

兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金

2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人:兴银基金管理有限责任公司

基金托管人:平安银行股份有限公司

报告送出日期:2025 年 03 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人平安银行股份有限公司根据基金合同规定，于2025年3月28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。

本报告中财务资料经审计。

本报告期自2024年1月1日起至12月31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7

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、基金净值表现及利润分配情况7

3.1 主要会计数据和财务指标7

3.2 基金净值表现9

3.3 其他指标12

3.4 过去三年基金的利润分配情况12

§ 4 管理人报告.....12

4.1 基金管理人及基金经理情况12

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明13

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....13

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14

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望14

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....15

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	16
4.10 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	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	49
8.1 期末基金资产组合情况	49
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
8.3 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	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	79
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	82

8.6 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	82
8.7 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	83
8.8 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	83
8.9 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	83
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	83
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	83
8.12 投资组合报告附注	83
§ 9 基金份额持有人信息	84
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	84
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	84
9.3 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	85
§ 10 开放式基金份额变动	85
§ 11 重大事件揭示	85
11.1 基金份额持有人大会决议	85
11.2 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	86
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	86
11.4 基金投资策略的改变	86
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	86
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	86
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	86
11.8 其他重大事件	87
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	89

12.1 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	89
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	89
§ 13 备查文件目录	89
13.1 备查文件目录.....	89
13.2 存放地点.....	90
13.3 查阅方式.....	90

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	兴银中证 1000 指数增强	
基金主代码	014831	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 01 月 26 日	
基金管理人	兴银基金管理有限责任公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	277,122,060.05 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	兴银中证 1000 指数增强 A	兴银中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	014831	014832
报告期末下属分级基金的份额总额	128,177,836.41 份	148,944,223.64 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		兴银基金管理有限责任公司	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴真子	潘琦
	联系电话	86-21-20296358	0755-22168257
	电子邮箱	wzz@hffunds.cn	PANQI003@pingan.com.cn
客户服务电话		40000-96326	95511-3
传真		86-21-68630069	0755-82080387
注册地址		福建省泉州市丰泽区滨海街102号厦门银行泉州分行大厦19楼1908	广东省深圳市罗湖区深南东路5047号
办公地址		中国上海市浦东新区滨江大道5129号陆家嘴滨江中心N1幢三层、五层	广东省深圳市福田区益田路5023号平安金融中心B座
邮政编码		200120	518001
法定代表人		吴若曼	谢永林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.hffunds.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市南京西路1266号恒隆广场2期26楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2024 年		2023 年		2022 年 01 月 26 日（基金合同生效日）-2022 年 12 月 31 日	
	兴银中证	兴银中证	兴银中证	兴银中证	兴银中证	兴银中证

指标	1000 指数增 强 A	1000 指数增 强 C	1000 指数增 强 A	1000 指数增 强 C	1000 指数增 强 A	1000 指数增 强 C
本期 已实现收 益	7,172,547.7 1	7,422,044.1 1	— 3,736,223.6 2	— 3,114,663. 46	— 20,962,933. 10	— 15,018,078. 68
本期 利润	3,951,878.6 1	5,693,689.8 3	116,217.81	— 178,739.27	— 25,528,551. 74	— 18,855,226. 40
加权 平均 基金 份额 本期 利润	0.0307	0.0475	0.0008	-0.0017	-0.1588	-0.1988
本期 加权 平均 净值 利润 率	3.95%	6.16%	0.09%	-0.20%	-16.89%	-21.22%
本期 基金 份额 净值 增长 率	4.25%	4.05%	-1.45%	-1.66%	-15.30%	-15.45%
3.1. 2 期 末数 据和 指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
期末 可供 分配 利润	— 16,634,218. 23	— 20,080,204. 28	— 22,388,670. 89	— 17,090,154 .55	— 25,306,546. 81	— 18,413,023. 29
期末 可供 分配 基金 份额 利润	-0.1298	-0.1348	-0.1653	-0.1685	-0.1530	-0.1545
期末 基金	111,543,618 .18	128,864,019 .36	113,039,444 .24	84,329,193 .70	140,136,910 .69	100,749,604 .16

资产净值						
期末基金份额净值	0.8702	0.8652	0.8347	0.8315	0.8470	0.8455
3.1.3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
基金份额累计净值增长率	-12.98%	-13.48%	-16.53%	-16.85%	-15.30%	-15.45%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额），即如果期末未分配利润（报表数，下同）的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴银中证 1000 指数增强 A 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	4.39%	2.16%	4.23%	2.28%	0.16%	-0.12%
过去六个月	20.08%	2.02%	20.68%	2.13%	-0.60%	-0.11%
过去一年	4.25%	1.92%	1.41%	2.01%	2.84%	-0.09%
自基金合同生效起至今	-12.98%	1.45%	-15.30%	1.54%	2.32%	-0.09%

兴银中证 1000 指数增强 C 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益	①—③	②—④
----	----------	----------	----------	----------	-----	-----

		准差②	率③	率标准差 ④		
过去三个月	4.34%	2.16%	4.23%	2.28%	0.11%	-0.12%
过去六个月	19.95%	2.02%	20.68%	2.13%	-0.73%	-0.11%
过去一年	4.05%	1.92%	1.41%	2.01%	2.64%	-0.09%
自基金合同生 效起至今	-13.48%	1.45%	-15.30%	1.54%	1.82%	-0.09%

