

兴银丰运稳益回报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:兴银基金管理有限责任公司

基金托管人:中国民生银行股份有限公司

报告送出日期: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及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年8月29日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年1月1日起至6月30日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录.....	2
§ 2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
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
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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	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	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
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	46
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	46
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	46
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	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47

7.12 投资组合报告附注	47
§ 8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
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	49
§ 9 开放式基金份额变动	49
§ 10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议	50
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	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
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	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
10.8 其他重大事件	52
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	53
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	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	53
§ 12 备查文件目录	53
12.1 备查文件目录	53
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴银丰运稳益回报混合型证券投资基金	
基金简称	兴银丰运稳益回报混合	
基金主代码	009205	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 05 月 21 日	
基金管理人	兴银基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	302,727,038.51 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	兴银丰运稳益回报混合 A	兴银丰运稳益回报混合 C
下属分级基金的交易代码	009205	009206
报告期末下属分级基金的份 额总额	135,928,651.09 份	166,798,387.42 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，力争获得长期稳定的投资收益。	
投资策略	本基金通过对宏观经济发展趋势、政策面、金融市场利率及市场情绪等方面的分析和预测，综合运用资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、股指期货投资策略及资产支持证券投资策略，力争实现基金资产的长期稳健增值。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×30%+中证综合债指数收益率×70%	
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金，通常预期风险与预期收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。	
	兴银丰运稳益回报混合 A	兴银丰运稳益回报混合 C
下属分级基金的风险收益特征	风险收益特征同上。	风险收益特征同上。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	兴银基金管理有限责任公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露负 责人	姓名	吴真子
	联系电话	86-21-20296358
	电子邮箱	wzz@hffunds.cn
客户服务电话	40000-96326	95568
传真	86-21-68630069	010-57093382

注册地址	平潭综合实验区金井湾商务营运中心 6 号楼 11 层 03-3 房	北京市西城区复兴门内大街 2 号
办公地址	中国上海市浦东新区滨江大道 5129 号陆家嘴滨江中心 N1 幢三层、五层	北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码	200120	100031
法定代表人	吴若曼	高迎欣

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2024 年 01 月 01 日-2024 年 06 月 30 日）	
	兴银丰运稳益回报混合 A	兴银丰运稳益回报混合 C
本期已实现收益	-4,663,484.75	-6,153,895.71
本期利润	-2,961,374.14	-4,288,130.46
加权平均基金份额本期利润	-0.0203	-0.0225
本期加权平均净值利润率	-1.65%	-1.84%
本期基金份额净值增长率	-1.48%	-1.53%
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	25,816,955.44	30,397,924.92
期末可供分配基金份额利润	0.1899	0.1822
期末基金资产净值	166,603,403.12	203,143,187.04
期末基金份额净值	1.2257	1.2179
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	22.57%	21.79%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴银丰运稳益回报混合 A 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-2.41%	0.59%	-0.39%	0.14%	-2.02%	0.45%
过去三个月	-0.83%	0.63%	0.60%	0.21%	-1.43%	0.42%
过去六个月	-1.48%	0.75%	3.08%	0.26%	-4.56%	0.49%
过去一年	-5.81%	0.62%	1.14%	0.25%	-6.95%	0.37%
过去三年	5.10%	0.55%	-1.19%	0.31%	6.29%	0.24%
自基金合同生效起至今	22.57%	0.52%	9.42%	0.33%	13.15%	0.19%

兴银丰运稳益回报混合 C 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-2.42%	0.59%	-0.39%	0.14%	-2.03%	0.45%
过去三个月	-0.86%	0.63%	0.60%	0.21%	-1.46%	0.42%
过去六个月	-1.53%	0.75%	3.08%	0.26%	-4.61%	0.49%
过去一年	-5.90%	0.62%	1.14%	0.25%	-7.04%	0.37%
过去三年	4.78%	0.55%	-1.19%	0.31%	5.97%	0.24%
自基金合同生效起至今	21.79%	0.52%	9.42%	0.33%	12.37%	0.19%

注：1、本基金成立于 2020 年 5 月 21 日；2、比较基准：中证综合债指数收益率*70%+沪深 300 指数收益率*30%。

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2020年05月21日-2024年06月30日)



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2020年05月21日-2024年06月30日)



注：1、本基金成立于 2020 年 5 月 21 日；2、比较基准：中证综合债指数收益率*70%+沪深 300 指数收益率*30%。

3.3 其他指标

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至报告期末，本公司管理 53 只公开募集证券投资基金，净值总规模超 1200 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
袁作栋	本基金的基金经理、公司权益投资部总经理兼研究发展部指定负责人	2020-05-21	-	12 年	硕士研究生，具有基金从业资格。历任中兴通讯股份有限公司硬件工程师、商务总监，浙商基金管理有限公司投资研究部行业研究员，华夏久盈资产管理有限责任公司权益投资中心高级研究员（独立管理账户）。2019 年 6 月加入兴银基金管理有限责任公司，历任研究发展部行业研究员，权益投资部基金经理，资产配置部副总经理（主持工作），现任权益投资部总经理、基金经理，兼任研究发展部指定负责人。

