260	601600	中国铝业	1,300	9,919.00	0.01
261	688087	英科再生	382	9,886.16	0.01

262	300775	三角防务	300	9,180.00	0.01
263	300696	爱乐达	500	8,875.00	0.01
264	002508	老板电器	400	8,840.00	0.01
265	688018	乐鑫科技	88	8,683.84	0.01
266	002483	润邦股份	1,900	8,569.00	0.01
267	600480	凌云股份	800	7,864.00	0.01
268	603508	思维列控	400	7,500.00	0.00
269	300890	翔丰华	300	7,485.00	0.00
270	300319	麦捷科技	800	7,464.00	0.00
271	688046	药康生物	730	7,460.60	0.00
272	600060	海信视像	300	7,422.00	0.00
273	002987	京北方	700	7,371.00	0.00
274	688786	悦安新材	251	7,351.79	0.00
275	000885	城发环境	600	7,302.00	0.00
276	300796	贝斯美	500	7,235.00	0.00
277	605339	南侨食品	500	7,110.00	0.00
278	300629	新劲刚	400	7,064.00	0.00
279	600483	福能股份	600	6,996.00	0.00
280	601808	中海油服	400	6,880.00	0.00
281	601186	中国铁建	800	6,856.00	0.00
282	300133	华策影视	1,100	6,754.00	0.00
283	601218	吉鑫科技	2,400	6,696.00	0.00
284	002885	京泉华	620	6,683.60	0.00
285	600901	江苏金租	1,300	6,565.00	0.00
286	002922	伊戈尔	300	6,558.00	0.00
287	002773	康弘药业	300	6,495.00	0.00
288	600018	上港集团	1,100	6,358.00	0.00
289	002409	雅克科技	100	6,291.00	0.00
290	300413	芒果超媒	300	6,270.00	0.00
291	002384	东山精密	300	6,210.00	0.00
292	000948	南天信息	500	6,175.00	0.00

293	300987	川网传媒	500	6,070.00	0.00
294	300627	华测导航	200	5,970.00	0.00
295	688508	芯朋微	164	5,964.68	0.00
296	603191	望变电气	400	5,920.00	0.00
297	601618	中国中冶	1,900	5,890.00	0.00
298	600271	航天信息	800	5,888.00	0.00
299	300815	玉禾田	500	5,820.00	0.00
300	600727	鲁北化工	900	5,670.00	0.00
301	603003	*ST龙宇	1,200	5,640.00	0.00
302	300845	捷安高科	520	5,631.60	0.00
303	600104	上汽集团	400	5,544.00	0.00
304	300200	高盟新材	700	5,446.00	0.00
305	603339	四方科技	600	5,442.00	0.00
306	300963	中洲特材	500	5,380.00	0.00
307	600284	浦东建设	1,000	5,340.00	0.00
308	000153	丰原药业	980	5,272.40	0.00
309	600456	宝钛股份	200	5,106.00	0.00
310	600918	中泰证券	900	5,103.00	0.00
311	300383	光环新网	600	5,070.00	0.00
312	300955	嘉亨家化	400	5,068.00	0.00
313	300634	彩讯股份	300	5,049.00	0.00
314	601669	中国电建	900	5,031.00	0.00
315	000156	华数传媒	800	5,024.00	0.00
316	603045	福达合金	500	4,965.00	0.00
317	688579	山大地纬	628	4,929.80	0.00
318	600267	海正药业	700	4,914.00	0.00
319	300504	天邑股份	400	4,876.00	0.00
320	000507	珠海港	1,100	4,873.00	0.00
321	600522	中天科技	300	4,755.00	0.00
322	605337	李子园	476	4,674.32	0.00
323	002120	韵达股份	600	4,644.00	0.00