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

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

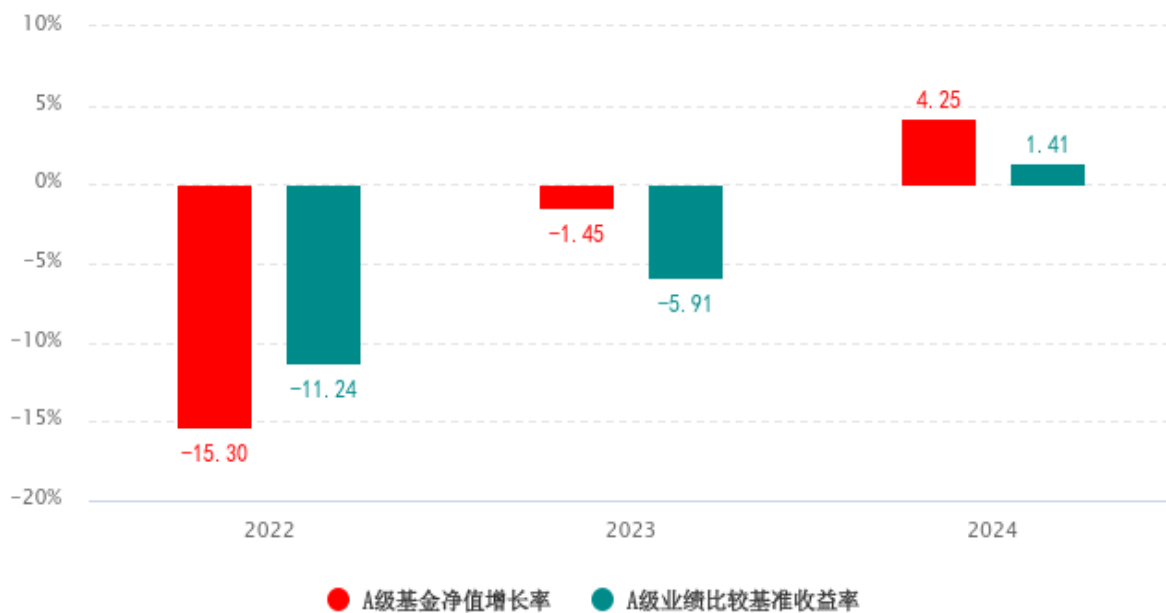


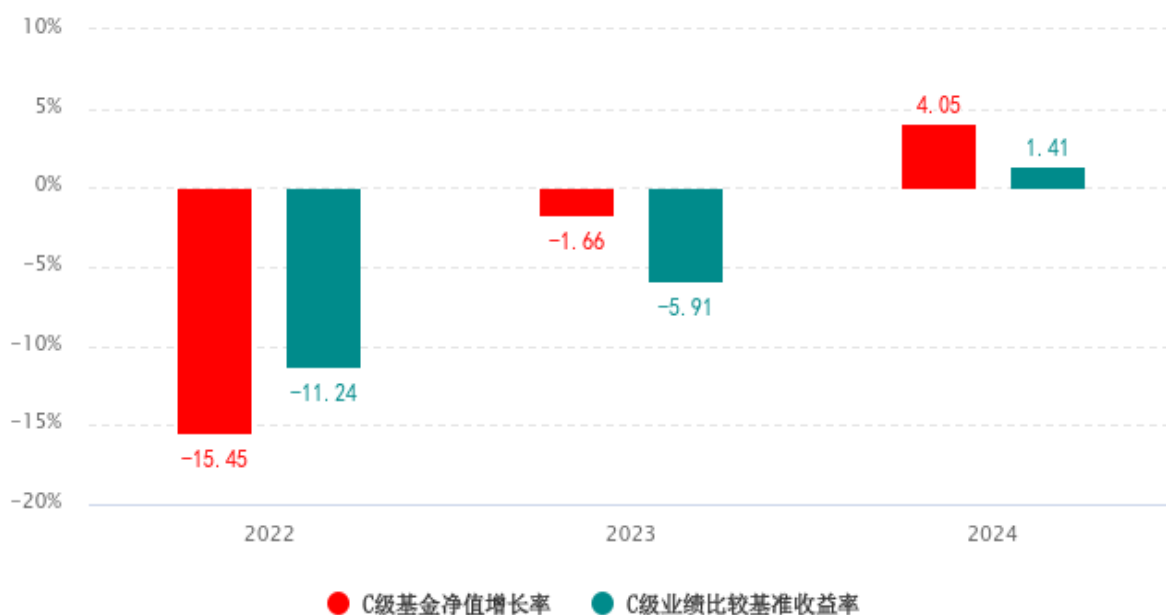
C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022年01月26日-2024年12月31日)



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

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





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

3.3 其他指标

注：无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金自成立日以来未进行过利润分配。

§ 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

兴银基金管理有限公司，注册地为福建省泉州市丰泽区，公司主要办公场所位于上海市浦东新区。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“华福基金管理有限公司”变更为“兴银基金管理有限公司”。截至报告期末，本公司共管理基金 54 只。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李哲通	本基金的基金经理	2022-01-26	2024-04-30	13 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任巴克莱资本利率衍生品分析师，深圳大岩资本量化投资副总裁，上海迈维资产执行总经理。2020 年 10 月加入兴银基金管理有限公司，曾任指数与量化投资部基金经理。
林学晨	本基金的基金经理	2024-04-26	-	11 年	硕士研究生，特许金融分析师（CFA），具有基金从业资格。曾任湘财证券研究所金融工程分析师。2015 年 7 月加入兴银基金管理有限公司，历任中央交易室衍生品交易员、衍生品业务部投资经理助理、投资经理；现任指数与量化投资部基金经理。