注：1、任职日期和离任日期一般情况下指公司做出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

作为一只偏债混合基金，基于对当前资本市场的看好，我们建立了较高的股票仓位和低价可转债仓位。

2024 年上半年，上证指数总体走平，红利指数一枝独秀。我们均衡的资产配置思路，按照性价比的原则，当前时点没有参与红利，所以我们的基金净值面临一定的压力。虽然我们持仓的品种大部分具有良好的安全边际，回调过程就像弹簧被压缩，性价比越来越高，我们对于自己的组合有着充足的信心，但是我们也在反思，红利风格是一种短期的市场情绪，还是从投资本质上看是性价比很高的资产，尤其是港股的深度价值股票。

我们持仓中的科技部分，给组合带来一定的压力，我们选择个股具有一定 Alpha，一定程度上缓解了行业向下 Beta 的压力。随着人工智能在应用端持续落地，预计未来一段时间 AI PC 和 AI 手机可能会带来一轮换机潮，从给周期底部的电子行业带来良好的业绩弹性，以存储芯片为代表的半导体价格已经进入到涨价周期，我们持续积极挖掘、投资。

消费部分我们看好消费转型带来的投资机会。国产化妆品在这个过程中，受益于内容电商的渠道红利，以及对于中高端价格带化妆品的平替，有良好的发展机遇，我们也在持续的研究、思考，化妆品行业当前竞争格局不稳定，竞争要素多，什么样的化妆品公司才能成为中国的欧莱雅。

产能出海和品牌出海是一个宏观层面的投资机会，这也是我国高质量发展的新阶段。只有那些具备全球化运营能力，布局较早，产品力突出的优秀企业才能在国际化的时代进一步成长。汽车、家居、化工 很多行业都在抓住机遇进行全球化布局，我们也在优中选优。

资源类的投资机会，我们也在认真考虑，对于锂、稀土也做了一些尝试。虽然商品价格和个股距离高点的回调幅度已经很大了，但是我们通过对于底部利润、超额利润等测算还没有能够找到很

好的寻找到安全边际。我们继续努力挖掘。

我们股债平衡类产品均持有高仓位的低价转债。2024 年上半年转债市场在信用冲击之下，价格低于 100 元的转债持续增加，转债市场的性价比越来越高。跟过去有所不同的是，我们需要正视转债的信用风险，我们的研究必须深入，投资必须严谨。我们认为转债市场还是处在周期的低位，未来仍然大有可为。我们对于自己的相关产品具有很高的信心，提请各位投资者，尤其是机构投资者关注。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴银丰运稳益回报混合 A 基金份额净值为 1.2257 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.48%，同期业绩比较基准收益率为 3.08%；截至报告期末兴银丰运稳益回报混合 C 基金份额净值为 1.2179 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.53%，同期业绩比较基准收益率为 3.08%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，经济新常态和“百年未有之大变局”将成为中国经济的主基调，我们投资的宏观背景也从高速成长的经济体转变为经济新常态下的可持续发展。我们对于估值方法也要兼顾看未来的增长以及当前可持续的股息回报。三中全会指明了经济发展的方向，后续一系列政策的持续推出，让我们对于中国经济充满信心，看好如下几个方向。

第一个方向是新质生产力。当前处于人工智能变革的过程中，随着大模型能力的持续提升，2024 年下半年我们就会看到 AI 服务器、AI PC 和 AI 手机的放量，2025 年之后我们将看到人形机器人、智能驾驶等逐步落地，然后人工智能将走进我们生活的方方面面。我们将认真挑选那些能够在这个过程中有着额外 Alpha 的公司，努力寻找预期回报最大的资产。

第二个方向是全球运营，包含产能出海与品牌出海。中国制造能力从袜子发展到新能源，我们的产品力、成本力都有着全球性竞争优势。随着贸易保护主义开始盛行，以欧美的关税壁垒和其他壁垒为标志，单纯的货物出口面临一定的压力。那些具有长期战略眼光的优秀公司，开启了全球运营的探索，将中国优秀的技术和管理能力在全球范围内复制，必将迎来公司价值的持续提升，给我们创造了良好的投资机会。

第三个方向是港股市场。港股市场当前被美 4%以上的无风险利率进行定价，被中美脱钩的悲观论调所左右，从而给出了非常丰厚的预期回报。优秀的港股上市公司也是中国经济中的佼佼者，背靠健壮的中国经济，蓄势待发，是低估值高赔率的优秀资产。

第四个方向是中国国内的消费转型。中国 14 亿人口追求幸福生活是我们经济发展不竭的动力。随着 60 后开始退休，00 后成为消费主力，一老一少旺盛的消费倾向是很多上市公司价值创造的机遇。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