324	300443	金雷股份	300	4,599.00	0.00
325	301026	浩通科技	200	4,592.00	0.00
326	603878	武进不锈	700	4,578.00	0.00
327	300726	宏达电子	200	4,560.00	0.00
328	600351	亚宝药业	800	4,488.00	0.00
329	601007	金陵饭店	700	4,452.00	0.00
330	600216	浙江医药	400	4,392.00	0.00
331	301063	海锅股份	300	4,302.00	0.00
332	603178	圣龙股份	200	4,286.00	0.00
333	000869	张裕A	200	4,270.00	0.00
334	600637	东方明珠	700	4,256.00	0.00
335	002020	京新药业	400	4,188.00	0.00
336	600999	招商证券	300	4,173.00	0.00
337	601318	中国平安	100	4,136.00	0.00
338	688559	海目星	124	4,078.36	0.00
339	601825	沪农商行	600	4,032.00	0.00
340	603589	口子窖	100	3,919.00	0.00
340	603259	药明康德	100	3,919.00	0.00
342	301093	华兰股份	200	3,852.00	0.00
343	603215	比依股份	300	3,837.00	0.00
344	300224	正海磁材	400	3,704.00	0.00
345	605266	健之佳	140	3,633.00	0.00
346	600269	赣粤高速	700	3,619.00	0.00
347	002839	张家港行	900	3,618.00	0.00
348	600967	内蒙一机	500	3,600.00	0.00
349	603527	众源新材	500	3,550.00	0.00
350	603368	柳药集团	200	3,500.00	0.00
351	600985	淮北矿业	200	3,348.00	0.00
352	002322	理工能科	200	3,204.00	0.00
353	603228	景旺电子	100	3,180.00	0.00
354	600566	济川药业	100	3,171.00	0.00

355	601375	中原证券	900	3,069.00	0.00
356	601838	成都银行	200	3,038.00	0.00
357	688121	卓然股份	242	2,908.84	0.00
358	688456	有研粉材	109	2,907.03	0.00
359	605090	九丰能源	100	2,900.00	0.00
360	603366	日出东方	800	2,856.00	0.00
361	601609	金田股份	500	2,830.00	0.00
362	600745	闻泰科技	100	2,825.00	0.00
363	600685	中船防务	100	2,790.00	0.00
364	600854	春兰股份	800	2,736.00	0.00
365	603220	中贝通信	100	2,716.00	0.00
366	002899	英派斯	200	2,634.00	0.00
367	688106	金宏气体	148	2,592.96	0.00
368	002394	联发股份	400	2,464.00	0.00
369	601528	瑞丰银行	500	2,360.00	0.00
369	002345	潮宏基	500	2,360.00	0.00
371	603203	快克智能	100	2,358.00	0.00
372	301006	迈拓股份	200	2,338.00	0.00
373	603755	日辰股份	100	2,313.00	0.00
374	301106	骏成科技	80	2,300.00	0.00
375	600958	东方证券	300	2,280.00	0.00
376	603657	春光科技	200	2,278.00	0.00
377	600196	复星医药	100	2,214.00	0.00
378	603799	华友钴业	100	2,213.00	0.00
379	688006	杭可科技	125	2,181.25	0.00
380	002438	江苏神通	200	2,162.00	0.00
381	603156	养元饮品	100	2,127.00	0.00
382	002605	姚记科技	100	2,042.00	0.00
383	002752	昇兴股份	400	2,024.00	0.00
384	002202	金风科技	300	2,016.00	0.00
385	002429	兆驰股份	400	1,924.00	0.00