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

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人制定了公平交易管理的制度，并根据法律法规及监管规定结合实践予以修订完善。本基金管理人主要从研究的公平、决策的公平、交易的公平、公平交易的监控评估、公平交易

的报告和信息披露等方面对公平交易行为进行规范，从而达到保证本基金管理人管理的不同投资组合得到公平对待、保护投资者合法权益的目的。

4.3.2 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。

4.3.3 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

产品主要采用多因子选股策略。其中因子涵盖行业、盈利、成长、规模、估值、风险、市场情绪、分析师预期等多维大类因子及其项下的各细分小类因子。团队根据市场状态的变化和因子研究的最新结论，对因子库和模型进行更新，以能够追踪市场的变动，持续跟踪稳健的优质因子。在上述基础上，兼顾股票本身流动性和风险分散度的同时构建股票投资组合。策略资产组合整体结构稳定，仓位控制灵活，市场适应性强。产品策略研究建立在对历史数据的大规模分析及对未来的高精度预测上，同时严格按照策略执行交易管理及风控。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，兴银中证 1000 指数增强 A 基金份额净值为 0.8702 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 4.25%，同期业绩比较基准收益率为 1.41%；兴银中证 1000 指数增强 C 基金份额净值为 0.8652 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 4.05%，同期业绩比较基准收益率为 1.41%。

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 2025 年，市场或将围绕以下三条主线展开：

1、科技创新与新质生产力：随着人工智能、大数据、半导体等领域的持续突破，科技板块有望成为市场焦点。政策层面的大力支持将进一步推动科技制造和中高端制造业的发展。我们预期 AI 算力、消费电子、汽车产业链、半导体等细分领域将存在机会。

2、并购重组与市值管理：在政策鼓励下，企业间的兼并重组活动有望加速，特别是在电子、医疗器械、汽车零部件等行业。这将有助于资源整合和产业升级，提升企业价值。我们预期具备并购预期和市值管理能力的优质标的或将发力。

3、内需消费与经济复苏：随着经济的修复式增长，消费市场将逐步回暖。必选消费品和可选

消费品领域均有望受益，特别是食品饮料、消费电子等行业。政策支持和居民收入提升将进一步促进消费升级，带来投资机会。我们预期科技制造、并购重组、消费等领域或将值得重点关注。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，不断健全完善内控机制，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行，推动公司的合规文化和内部风险控制机制的完善。本基金管理人主要监察稽核工作如下：

（1）加强合规审核。持续强化投资、研究、交易、核算、销售等业务事前、事中、事后的合规审核；在新基金产品开发、新投资品种及其他创新业务中，加强合规把关，切实做到看得清管得住，合规展业。

（2）深入重点专项稽核工作。梳理业务模式、主要监管规则、潜在风险点等，对关键业务领域开展专项稽核，推动制度规章及时更新，优化操作流程，提升合规管理和风控意识。

（3）持续规范对投资研究交易特定岗位的通讯管理。对投资研究交易特定岗位通讯工具在交易时间集中管理，定期或不定期的对其网络即时通讯记录、电话录音等进行抽查，有效地防范了各种形式的利益输送行为。

（4）强化法规学习，开展内控培训，促进合规文化建设。本基金管理人及时针对新颁布的法律法规开展宣传培训工作，通过多种形式进一步加强合规培训力度，深化基金从业人员合规风险意识，提升职业道德素养，营造良好合规氛围，促进公司稳定健康地发展。

（5）完成各种定期报告及临时公告的信息披露工作。按照法规要求，做好旗下各只基金的信息披露工作，做到信息披露的真实、完整、准确、及时。

在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，完善内控制度，提高工作水平，努力防范各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2502632 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金（以下简称“该基金”）财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表、2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“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编制，公允反映了该基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	该基金管理人兴银基金管理有限责任公司（以下简称“该基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2024 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错

	报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 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编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。 该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3) 评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (4) 对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。 (5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	黄小熠	于航
会计师事务所的地址	上海市南京西路 1266 号恒隆广场 2 期 26 楼	
审计报告日期	2025-03-31	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	5,825,450.32	3,480,576.19
结算备付金		17,291,356.02	28,096,003.10
存出保证金		1,858,209.60	2,239,353.60
交易性金融资产	7.4.7.2	213,369,334.72	163,936,426.89
其中：股票投资		210,346,049.79	163,936,426.89
基金投资		—	—
债券投资		3,023,284.93	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
其他投资		—	—
衍生金融资产	7.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	—	—
应收清算款		—	—
应收股利		—	—
应收申购款		2,771,235.31	309,008.89
递延所得税资产		—	—
其他资产	7.4.7.5	—	—
资产总计		241,115,585.97	198,061,368.67
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 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	7.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付清算款		—	—
应付赎回款		338,770.29	369,403.21

应付管理人报酬		153,052.02	133,886.39
应付托管费		38,263.02	33,471.58
应付销售服务费		19,286.91	14,218.79
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2,567.58	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	156,008.61	141,750.76
负债合计		707,948.43	692,730.73
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	277,122,060.05	236,847,463.38
未分配利润	7.4.7.8	-36,714,422.51	-39,478,825.44
净资产合计		240,407,637.54	197,368,637.94
负债和净资产总计		241,115,585.97	198,061,368.67

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 277,122,060.05 份。其中兴银中证 1000 指数增强 A 基金份额净值 0.8702 元，基金份额总额 128,177,836.41 份；兴银中证 1000 指数增强 C 基金份额净值 0.8652 元，基金份额总额 148,944,223.64 份。