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

2、基金经理参与或决定估值的程度

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

3、本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

4、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息

无。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行利润分配，符合法律法规的规定及《基金合同》的约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，按照相关法律法规规定和基金合同、托管协议的有关约定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的约定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：兴银丰运稳益回报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	3,787,228.04	4,992,824.88
结算备付金		7,555,330.00	3,074,560.80
存出保证金		83,427.95	83,986.57
交易性金融资产	6.4.7.2	349,875,398.88	452,357,811.76
其中：股票投资		140,635,430.43	177,817,896.32
基金投资		-	-
债券投资		209,239,968.45	274,539,915.44
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	10,000,000.00	-
应收清算款		657,808.86	378,081.62
应收股利		-	-
应收申购款		624,009.00	301,573.22
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		372,583,202.73	461,188,838.85

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		360,661.09	190,917.39
应付赎回款		1,916,510.16	916,646.32
应付管理人报酬		187,940.65	236,751.63
应付托管费		46,985.16	59,187.92
应付销售服务费		17,106.50	23,120.20
应付投资顾问费		-	-
应交税费		4,069.91	5,481.78
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	303,339.10	344,211.77
负债合计		2,836,612.57	1,776,317.01
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	302,727,038.51	370,550,959.99
未分配利润	6.4.7.8	67,019,551.65	88,861,561.85
净资产合计		369,746,590.16	459,412,521.84
负债和净资产总计		372,583,202.73	461,188,838.85

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 302,727,038.51 份。其中兴银丰运稳益回报混合 A 基金份额净值 1.2257 元，基金份额总额 135,928,651.09 份；兴银丰运稳益回报混合 C 基金份额净值 1.2179 元，基金份额总额 166,798,387.42 份。

6.2 利润表

会计主体：兴银丰运稳益回报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 2023 年 06 月 30 日
一、营业总收入		-5,489,750.94	16,393,512.83
1. 利息收入		43,849.63	262,661.13
其中：存款利息收入	6.4.7.9	27,771.55	67,427.65
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		16,078.08	195,233.48

其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-9,121,863.25	19,501,592.56
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-12,220,891.67	13,965,512.79
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	1,549,895.23	4,097,178.67
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,549,133.19	1,438,901.10
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	3,567,875.86	-3,476,932.08
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	20,386.82	106,191.22
减：二、营业总支出		1,759,753.66	2,066,517.56
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,231,950.25	1,457,021.04
2. 托管费	6.4.10.2.2	307,987.56	364,255.25
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	115,845.31	141,638.36
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		2,366.42	962.37
8. 其他费用	6.4.7.19	101,604.12	102,640.54
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-7,249,504.60	14,326,995.27
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-7,249,504.60	14,326,995.27
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-7,249,504.60	14,326,995.27

6.3 净资产变动表

会计主体：兴银丰运稳益回报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	370,550,959.99	88,861,561.85	459,412,521.84

二、本期期初净资产	370,550,959.99	88,861,561.85	459,412,521.84
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-67,823,921.48	-21,842,010.20	-89,665,931.68
（一）、综合收益总额	-	-7,249,504.60	-7,249,504.60
（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）	-67,823,921.48	-14,592,505.60	-82,416,427.08
其中：1. 基金申购款	74,362,761.12	17,258,196.53	91,620,957.65
2. 基金赎回款	-142,186,682.60	-31,850,702.13	-174,037,384.73
（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	302,727,038.51	67,019,551.65	369,746,590.16
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	391,795,285.48	102,569,901.55	494,365,187.03
二、本期期初净资产	391,795,285.48	102,569,901.55	494,365,187.03
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	12,881,222.00	17,709,046.46	30,590,268.46
（一）、综合收益总额	-	14,326,995.27	14,326,995.27
（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）	12,881,222.00	3,382,051.19	16,263,273.19
其中：1. 基金申购款	208,755,374.96	63,422,195.09	272,177,570.05
2. 基金赎回款	-195,874,152.96	-60,040,143.90	-255,914,296.86
（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	404,676,507.48	120,278,948.01	524,955,455.49

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：

吴若曼

刘钊

崔可

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

兴银丰运稳益回报混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监许可（2019）2215 号注册募集。《兴银丰运稳益回报混合型证券投资基金合同》于 2020 年 5 月 21 日正式生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，本基金首次募集规模为人民币

392,883,966.29 份基金份额。本基金的基金管理人为兴银基金管理有限责任公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》相关规定以及《兴银丰运稳益回报混合型证券投资基金合同》等法律文件约定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（包括国债、金融债、公司债、企业债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

基金的投资组合比例为：本基金对股票的投资比例占基金资产的 0%-40%，本基金投资于同业存单的比例不高于基金资产的 20%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金及到期日在一年以内的政府债券的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；股指期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×30%+中证综合债指数收益率×70%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 6 月 30 日的财务状况、自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

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

本半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《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》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告2024年第8号《关于延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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

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

b) 对证券投资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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个

人所得税。

d) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

e) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

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	3,787,228.04
等于：本金	3,786,867.28
加：应计利息	360.76
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	3,787,228.04

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	149,255,397.67	-	140,635,430.43	-8,619,967.24	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	207,560,701.91	1,189,522.02	209,239,968.45	489,744.52
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	207,560,701.91	1,189,522.02	209,239,968.45	489,744.52
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	356,816,099.58	1,189,522.02	349,875,398.88	-8,130,222.72	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债**6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额**