386	601607	上海医药	100	1,911.00	0.00
387	600559	老白干酒	100	1,818.00	0.00
388	601169	北京银行	300	1,752.00	0.00
389	603096	新经典	100	1,690.00	0.00
390	688132	邦彦技术	95	1,648.25	0.00
391	603185	弘元绿能	96	1,640.64	0.00
392	600741	华域汽车	100	1,638.00	0.00
393	605277	新亚电子	120	1,550.40	0.00
394	002843	泰嘉股份	100	1,531.00	0.00
395	300181	佐力药业	100	1,512.00	0.00
396	601811	新华文轩	100	1,401.00	0.00
397	603690	至纯科技	60	1,380.60	0.00
398	600582	天地科技	200	1,378.00	0.00
399	603456	九洲药业	100	1,372.00	0.00
400	601211	国泰君安	100	1,355.00	0.00
401	600459	贵研铂业	100	1,351.00	0.00
402	002085	万丰奥威	100	1,324.00	0.00
403	600926	杭州银行	100	1,305.00	0.00
404	603681	永冠新材	100	1,275.00	0.00
405	688125	安达智能	38	1,186.36	0.00
406	688689	银河微电	55	1,167.65	0.00
407	603050	科林电气	48	1,164.48	0.00
408	688329	艾隆科技	77	1,144.22	0.00
409	600061	国投资本	200	1,130.00	0.00
410	002459	晶澳科技	100	1,120.00	0.00
411	601928	凤凰传媒	100	1,096.00	0.00
412	002702	海欣食品	300	1,080.00	0.00
413	603165	荣晟环保	100	1,062.00	0.00
414	600479	千金药业	100	1,017.00	0.00
415	600873	梅花生物	100	1,002.00	0.00
416	300723	一品红	50	982.50	0.00

417	601918	新集能源	100	975.00	0.00
418	603926	铁流股份	100	830.00	0.00
419	600557	康缘药业	52	816.40	0.00
420	600059	古越龙山	100	794.00	0.00
421	688677	海泰新光	20	784.60	0.00
422	605167	利柏特	100	781.00	0.00
423	600879	航天电子	100	777.00	0.00
424	603889	新澳股份	100	774.00	0.00
425	688589	力合微	30	756.30	0.00
426	600109	国金证券	100	755.00	0.00
427	601229	上海银行	100	726.00	0.00
428	601006	大秦铁路	100	716.00	0.00
429	600223	福瑞达	100	707.00	0.00
430	600019	宝钢股份	100	665.00	0.00
431	601390	中国中铁	100	652.00	0.00
432	600325	华发股份	100	650.00	0.00
433	600007	中国国贸	29	636.84	0.00
434	300034	钢研高纳	40	635.60	0.00
435	600356	恒丰纸业	100	592.00	0.00
436	600583	海油工程	100	591.00	0.00
437	603233	大参林	40	572.00	0.00
438	688257	新锐股份	36	551.88	0.00
439	002829	星网宇达	40	535.60	0.00
440	600497	驰宏锌锗	100	534.00	0.00
441	600908	无锡银行	100	532.00	0.00
442	300232	洲明科技	100	522.00	0.00
443	600219	南山铝业	133	506.73	0.00
444	601077	渝农商行	100	502.00	0.00
445	600282	南钢股份	100	498.00	0.00
446	600039	四川路桥	60	473.40	0.00
447	002249	大洋电机	100	473.00	0.00