7.2 利润表

会计主体：兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日 至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		11,915,432.47	2,480,667.72
1. 利息收入		120,193.14	169,818.46
其中：存款利息收入	7.4.7.9	120,094.13	169,818.46
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		99.01	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		16,554,553.72	-4,634,351.34
其中：股票投资收益	7.4.7.10	12,413,427.37	-6,705,653.03
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	5,223.58	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	1,783,867.85	-402,560.87
股利收益	7.4.7.15	2,352,034.92	2,473,862.56

其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-4,949,023.38	6,788,365.62
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	189,708.99	156,834.98
减：二、营业总支出		2,269,864.03	2,543,189.18
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,538,953.76	1,753,744.40
2. 托管费	7.4.10.2.2	384,738.52	438,436.12
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	184,658.81	183,423.47
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	7.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		5,422.94	4,085.19
8. 其他费用	7.4.7.19	156,090.00	163,500.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,645,568.44	-62,521.46
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,645,568.44	-62,521.46
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		9,645,568.44	-62,521.46

7.3 净资产变动表

会计主体：兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	236,847,463.38	-39,478,825.44	197,368,637.94
二、本期期初净资产	236,847,463.38	-39,478,825.44	197,368,637.94
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	40,274,596.67	2,764,402.93	43,038,999.60
（一）、综合收益总额	-	9,645,568.44	9,645,568.44
（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）	40,274,596.67	-6,881,165.51	33,393,431.16
其中：1. 基金申购款	212,407,120.90	-38,121,639.67	174,285,481.23
2. 基金赎回款	-172,132,524.23	31,240,474.16	-140,892,050.07
（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）	-	0.00	-

四、本期期末净资产	277,122,060.05	-36,714,422.51	240,407,637.54
项 目	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	284,606,084.95	-43,719,570.10	240,886,514.85
二、本期期初净资产	284,606,084.95	-43,719,570.10	240,886,514.85
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-47,758,621.57	4,240,744.66	-43,517,876.91
（一）、综合收益总额	-	-62,521.46	-62,521.46
（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）	-47,758,621.57	4,303,266.12	-43,455,355.45
其中：1. 基金申购款	83,024,883.19	-9,198,363.57	73,826,519.62
2. 基金赎回款	-130,783,504.76	13,501,629.69	-117,281,875.07
（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	236,847,463.38	-39,478,825.44	197,368,637.94

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

易勇	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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）2021 年 12 月 28 日证监许可〔2021〕4124 号注册募集。《兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2022 年 1 月 26 日生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集规模为 268,420,575.82 份基金份额。本基金的基金管理人为兴银基金管理有限责任公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》相关规定以及《兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》等法律文件约定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以标的指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、银行存款、债券（包括国债、中央银行票据、地方政府债、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债、企业债、公司债、超短期融资券、短期融资券、中期票据、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券）、债券回购、股指期货、股票期权、资产支持证券、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金管理人根据相关法律法规可以参与融资及转融通证券出借业务。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：本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终，在扣除股指期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%。

7.4.2 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>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

7.4.3 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 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况、2024 年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资等。

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：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及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模

式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的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。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b) 后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

– 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

– 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

– 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

– 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内（若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，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，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，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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，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。

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，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，

以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 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。

7.4.4.7 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份额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。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的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。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

根据《基金合同》，基金收益分配原则为：1、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相应类别的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；2、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；3、A 类基金份额和 C 类基金份额之间由于收取费用的不同，将导致在可供分配利润上有所不同；同一类别每一基金份额享有同等分配权；4、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基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配的有关业务规则进行调整，并及时公告。法律法规或监管机构另有规定的，基金管理人在履行适当程序后，将对上述基金收益分配政策进行调整。本基金每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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》、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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	5,825,450.32	3,480,576.19
等于：本金	5,824,593.76	3,480,214.83
加：应计利息	856.56	361.36
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	5,825,450.32	3,480,576.19

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		216,274,428.23	-	210,346,049.79	- 5,928,378.44
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	2,999,760.00	17,884.93	3,023,284.93	5,640.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,999,760.00	17,884.93	3,023,284.93	5,640.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		219,274,188.23	17,884.93	213,369,334.72	- 5,922,738.44
项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		165,704,619.85	-	163,936,426.89	-

					1,768,192.96
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		165,704,619.85	-	163,936,426.89	- 1,768,192.96

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	16,125,765.68	-	-	-
——股指期货	16,125,765.68	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	16,125,765.68	-	-	-
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	18,507,487.78	-	-	-
——股指期货	18,507,487.78	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	18,507,487.78	-	-	-

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《证券投资基金股指期货投资会计核算业务细则（试行）》及《企业会计准则——金融工具列报》的相关规定，“权益衍生工具——股指期货投资”与“证券清算款——股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“权益衍生工具——股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/	合约市值	公允价值变动
----	----	--------	------	--------

		卖)		
IM2501	IM2501	13	15,485,080.00	-640,685.68
合计				-640,685.68
减：可抵销期货暂收款				-640,685.68
净额				0.00

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产期末余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有任何其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	8.61	0.76
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	156,000.00	141,750.00
合计	156,008.61	141,750.76

7.4.7.7 实收基金

兴银中证 1000 指数增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	135,428,115.13	135,428,115.13
本期申购	36,876,335.99	36,876,335.99
本期赎回（以“-”号填列）	-44,126,614.71	-44,126,614.71
本期末	128,177,836.41	128,177,836.41