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	10,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	10,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

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	8.24
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	213,687.40
其中：交易所市场	213,687.40
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,643.46
合计	303,339.10

6.4.7.7 实收基金**兴银丰运稳益回报混合 A**

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	154,229,775.16	154,229,775.16

本期申购	4,138,407.79	4,138,407.79
本期赎回（以“-”号填列）	-22,439,531.86	-22,439,531.86
本期末	135,928,651.09	135,928,651.09

兴银丰运稳益回报混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	216,321,184.83	216,321,184.83
本期申购	70,224,353.33	70,224,353.33
本期赎回（以“-”号填列）	-119,747,150.74	-119,747,150.74
本期末	166,798,387.42	166,798,387.42

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

兴银丰运稳益回报混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	34,199,088.15	3,440,974.58	37,640,062.73
本期期初	34,199,088.15	3,440,974.58	37,640,062.73
本期利润	-4,663,484.75	1,702,110.61	-2,961,374.14
本期基金份额交易产生的变动数	-3,718,647.96	-285,288.60	-4,003,936.56
其中：基金申购款	809,908.38	189,694.97	999,603.35
基金赎回款	-4,528,556.34	-474,983.57	-5,003,539.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	25,816,955.44	4,857,796.59	30,674,752.03

兴银丰运稳益回报混合 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	46,396,229.20	4,825,269.92	51,221,499.12
本期期初	46,396,229.20	4,825,269.92	51,221,499.12
本期利润	-6,153,895.71	1,865,765.25	-4,288,130.46
本期基金份额交易产生的变动数	-9,844,408.57	-744,160.47	-
			10,588,569.04
其中：基金申购款	13,267,900.09	2,990,693.09	16,258,593.18
基金赎回款	-23,112,308.66	-3,734,853.56	-
			26,847,162.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	30,397,924.92	5,946,874.70	36,344,799.62

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	14,217.87
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	12,839.83
其他	713.85
合计	27,771.55

注：此处其他列示是存出保证金利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 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	299,731,338.04
减：卖出股票成本总额	311,339,330.23
减：交易费用	612,899.48
买卖股票差价收入	-12,220,891.67

6.4.7.10.2 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.11 基金投资收益

注：无。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 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	1,205,088.93
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	344,806.30
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	1,549,895.23

6.4.7.12.2 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

	月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	78,137,135.11
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	77,221,013.37
减：应计利息总额	568,628.64
减：交易费用	2,686.80
买卖债券差价收入	344,806.30

6.4.7.12.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.12.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.13.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.16 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	1,549,133.19
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,549,133.19

6.4.7.17 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	3,567,875.86
——股票投资	1,399,756.95
——债券投资	2,168,118.91
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——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	3,567,875.86

6.4.7.18 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	20,386.82
合计	20,386.82

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	20,671.12
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
账户查询费-上清所	600.00
银行汇划费	2,660.66
账户维护费	18,000.00
合计	101,604.12

6.4.7.20 分部报告

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

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

6.4.9 关联方关系

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

本报告期末不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：本基金与关联方的所有交易均是在正常业务中按照一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期以及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期以及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

注：本基金本报告期以及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

注：本基金本报告期以及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方佣金。

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 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	1,231,950.25	1,457,021.04
其中：应支付销售机构的客户维护费	449,758.06	631,274.81
应支付基金管理人的净管理费	782,192.19	825,746.23

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.60% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	307,987.56	364,255.25

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方 名称	本期 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		
	兴银丰运稳益回报混合 A	兴银丰运稳益回报混合 C	合计
华福证券	-	3,299.83	3,299.83
兴银基金	-	5,623.20	5,623.20
合计	-	8,923.03	8,923.03
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		
	兴银丰运稳益回报混合 A	兴银丰运稳益回报混合 C	合计
华福证券	-	6,071.65	6,071.65
兴银基金	-	3,321.36	3,321.36
合计	-	9,393.01	9,393.01

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.10%，销售服务费计提的计算公式如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无。

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

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的管理人在本报告期内与上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国民生银行股份有限公司	3,787,228.04	14,217.87	12,241,249.95	43,595.76

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末以及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无其他需要说明的关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（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**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301589	诺瓦星云	2024 年 02 月 01 日	6 个月	网下新股限售	126.89	188.01	1,065	75,118.88	200,230.65	-
688709	成都华微	2024 年 01 月 31 日	6 个月	网下新股限售	15.69	18.79	868	13,618.92	16,309.72	-

601033	永兴股份	2024年01月11日	6个月	网下新股限售	16.20	15.96	668	10,821.60	10,661.28	-
688584	上海合晶	2024年02月01日	6个月	网下新股限售	22.66	15.89	662	15,000.92	10,519.18	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	创业板新股限售	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301591	肯特股份	2024年02月20日	6个月	网下新股限售	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
688695	中创股份	2024年03月06日	6个月	网下新股限售	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
301588	美新科技	2024年03月06日	6个月	网下新股限售	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
001387	雪祺电气	2024年01月04日	6个月	网下新股限售	15.38	15.25	173	2,045.54	2,638.25	-
301502	华阳智能	2024年	6个月	网下新股	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-