448	601000	唐山港	100	470.00	0.00
449	600839	四川长虹	100	449.00	0.00
450	600572	康恩贝	100	447.00	0.00
451	000166	申万宏源	100	431.00	0.00
452	000060	中金岭南	100	424.00	0.00
453	000544	中原环保	50	393.50	0.00
454	688181	八亿时空	20	379.00	0.00
455	600369	西南证券	100	358.00	0.00
456	002929	润建股份	12	349.32	0.00
457	688217	睿昂基因	17	335.58	0.00
458	002873	新天药业	40	332.00	0.00
459	600998	九州通	63	307.44	0.00
460	688391	钜泉科技	10	291.70	0.00
461	688092	爱科科技	13	277.55	0.00
462	605287	德才股份	20	251.80	0.00
463	601388	怡球资源	100	219.00	0.00
464	300453	三鑫医疗	30	191.70	0.00
465	688468	科美诊断	27	170.91	0.00
466	688093	世华科技	9	163.53	0.00
467	688309	恒誉环保	9	107.91	0.00
468	688358	祥生医疗	3	77.91	0.00
469	688314	康拓医疗	3	56.46	0.00
470	688223	晶科能源	7	49.70	0.00
471	688100	威胜信息	1	38.15	0.00
472	688312	燕麦科技	1	24.25	0.00
473	688722	同益中	2	22.38	0.00
474	688711	宏微科技	1	16.06	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	000550	江铃汽车	6,542,211.00	3.67
2	003041	真爱美家	6,369,585.00	3.57
3	688080	映翰通	6,173,655.93	3.46
4	002237	恒邦股份	6,080,973.00	3.41
5	688601	力芯微	5,099,211.78	2.86
6	603579	荣泰健康	4,709,708.00	2.64
7	605158	华达新材	4,672,202.00	2.62
8	688618	三旺通信	4,533,211.60	2.54
9	688513	苑东生物	4,374,752.83	2.45
10	688332	中科蓝讯	4,216,681.93	2.36
11	603590	康辰药业	4,144,963.00	2.32
12	002540	亚太科技	4,087,464.00	2.29
13	000404	长虹华意	4,023,422.00	2.25
14	003038	鑫铂股份	4,016,169.00	2.25
15	603112	华翔股份	3,991,108.00	2.24
16	000999	华润三九	3,852,407.00	2.16
17	000951	中国重汽	3,781,834.00	2.12
18	601579	会稽山	3,714,500.00	2.08
19	605169	洪通燃气	3,673,403.00	2.06
20	601728	中国电信	3,556,153.00	1.99

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	603579	荣泰健康	6,406,211.40	3.59
2	003041	真爱美家	6,090,482.00	3.41
3	601857	中国石油	5,868,910.00	3.29
4	601579	会稽山	4,587,249.00	2.57
5	688618	三旺通信	4,573,794.81	2.56
6	003038	鑫铂股份	4,530,715.40	2.54
7	688589	力合微	4,520,421.69	2.53
8	600642	申能股份	4,087,623.00	2.29
9	688419	耐科装备	3,764,209.12	2.11
10	600060	海信视像	3,691,813.00	2.07
11	601555	东吴证券	3,636,623.00	2.04
12	002237	恒邦股份	3,611,393.00	2.02
13	601728	中国电信	3,583,900.00	2.01
14	002155	湖南黄金	3,582,897.00	2.01
15	605169	洪通燃气	3,526,927.00	1.98
16	301222	浙江恒威	3,429,809.00	1.92
17	000550	江铃汽车	3,409,429.00	1.91
18	688283	坤恒顺维	3,220,687.67	1.80
19	688401	路维光电	3,201,463.35	1.79
20	002027	分众传媒	3,200,379.00	1.79

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	511,702,554.53
卖出股票收入（成交）总额	519,848,065.92

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	8,226,482.05	5.33
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	8,226,482.05	5.33

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	019709	23国债16	81,000	8,226,482.05	5.33
2	-	-	-	-	-
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

本基金本报告期内未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

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本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2

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	293.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	293.97

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	2,152	72,478.82	123,784,626.59	79.36%	32,189,784.20	20.64%
东兴宸祥量化混合C	563	22,227.75	0.00	0.00%	12,514,224.71	100.00%
合计	2,715	62,058.43	123,784,626.59	73.47%	44,704,008.91	26.53%

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	383,236.37	0.25%
	东兴宸祥量化混合C	5,791.38	0.05%
	合计	389,027.75	0.23%

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	东兴宸祥量化混合A	0~10
	东兴宸祥量化混合C	0

责人持有本开放式基金	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	东兴宸祥量化混合A	10~50
	东兴宸祥量化混合C	0
	合计	10~50

§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	165,430,353.20	13,621,835.69
本报告期基金总申购份额	2,066,845.31	2,575,717.17
减：本报告期基金总赎回份额	11,522,787.72	3,683,328.15
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	155,974,410.79	12,514,224.71