兴银中证 1000 指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	101,419,348.25	101,419,348.25
本期申购	175,530,784.91	175,530,784.91
本期赎回（以“-”号填列）	-128,005,909.52	-128,005,909.52
本期末	148,944,223.64	148,944,223.64

注：此处申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

兴银中证 1000 指数增强 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-20,997,735.63	-1,390,935.26	-22,388,670.89
本期期初	-20,997,735.63	-1,390,935.26	-22,388,670.89
本期利润	7,172,547.71	-3,220,669.10	3,951,878.61
本期基金份额交易产生的变动数	1,893,614.87	-91,040.82	1,802,574.05
其中：基金申购款	-6,454,954.97	582,606.15	-5,872,348.82
基金赎回款	8,348,569.84	-673,646.97	7,674,922.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-11,931,573.05	-4,702,645.18	-16,634,218.23

兴银中证 1000 指数增强 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-16,050,292.45	-1,039,862.10	-17,090,154.55
本期期初	-16,050,292.45	-1,039,862.10	-17,090,154.55
本期利润	7,422,044.11	-1,728,354.28	5,693,689.83
本期基金份额交易产生的变动数	-6,014,671.56	-2,669,068.00	-8,683,739.56
其中：基金申购款	-33,627,240.28	1,377,949.43	-32,249,290.85
基金赎回款	27,612,568.72	-4,047,017.43	23,565,551.29

本期已分配利润	-	-	-
本期末	-14,642,919.90	-5,437,284.38	-20,080,204.28

7.4.7.9 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	25,578.72	8,710.17
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	94,515.41	161,108.29
其他	-	-
合计	120,094.13	169,818.46

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	2,891,260,735.96	3,312,476,623.04
减：卖出股票成本总额	2,876,003,982.37	3,314,757,953.48
减：交易费用	2,843,326.22	4,424,322.59
买卖股票差价收入	12,413,427.37	-6,705,653.03

7.4.7.10.2 股票投资收益——证券出借差价收入

注：基金在本报告期及上年度可比期间无股票投资证券出借差价收入。

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	5,253.70	-
债券投资收益——买卖债券 （债转股及债券到期兑付）差 价收入	-30.12	-
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	5,223.58	-

注：本基金在上年度可比期间无债券投资收益。

7.4.7.11.2 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期 兑付）成交总额	-	-
减：卖出债券（债转股及债券 到期兑付）成本总额	-	-
减：应计利息总额	-	-
减：交易费用	30.12	-
买卖债券差价收入	-30.12	-

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

注：本基金在本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.13 贵金属投资收益

注：本基金在本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金在本报告期及上年度可比期间无买卖权证收益。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	1,846,141.90	-351,722.22
减：其他衍生工具收益应缴纳 增值税	53,771.12	40,851.85
减：交易费用	8,502.93	9,986.80
合计	1,783,867.85	-402,560.87

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	2,352,034.92	2,473,862.56

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	2,352,034.92	2,473,862.56

7.4.7.16 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-4,154,545.48	6,268,173.40
——股票投资	-4,160,185.48	6,268,173.40
——债券投资	5,640.00	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-794,477.90	520,192.22
——权证投资	-	-
——期货投资	-794,477.90	520,192.22
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	-4,949,023.38	6,788,365.62

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	188,889.04	156,221.72
转换费收入	819.95	613.26
合计	189,708.99	156,834.98

7.4.7.18 信用减值损失

注：本基金在本报告期及上年度可比期间无信用减值损失。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	36,000.00	43,500.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-

其他	90.00	—
合计	156,090.00	163,500.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

7.4.9.1 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。

7.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：本基金与关联方的所有交易均是在正常业务中按照一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华福证券	5,817,341,235.84	100.00%	6,578,144,092.11	100.00%

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
华福证券	2,999,760.00	100.00%	-	-

注：本基金上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.4 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
华福证券	2,000,000.00	100.00%	-	-

注：本基金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。

7.4.10.1.5 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 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华福证券	1,369,452.61	100.00%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华福证券	1,614,036.80	100.00%	0.00	0.00%

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

2、2024 年 7 月 1 日前，该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。自 2024 年 7 月 1 日起，券商为本基金提供的服务按证监会相关规定执行。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
----	--	---

当期发生的基金应支付的管理费	1,538,953.76	1,753,744.40
其中：应支付销售机构的客户维护费	759,668.39	864,911.42
应支付基金管理人的净管理费	779,285.37	888,832.98

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.8% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	384,738.52	438,436.12

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.2.3 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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴银中证 1000 指数增强 A	兴银中证 1000 指数增强 C	合计
华福证券	-	176,712.21	176,712.21
平安银行	-	931.95	931.95
合计	-	177,644.16	177,644.16
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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴银中证 1000 指数增强 A	兴银中证 1000 指数增强 C	合计
华福证券	-	175,149.42	175,149.42
平安银行	-	1,269.69	1,269.69
合计	-	176,419.11	176,419.11

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 0.2%，销售服务费计提的计算公式如下：

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间与关联方未进行银行间同业市场债券（含回购）的交易。

7.4.10.4 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

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

注：本基金在本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

注：本基金在本报告期及上年度可比期间与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行	5,825,450.32	25,578.72	3,480,576.19	8,710.17

注：本基金通过“平安银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于华福证券有限责任公司的结算备付金，于 2024 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 13,387,427.08 元。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及创业板股票需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

于 2024 年 12 月 31 日，本基金未持有因认购新发或增发证券而受上述规定约束的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002379	宏创控股	2024-12-23	重大事项	8.97	2025-01-07	9.87	4,400	33,588.69	39,468.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无银行间市场债券正回购。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：于 2024 年 12 月 31 日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