		01月26日		限售						
603325	博隆技术	2024年01月03日	6个月	网下新股限售	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603312	西典新能	2024年01月04日	6个月	网下新股限售	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603082	北自科技	2024年01月23日	6个月	网下新股限售	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
001379	腾达科技	2024年01月11日	6个月	网下新股限售	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

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

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有除国债、政策性金融债、央行票据及地方政府债以外的需按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有需按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有需按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	67,425,479.00	107,109,261.70
AAA 以下	119,447,779.86	144,088,418.97

未评级	-	-
合计	186,873,258.86	251,197,680.67

注：以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债、央行票据及地方政府债等。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有需按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有需按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金

投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，保障基金持有人利益。

本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 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							
货币资金	3,787,228.04	-	-	-	-	-	3,787,228.04
结算备付金	7,555,330.00	-	-	-	-	-	7,555,330.00
存出保	83,427.95	-	-	-	-	-	83,427.95

证金							
交易性金融资产	13,202,995.89	-	9,766,269.58	186,270,702.98	-	140,635,430.43	349,875,398.88
买入返售金融资产	10,000,000.00	-	-	-	-	-	10,000,000.00
应收清算款	-	-	-	-	-	657,808.86	657,808.86
应收申购款	-	-	-	-	-	624,009.00	624,009.00
资产总计	34,628,981.88	-	9,766,269.58	186,270,702.98	-	141,917,248.29	372,583,202.73
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	360,661.09	360,661.09
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,916,510.16	1,916,510.16
应	-	-	-	-	-	187,940.65	187,940.65

付 管 理 人 报 酬							
应 付 托 管 费	-	-	-	-	-	46,985.16	46,985.16
应 付 销 售 服 务 费	-	-	-	-	-	17,106.50	17,106.50
应 交 税 费	-	-	-	-	-	4,069.91	4,069.91
其 他 负 债	-	-	-	-	-	303,339.10	303,339.10
负 债 总 计	-	-	-	-	-	2,836,612. 57	2,836,612. 57
利 率 敏 感 度 缺 口	34,628,98 1.88	-	9,766,269 .58	186,270,70 2.98	-	139,080,63 5.72	369,746,59 0.16
上 年 度 末 20 23 年	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

12月31日							
资产							
货币资金	4,992,824.88	-	-	-	-	-	4,992,824.88
结算备付金	3,074,560.80	-	-	-	-	-	3,074,560.80
存出保证金	83,986.57	-	-	-	-	-	83,986.57
交易性金融资产	10,194,290.41	7,003,318.75	13,068,027.40	244,194,361.92	79,916.96	177,817,896.32	452,357,811.76
应收清算款	-	-	-	-	-	378,081.62	378,081.62
应收申购款	-	-	-	-	-	301,573.22	301,573.22
资产总计	18,345,662.66	7,003,318.75	13,068,027.40	244,194,361.92	79,916.96	178,497,551.16	461,188,838.85
负债							
应	-	-	-	-	-	190,917.39	190,917.39

付清算款							
应付赎回款	-	-	-	-	-	916,646.32	916,646.32
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	236,751.63	236,751.63
应付托管费	-	-	-	-	-	59,187.92	59,187.92
应付销售服务费	-	-	-	-	-	23,120.20	23,120.20
应交税费	-	-	-	-	-	5,481.78	5,481.78
其他负债	-	-	-	-	-	344,211.77	344,211.77
负债总计	-	-	-	-	-	1,776,317.01	1,776,317.01
利率敏感	18,345,66 2.66	7,003,318 .75	13,068,02 7.40	244,194,36 1.92	79,916 .96	176,721,23 4.15	459,412,52 1.84

度 缺 口							
-------------	--	--	--	--	--	--	--

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除利率之外的其他市场变量保持不变；		
	该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券与可交换债券。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	-9,762.69	-22,501.15
	市场利率下降 25 个基点	9,777.91	22,615.46

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	140,635,430.43	38.04	177,817,896.32	38.71
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	209,239,968.45	56.59	274,539,915.44	59.76
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	349,875,398.88	94.63	452,357,811.76	98.46

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除下述市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上涨 5%	8,344,917.63	7,818,962.53
	沪深 300 指数下跌 5%	-8,344,917.63	-7,818,962.53

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

- 第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；
- 第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；
- 第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	327,220,091.35	428,105,305.57
第二层次	22,366,709.59	23,342,234.77
第三层次	288,597.94	910,271.42
合计	349,875,398.88	452,357,811.76

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（2023 年 12 月 31 日：无）。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负

债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2024 年 6 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	140,635,430.43	37.75
	其中：股票	140,635,430.43	37.75
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	209,239,968.45	56.16
	其中：债券	209,239,968.45	56.16
	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	10,000,000.00	2.68
	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	11,342,558.04	3.04
8	其他各项资产	1,365,245.81	0.37
9	合计	372,583,202.73	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	101,234,968.53	27.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	4,835,457.00	1.31
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	27,276,975.50	7.38
J	金融业	4,541,474.00	1.23