§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，基金管理人的重大人事变动：（1）经本公司股东2024年4月决定，鉴于本公司第一届董事会到期换届的具体情况，周利国先生、聂辉华先生、李秀兰女士不再担任本公司独立董事。本公司第二届董事会成员为牛南洁先生、刘亮先生、张锋先生、郝洁女士、刘天先生、刘煜辉先生、安保和先生、岳克胜先生；（2）经本公司股东2024年5月决定，刘煜辉先生不再担任本公司独立董事职务，同意聘任何帆先生为本公司独立董事；委派黄言先生担任本公司董事。

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	894,695.93	0.09%	1,391.46	0.17%	-
东方财富证券股份有限公司	2	227,984,554.67	22.10%	166,011.49	20.54%	-
华西证券股份有限公司	2	802,671,369.85	77.81%	640,786.33	79.29%	-

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、合规风控能力和交易、研究等服务实力较强的证券公司参与证券交易。其中财务状况良好、经营行为规范指最近一年证券公司分类评级在C类或C类以上；合规风控能力是指证券公司近三年无重大违法违规行为、无正在接受立案调查，或受到监管机构严重处罚，责令改正逾期未改，影响正常经营等情形；交易、研究实力较强以公司交易部门、投资部门、研究部及投研分管领导的评价意见为主要判断依据。

券商选择程序：公司根据以上标准对不同证券公司进行考察、选择和确定。在满足证券公司选择标准的前提下，公司应当与提供证券交易服务的证券公司签订委托协议，约定双方的权利义务，明确服务内容、收取交易佣金的价格标准与计算方式。证券公司的选择由研究部发起，由合规法律部对选择标准、选择程序是否符合法规及本制度规定进行初步合规审查后，报督察长进行合规性审查和总经理审批，公司与其建立合作关系并签署委托协议。

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
长江证券股份有限公司	406,533.81	2.95%	-	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	101,755.78	0.74%	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	13,292,215.80	96.32%	-	-	-	-	-	-

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	东兴基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示	指定网站	2024-01-15
2	东兴宸祥量化混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2024年第1号）	指定网站	2024-01-18
3	东兴宸祥量化混合型证券投资基金产品资料概要更新	指定网站	2024-01-18
4	东兴宸祥量化混合型证券投资基金2023年第4季度报告	指定网站	2024-01-19
5	东兴基金管理有限公司旗下全部基金2023年第四季度报告提示性公告	指定报刊、指定网站	2024-01-19
6	东兴宸祥量化混合型证券投资基金2023年年度报告	指定网站	2024-03-29
7	东兴基金管理有限公司旗下全	指定报刊、指定网站	2024-03-29

	部基金2023年年度报告提示性公告		
8	东兴宸祥量化混合型证券投资基金2024年第1季度报告	指定网站	2024-04-19
9	东兴基金管理有限公司旗下全部基金2024年第一季度报告提示性公告	指定报刊、指定网站	2024-04-19
10	东兴基金管理有限公司关于董事变更的公告	指定报刊、指定网站	2024-04-27
11	东兴基金管理有限公司关于董事变更的公告	指定报刊、指定网站	2024-05-24
12	东兴宸祥量化混合型证券投资基金产品资料概要更新	指定网站	2024-06-19

§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	2024年1月1日-2024年6月30日	35,928,321.21	-	-	35,928,321.21	21.32%
	2	2024年1月1日-2024年6月30日	72,857,305.38	-	-	72,857,305.38	43.24%

产品特有风险

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

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

3、本基金可投资股指期货，股指期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，指数微小的变动就可能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。

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

5、本基金投资股票期权，可能引发如下风险：股票期权作为一种金融衍生品，具备一些特有的风险点。投资股票期权所面临的主要风险是衍生品价格波动带来的市场风险；衍生品基础资产交易量大于市场可报价的交易量而产生的流动性风

险；衍生品合约价格和标的指数价格之间的价格差的波动而造成基差风险；无法及时筹措资金满足建立或者维持衍生品合约头寸所要求的保证金而带来的保证金风险；交易对手不愿或无法履行契约而产生的信用风险以及各类操作风险。

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

北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座15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
二〇二四年八月三十日