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

7.4.13.2.1 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。本基金上年度末未持有需按短期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

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

7.4.13.2.3 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。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末和上年度末均未持有需按长期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

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

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有需按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 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 7.4.12 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。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

7.4.13.3.2 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 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	5,825,450.32	-	-	-	-	-	5,825,450.32
结算备付金	17,291,356.02	-	-	-	-	-	17,291,356.02
存出保证金	1,858,209.60	-	-	-	-	-	1,858,209.60
交易性金融资产	-	-	3,023,284.93	-	-	210,346,049.79	213,369,334.72
应收申购款	-	-	-	-	-	2,771,235.31	2,771,235.31
资产总计	24,975,015.94	-	3,023,284.93	-	-	213,117,285.10	241,115,585.97
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	338,770.29	338,770.29
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	153,052.02	153,052.02
应付托管费	-	-	-	-	-	38,263.02	38,263.02
应付销售服务费	-	-	-	-	-	19,286.91	19,286.91
应交税费	-	-	-	-	-	2,567.58	2,567.58
其他负债	-	-	-	-	-	156,008.61	156,008.61
负债总计	-	-	-	-	-	707,948.43	707,948.43
利率敏感度缺口	24,975,015.94	-	3,023,284.93	-	-	212,409,336.67	240,407,637.54

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	3,480,576.19	-	-	-	-	-	3,480,576.19
结算备付金	28,096,003.10	-	-	-	-	-	28,096,003.10
存出保证金	2,239,353.60	-	-	-	-	-	2,239,353.60
交易性金融资产	-	-	-	-	-	163,936,426.89	163,936,426.89
应收申购款	-	-	-	-	-	309,008.89	309,008.89
资产总计	33,815,932.89	-	-	-	-	164,245,435.78	198,061,368.67
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	369,403.21	369,403.21
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	133,886.39	133,886.39
应付托管费	-	-	-	-	-	33,471.58	33,471.58
应付销售服务费	-	-	-	-	-	14,218.79	14,218.79
其他负债	-	-	-	-	-	141,750.76	141,750.76
负债总计	-	-	-	-	-	692,730.73	692,730.73
利率敏感度缺口	33,815,932.89	-	-	-	-	163,552,705.05	197,368,637.94

7.4.13.4.1.2 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 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	-4, 217. 93	-
	市场利率下降 25 个基点	4, 226. 10	-

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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币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。

本基金为指数增强型股票基金，采取定量方法进行组合管理。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 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	210, 346, 049. 79	87. 50	163, 936, 426. 89	83. 06
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	3, 023, 284. 93	1. 26	-	-
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	213, 369, 334. 72	88. 75	163, 936, 426. 89	83. 06

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	以沪深 300 指数为基准衡量其他价格风险，且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 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日

	沪深 300 指数上涨 5%	13,357,671.20	6,356,673.24
	沪深 300 指数下跌 5%	-13,357,671.20	-6,356,673.24

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	210,306,581.79	163,167,282.64
第二层次	3,062,752.93	168,317.62
第三层次	-	600,826.63
合计	213,369,334.72	163,936,426.89

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	600,826.63	600,826.63
当期购买	-	81,014.24	81,014.24
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	624,926.19	624,926.19
当期利得或损失总额	-	-56,914.68	-56,914.68
其中：计入损益的利得或损失	-	-56,914.68	-56,914.68
计入其他综合收益的利得或损	-	-	-

失			
期末余额	-	0	0
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-
项目	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	639,222.60	639,222.60
当期购买	-	919,487.81	919,487.81
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	1,166,416.14	1,166,416.14
当期利得或损失总额	-	208,532.36	208,532.36
其中：计入损益的利得或损失	-	208,532.36	208,532.36
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	600,826.63	600,826.63
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	119,834.82	119,834.82

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	600,826.63	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1462-2.1775	负相关

注：本基金于本报告期末未持有第三层次公允价值计量的金融资产。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 12 月 31 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)。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2024 年 12 月 31 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	210,346,049.79	87.24
	其中：股票	210,346,049.79	87.24
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,023,284.93	1.25
	其中：债券	3,023,284.93	1.25
	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	23,116,806.34	9.59
8	其他各项资产	4,629,444.91	1.92
9	合计	241,115,585.97	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,020,068.00	0.42
B	采矿业	4,022,472.59	1.67
C	制造业	116,261,028.35	48.36

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,282,200.60	2.20
E	建筑业	3,301,175.00	1.37
F	批发和零售业	5,099,999.96	2.12
G	交通运输、仓储和邮政业	7,975,665.51	3.32
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,069,283.64	8.35
J	金融业	3,343,591.87	1.39
K	房地产业	2,821,074.00	1.17
L	租赁和商务服务业	2,168,199.00	0.90
M	科学研究和技术服务业	1,414,047.76	0.59
N	水利、环境和公共设施管理业	3,201,715.40	1.33
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	325,745.00	0.14
R	文化、体育和娱乐业	951,289.00	0.40
S	综合	-	-
	合计	177,257,555.68	73.73

8.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	318,812.00	0.13
B	采矿业	685,959.00	0.29
C	制造业	23,619,111.67	9.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,180,025.00	0.49
E	建筑业	514,104.00	0.21
F	批发和零售业	987,077.00	0.41
G	交通运输、仓储和邮政业	666,041.00	0.28
H	住宿和餐饮业	56,080.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,568,945.20	1.07
J	金融业	643,094.00	0.27
K	房地产业	277,337.00	0.12
L	租赁和商务服务业	380,705.00	0.16
M	科学研究和技术服务业	571,587.24	0.24
N	水利、环境和公共设施管理业	382,887.00	0.16
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	179,139.00	0.07
S	综合	57,590.00	0.02
	合计	33,088,494.11	13.76