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,623,469.12	0.44
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	10,661.28	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,112,425.00	0.30
S	综合	-	-
	合计	140,635,430.43	38.04

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	688018	乐鑫科技	89,617	8,843,405.56	2.39
2	688157	松井股份	242,823	8,353,111.20	2.26
3	688369	致远互联	508,584	8,000,026.32	2.16
4	603986	兆易创新	81,900	7,831,278.00	2.12
5	600131	国网信通	383,100	6,462,897.00	1.75
6	301108	洁雅股份	260,500	6,332,755.00	1.71
7	605009	豪悦护理	138,200	5,450,608.00	1.47
8	300783	三只松鼠	221,100	4,835,457.00	1.31
9	601233	桐昆股份	267,700	4,272,492.00	1.16
10	002138	顺络电子	144,300	3,962,478.00	1.07
11	301061	匠心家居	77,390	3,634,234.40	0.98
12	603085	天成自控	364,700	3,260,418.00	0.88
13	002008	大族激光	151,400	3,149,120.00	0.85
14	600111	北方稀土	182,700	3,142,440.00	0.85
15	002594	比亚迪	12,200	3,053,050.00	0.83
16	600837	海通证券	338,400	2,896,704.00	0.78
17	002064	华峰化学	385,500	2,764,035.00	0.75
18	002790	瑞尔特	296,600	2,678,298.00	0.72
19	300829	金丹科技	180,200	2,609,296.00	0.71
20	688981	中芯国际	53,990	2,488,939.00	0.67
21	603983	丸美股份	88,700	2,441,911.00	0.66
22	300740	水羊股份	157,300	2,309,164.00	0.62
23	000528	柳工	202,400	2,264,856.00	0.61
24	600559	老白干酒	119,200	2,167,056.00	0.59

25	301035	润丰股份	47,800	2,129,012.00	0.58
26	601567	三星医疗	54,400	1,904,000.00	0.51
27	600285	羚锐制药	78,100	1,890,801.00	0.51
28	688257	新锐股份	112,238	1,720,608.54	0.47
29	600399	抚顺特钢	298,200	1,678,866.00	0.45
30	300454	深信服	32,100	1,622,013.00	0.44
31	002027	分众传媒	267,500	1,621,050.00	0.44
32	002001	新和成	80,600	1,547,520.00	0.42
33	688772	珠海冠宇	103,536	1,542,686.40	0.42
34	603605	珀莱雅	13,400	1,487,266.00	0.40
35	002563	森马服饰	241,500	1,403,115.00	0.38
36	002859	洁美科技	69,200	1,389,536.00	0.38
37	002582	好想你	225,000	1,208,250.00	0.33
38	000541	佛山照明	241,400	1,175,618.00	0.32
39	601456	国联证券	105,000	1,012,200.00	0.27
40	605080	浙江自然	63,300	1,001,406.00	0.27
41	605077	华康股份	65,650	1,001,162.50	0.27
42	688099	晶晨股份	14,104	836,649.28	0.23
43	688203	海正生材	92,892	789,582.00	0.21
44	003006	百亚股份	30,900	732,330.00	0.20
45	600298	安琪酵母	26,100	728,973.00	0.20
46	601100	恒立液压	15,300	712,674.00	0.19
47	688031	星环科技	17,424	639,635.04	0.17
48	300033	同花顺	6,100	632,570.00	0.17
49	002558	巨人网络	66,600	628,704.00	0.17
50	300251	光线传媒	70,300	591,223.00	0.16
51	002258	利尔化学	70,500	565,410.00	0.15
52	002149	西部材料	34,300	478,828.00	0.13
53	000999	华润三九	9,881	420,732.98	0.11
54	300452	山河药辅	35,700	405,552.00	0.11
55	603786	科博达	6,200	397,730.00	0.11
56	002739	万达电影	30,600	369,954.00	0.10
57	000957	中通客车	28,600	300,872.00	0.08
58	603638	艾迪精密	20,900	293,227.00	0.08
59	603008	喜临门	15,500	268,615.00	0.07
60	300408	三环集团	8,300	242,277.00	0.07
61	300782	卓胜微	2,600	202,124.00	0.05
62	301589	诺瓦星云	1,065	200,230.65	0.05
63	603707	健友股份	16,000	190,080.00	0.05
64	603444	吉比特	900	160,209.00	0.04
65	601928	凤凰传媒	13,800	151,248.00	0.04
66	688696	极米科技	1,904	147,064.96	0.04
67	603517	绝味食品	9,300	143,220.00	0.04

68	002705	新宝股份	8,500	119,595.00	0.03
69	002460	赣锋锂业	4,100	117,465.00	0.03
70	300677	英科医疗	3,300	88,473.00	0.02
71	603195	公牛集团	1,034	79,742.08	0.02
72	600456	宝钛股份	3,100	79,143.00	0.02
73	601360	三六零	10,100	77,568.00	0.02
74	600885	宏发股份	1,820	50,377.60	0.01
75	688253	英诺特	1,209	46,074.99	0.01
76	300083	创世纪	7,500	45,975.00	0.01
77	300957	贝泰妮	900	43,488.00	0.01
78	688709	成都华微	868	16,309.72	0.00
79	601096	宏盛华源	3,918	16,024.62	0.00
80	601033	永兴股份	668	10,661.28	0.00
81	688584	上海合晶	662	10,519.18	0.00
82	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
83	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
84	301578	辰奕智能	153	6,054.21	0.00
85	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
86	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
87	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
88	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
89	603004	鼎龙科技	195	3,305.25	0.00
90	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
91	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
92	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
93	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
94	001358	兴欣新材	122	2,503.44	0.00
95	603373	安邦护卫	88	2,419.12	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	688369	致远互联	11,323,349.89	2.46
2	688157	松井股份	8,936,549.63	1.95
3	603986	兆易创新	7,307,820.60	1.59
4	605009	豪悦护理	6,758,478.18	1.47
5	300452	山河药辅	6,428,789.53	1.40
6	300454	深信服	6,184,595.00	1.35
7	603983	丸美股份	5,835,044.76	1.27
8	688018	乐鑫科技	5,834,140.50	1.27

9	300783	三只松鼠	5,226,301.35	1.14
10	002258	利尔化学	5,013,038.00	1.09
11	603517	绝味食品	4,863,319.27	1.06
12	600315	上海家化	4,679,204.00	1.02
13	688308	欧科亿	4,642,134.49	1.01
14	300829	金丹科技	4,619,232.13	1.01
15	301035	润丰股份	4,508,333.48	0.98
16	301108	洁雅股份	4,481,163.00	0.98
17	002739	万达电影	4,427,136.00	0.96
18	600131	国网信通	4,324,052.00	0.94
19	605080	浙江自然	4,281,519.51	0.93
20	000957	中通客车	4,183,534.00	0.91

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（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	601456	国联证券	10,855,679.00	2.36
2	601567	三星医疗	7,995,244.00	1.74
3	002138	顺络电子	7,503,630.00	1.63
4	605305	中际联合	7,412,326.00	1.61
5	603195	公牛集团	7,285,003.20	1.59
6	002001	新和成	6,759,814.60	1.47
7	300452	山河药辅	6,525,521.00	1.42
8	300033	同花顺	6,434,818.00	1.40
9	603486	科沃斯	6,385,518.00	1.39
10	300498	温氏股份	6,330,968.00	1.38
11	002705	新宝股份	6,015,910.00	1.31
12	002468	申通快递	5,551,043.00	1.21
13	301061	匠心家居	5,550,630.00	1.21
14	601233	桐昆股份	5,223,479.00	1.14
15	600315	上海家化	5,116,787.00	1.11
16	300408	三环集团	4,818,702.00	1.05
17	600399	抚顺特钢	4,659,829.00	1.01
18	603638	艾迪精密	4,633,494.92	1.01
19	300083	创世纪	4,626,035.00	1.01
20	000913	钱江摩托	4,607,802.00	1.00

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（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	272,757,107.39
卖出股票收入（成交）总额	299,731,338.04

注：“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	22,366,709.59	6.05
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)	186,873,258.86	50.54
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	209,239,968.45	56.59

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	110082	宏发转债	139,390	15,572,536.23	4.21
2	113043	财通转债	133,220	14,808,059.98	4.00
3	113054	绿动转债	134,050	14,160,465.40	3.83
4	113633	科沃转债	132,610	14,155,699.69	3.83
5	110067	华安转债	119,200	13,221,059.84	3.58

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

7.11.2 本期国债期货投资评价

报告期内本基金未进行国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券发行主体未出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金不存在前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情形。

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	83,427.95
2	应收清算款	657,808.86
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	624,009.00

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,365,245.81

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110082	宏发转债	15,572,536.23	4.21
2	113043	财通转债	14,808,059.98	4.00
3	113054	绿动转债	14,160,465.40	3.83
4	113633	科沃转债	14,155,699.69	3.83
5	110067	华安转债	13,221,059.84	3.58
6	127022	恒逸转债	13,187,870.27	3.57
7	113053	隆 22 转债	12,864,297.53	3.48
8	128136	立讯转债	12,381,574.24	3.35
9	110062	烽火转债	11,765,519.15	3.18
10	113644	艾迪转债	9,718,356.91	2.63
11	110076	华海转债	9,037,885.80	2.44
12	113046	金田转债	6,347,890.06	1.72
13	113044	大秦转债	6,089,021.80	1.65
14	113037	紫银转债	5,662,551.31	1.53
15	113584	家悦转债	5,287,826.23	1.43
16	127067	恒逸转 2	4,902,060.08	1.33
17	113065	齐鲁转债	4,245,271.24	1.15
18	113056	重银转债	3,829,693.58	1.04
19	118005	天奈转债	2,178,594.92	0.59
20	113605	大参转债	1,898,098.16	0.51
21	128131	崇达转 2	1,877,399.87	0.51
22	113641	华友转债	1,536,210.59	0.42
23	123104	卫宁转债	1,311,381.85	0.35
24	113024	核建转债	602,555.88	0.16
25	128135	洽洽转债	227,050.14	0.06
26	127046	百润转债	4,328.11	0.00