8.2.3 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。

8.3 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

8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	300674	宇信科技	51,200	999,424.00	0.42
2	002550	千红制药	159,600	989,520.00	0.41
3	600037	歌华有线	129,700	967,562.00	0.40
4	600216	浙江医药	59,200	938,912.00	0.39
5	600718	东软集团	87,000	936,990.00	0.39
6	600266	城建发展	182,600	931,260.00	0.39
7	002100	天康生物	141,600	927,480.00	0.39
8	600531	豫光金铅	141,700	909,714.00	0.38
9	300232	洲明科技	128,700	884,169.00	0.37
10	300039	上海凯宝	142,600	881,268.00	0.37
11	300115	长盈精密	54,200	880,208.00	0.37
12	300151	昌红科技	50,900	865,300.00	0.36
13	600664	哈药股份	208,600	861,518.00	0.36
14	300088	长信科技	130,700	854,778.00	0.36
15	301175	中科环保	157,000	847,800.00	0.35
16	002567	唐人神	165,000	841,500.00	0.35
17	002745	木林森	96,000	837,120.00	0.35
18	002446	盛路通信	127,500	835,125.00	0.35
19	300463	迈克生物	63,100	832,920.00	0.35
20	300031	宝通科技	45,400	831,728.00	0.35
21	301050	雷电微力	15,920	821,153.60	0.34
22	600874	创业环保	136,900	817,293.00	0.34
23	300682	朗新集团	66,900	816,180.00	0.34
24	600138	中青旅	80,400	815,256.00	0.34
25	300475	香农芯创	28,600	814,814.00	0.34
26	000885	城发环境	61,880	811,246.80	0.34
27	601333	广深铁路	236,100	809,823.00	0.34
28	002004	华邦健康	178,300	805,916.00	0.34
29	000030	富奥股份	156,500	802,845.00	0.33
30	603358	华达科技	23,900	798,260.00	0.33
31	300613	富瀚微	13,600	795,600.00	0.33
32	000968	蓝焰控股	119,400	794,010.00	0.33
33	000966	长源电力	165,500	786,125.00	0.33
34	600017	日照港	244,100	781,120.00	0.32
35	002023	海特高新	76,800	779,520.00	0.32

36	000685	中山公用	84,100	776,243.00	0.32
37	002215	诺普信	68,700	771,501.00	0.32
38	601678	滨化股份	203,600	765,536.00	0.32
39	300737	科顺股份	150,000	760,500.00	0.32
40	300170	汉得信息	61,100	757,640.00	0.32
41	301339	通行宝	37,200	756,648.00	0.31
42	600478	科力远	182,600	754,138.00	0.31
43	000686	东北证券	94,700	751,918.00	0.31
44	600114	东睦股份	46,200	747,054.00	0.31
45	300083	创世纪	113,800	740,838.00	0.31
46	600552	凯盛科技	62,200	709,702.00	0.30
47	600850	电科数字	28,200	673,980.00	0.28
48	002378	章源钨业	103,290	668,286.30	0.28
49	603118	共进股份	73,900	657,710.00	0.27
50	688403	汇成股份	73,241	656,239.36	0.27
51	688127	蓝特光学	23,846	646,226.60	0.27
52	600987	航民股份	92,800	644,032.00	0.27
53	002036	联创电子	68,500	643,900.00	0.27
54	605376	博迁新材	22,200	642,690.00	0.27
55	600366	宁波韵升	87,200	641,792.00	0.27
56	601069	西部黄金	55,200	632,040.00	0.26
57	600133	东湖高新	67,000	626,450.00	0.26
58	600783	鲁信创投	49,301	624,643.67	0.26
59	601311	骆驼股份	75,000	621,750.00	0.26
60	603766	隆鑫通用	68,100	619,710.00	0.26
61	000828	东莞控股	57,900	618,951.00	0.26
62	000881	中广核技	83,900	614,987.00	0.26
63	600420	国药现代	51,500	614,910.00	0.26
64	002099	海翔药业	119,000	614,040.00	0.26
65	002399	海普瑞	57,400	613,606.00	0.26
66	300181	佐力药业	39,900	612,864.00	0.25
67	300079	数码视讯	111,600	603,756.00	0.25
68	601200	上海环境	73,380	599,514.60	0.25
69	002847	盐津铺子	9,500	594,700.00	0.25
70	300406	九强生物	44,400	593,184.00	0.25
71	300183	东软载波	30,600	592,110.00	0.25
72	002626	金达威	39,200	591,920.00	0.25
73	300188	国投智能	42,900	591,591.00	0.25
74	000990	诚志股份	75,900	588,225.00	0.24
75	600248	陕建股份	131,000	586,880.00	0.24
76	002249	大洋电机	99,500	584,065.00	0.24
77	601369	陕鼓动力	67,100	583,770.00	0.24
78	600618	氯碱化工	59,200	583,712.00	0.24