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
兴银丰运稳益回报混合 A	3,818	35,602.06	62,367,578.09	45.88%	73,561,073.00	54.12%
兴银丰运稳益回报混合 C	11,166	14,938.06	21,492,846.44	12.89%	145,305,540.98	87.11%
合计	14,984	20,203.35	83,860,424.53	27.70%	218,866,613.98	72.30%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	兴银丰运稳益回报混合 A	301,813.57	0.222038%
	兴银丰运稳益回报混合 C	177,160.75	0.106213%
	合计	478,974.32	0.15822%

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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	兴银丰运稳益回报混合 A	10~50
	兴银丰运稳益回报混合 C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	兴银丰运稳益回报混合 A	0
	兴银丰运稳益回报混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	兴银丰运稳益回报混合 A	兴银丰运稳益回报混合 C
基金合同生效日（2020年05月21日）基金份额总额	165,719,489.24	227,164,477.05
本报告期期初基金份额总额	154,229,775.16	216,321,184.83
本报告期基金总申购份额	4,138,407.79	70,224,353.33
减：本报告期基金总赎回份额	22,439,531.86	119,747,150.74
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	135,928,651.09	166,798,387.42

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 2024年4月19日，吴真子担任基金管理人督察长，郑瑞健不再担任基金管理人督察长。

(2) 2024年7月22日，董事长吴若曼代任基金管理人总经理，赵建兴不再担任基金管理人总经理。

(3) 2024年7月22日，陈晓毅担任基金管理人首席信息官，赵建兴不再担任基金管理人首席信息官。

(4) 报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人及其高级管理人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2024 年 04 月 30 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会上海监管局
受到的具体措施类型	警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	未严格执行公司制度
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已完成整改
其他	无

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
信达证券	2	251,973,283.57	44.08%	187,950.34	44.08%	-
国投证券	2	234,821,344.98	41.08%	175,155.32	41.08%	-
广发证券	2	84,824,938.64	14.84%	63,272.10	14.84%	-

注：基金租用证券公司交易单元的选择标准是：

- （1）内部管理规范、严谨；具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- （2）研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能够针对基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；
- （3）能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动资源，协助基金投资；
- （4）其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。选择程序：本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选证券公司的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的证券公司。

10.7.2 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	成交金额	占当期	成交	占当	成交	占当

		债券成交总额的比例		债券回购成交总额的比例	金额	期权证成交总额的比例	金额	基金成交总额的比例
信达证券	62,456,211.30	81.79%	78,000,000.00	51.32%	-	-	-	-
国投证券	4,040,707.92	5.29%	10,000,000.00	6.58%	-	-	-	-
广发证券	9,861,295.10	12.91%	64,000,000.00	42.11%	-	-	-	-

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	兴银基金管理有限责任公司旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报	2024-01-20
2	兴银丰运稳益回报混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	指定网站	2024-01-20
3	兴银基金管理有限责任公司旗下部分基金 2023 年年度报告提示性公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报	2024-03-28
4	兴银丰运稳益回报混合型证券投资基金 2023 年年度报告	指定网站	2024-03-28
5	关于旗下部分基金参与万得基金费率优惠活动并开通定期定额投资的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、指定网站	2024-04-19
6	兴银基金管理有限责任公司关于督察长变更的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、指定网站	2024-04-20
7	兴银丰运稳益回报混合型证券投资基金 2024 年 1 季度报告	指定网站	2024-04-20
8	兴银基金管理有限责任公司旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报	2024-04-20
9	关于旗下部分基金在济安财富（北京）基金销售有限公司开通定期定额投资的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、指定网站	2024-04-22
10	兴银基金管理有限责任公司关于暂停海银基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、指定网站	2024-06-12
11	关于兴银基金管理有限责任公司旗下基金调整股票估值方法的提示性公告	上海证券报、证券时报、证券日报、中国证券报、指定网站	2024-06-19
12	兴银丰运稳益回报混合型证券投资基金基金产品资料概要	指定网站、中数平台	2024-06-20

	(更新)		
--	------	--	--

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期内单一投资者持有基金份额比例未出现超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予基金募集注册的文件
2. 《兴银丰运稳益回报混合型证券投资基金基金合同》
3. 《兴银丰运稳益回报混合型证券投资基金招募说明书》
4. 《兴银丰运稳益回报混合型证券投资基金托管协议》
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照
6. 报告期内在指定信息披露媒体上公开披露的各项公告
7. 中国证监会规定的其他备查文件

12.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处。

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。投资者对本报告书如有疑问，可拨打客服电话（40000-96326）咨询本基金管理人。

兴银基金管理有限责任公司
二〇二四年八月三十日