79	002020	京新药业	45,300	579,840.00	0.24
80	002461	珠江啤酒	58,600	579,554.00	0.24
81	603496	恒为科技	21,300	578,934.00	0.24
82	688123	聚辰股份	9,886	578,528.72	0.24
83	688209	英集芯	32,733	578,392.11	0.24
84	002726	龙大美食	72,500	574,200.00	0.24
85	600338	西藏珠峰	53,800	574,046.00	0.24
86	300180	华峰超纤	91,100	573,930.00	0.24
87	002705	新宝股份	38,200	573,000.00	0.24
88	300768	迪普科技	32,700	572,250.00	0.24
89	000019	深粮控股	87,100	572,247.00	0.24
90	300811	铂科新材	10,600	571,446.00	0.24
91	603439	贵州三力	43,900	570,700.00	0.24
92	600269	赣粤高速	101,400	568,854.00	0.24
93	600305	恒顺醋业	71,200	568,176.00	0.24
94	002061	浙江交科	138,600	565,488.00	0.24
95	603609	禾丰股份	65,400	563,748.00	0.23
96	600459	贵研铂业	40,945	562,174.85	0.23
97	002901	大博医疗	18,200	561,288.00	0.23
98	600063	皖维高新	139,600	558,400.00	0.23
99	002212	天融信	86,300	556,635.00	0.23
100	300627	华测导航	13,300	555,940.00	0.23
101	300857	协创数据	5,200	555,828.00	0.23
102	000758	中色股份	112,300	554,762.00	0.23
103	300303	聚飞光电	79,600	542,872.00	0.23
104	002539	云图控股	69,400	542,708.00	0.23
105	603169	兰石重装	99,100	540,095.00	0.22
106	600623	华谊集团	77,100	539,700.00	0.22
107	600639	浦东金桥	48,500	538,350.00	0.22
108	300327	中颖电子	21,900	535,893.00	0.22
109	000035	中国天楹	110,000	535,700.00	0.22
110	002967	广电计量	32,600	534,640.00	0.22
111	600572	康恩贝	114,700	534,502.00	0.22
112	300657	弘信电子	23,500	532,510.00	0.22
113	000488	晨鸣纸业	174,500	532,225.00	0.22
114	603025	大豪科技	34,700	529,175.00	0.22
115	603308	应流股份	37,500	528,750.00	0.22
116	000930	中粮科技	95,200	528,360.00	0.22
117	002489	浙江永强	162,900	527,796.00	0.22
118	603612	索通发展	39,000	526,890.00	0.22
119	300821	东岳硅材	67,800	526,128.00	0.22
120	600645	中源协和	27,200	524,960.00	0.22
121	600557	康缘药业	38,500	524,370.00	0.22

122	002421	达实智能	152,200	522,046.00	0.22
123	600827	百联股份	47,700	521,361.00	0.22
124	688362	甬矽电子	15,207	512,171.76	0.21
125	002097	山河智能	68,100	510,750.00	0.21
126	601279	英利汽车	133,100	509,773.00	0.21
127	300415	伊之密	25,400	509,524.00	0.21
128	000672	上峰水泥	66,400	507,960.00	0.21
129	600151	航天机电	63,600	507,528.00	0.21
130	300926	博俊科技	23,000	506,230.00	0.21
131	603920	世运电路	17,200	505,680.00	0.21
132	300602	飞荣达	26,300	505,486.00	0.21
133	002468	申通快递	49,800	504,474.00	0.21
134	688798	艾为电子	7,217	503,890.94	0.21
135	600328	中盐化工	63,800	502,106.00	0.21
136	688128	中国电研	23,816	500,374.16	0.21
137	603236	移远通信	7,300	499,612.00	0.21
138	600882	妙可蓝多	27,900	499,410.00	0.21
139	300315	掌趣科技	90,500	497,750.00	0.21
140	300261	雅本化学	72,400	495,940.00	0.21
141	300598	诚迈科技	10,200	493,680.00	0.21
142	300596	利安隆	16,100	491,050.00	0.20
143	000875	吉电股份	93,000	489,180.00	0.20
144	000550	江铃汽车	20,800	487,760.00	0.20
145	300666	江丰电子	7,000	486,150.00	0.20
146	688766	普冉股份	4,800	486,048.00	0.20
147	002498	汉缆股份	142,600	483,414.00	0.20
148	600020	中原高速	114,300	482,346.00	0.20
149	000688	国城矿业	40,300	479,167.00	0.20
150	000029	深深房 A	31,800	478,908.00	0.20
151	002053	云南能投	41,900	477,660.00	0.20
152	000791	甘肃能源	78,900	475,767.00	0.20
153	300323	华灿光电	56,900	471,132.00	0.20
154	603299	苏盐井神	41,500	462,310.00	0.19
155	300253	卫宁健康	64,100	458,956.00	0.19
156	600575	淮河能源	114,300	453,771.00	0.19
157	002326	永太科技	49,800	445,212.00	0.19
158	600125	铁龙物流	71,400	423,402.00	0.18
159	300747	锐科激光	21,700	415,772.00	0.17
160	600728	佳都科技	88,400	413,712.00	0.17
161	002706	良信股份	53,300	409,344.00	0.17
162	600640	国脉文化	34,200	408,348.00	0.17
163	601801	皖新传媒	55,400	406,636.00	0.17
164	603989	艾华集团	26,600	401,128.00	0.17

165	300702	天宇股份	23,920	398,507.20	0.17
166	600961	株冶集团	49,600	390,352.00	0.16
167	600428	中远海特	53,200	388,360.00	0.16
168	600399	抚顺特钢	66,800	387,440.00	0.16
169	603588	高能环境	72,800	381,472.00	0.16
170	002651	利君股份	51,500	377,495.00	0.16
171	600273	嘉化能源	47,200	376,184.00	0.16
172	002668	TCL 智家	28,600	375,232.00	0.16
173	000970	中科三环	36,000	373,320.00	0.16
174	300398	飞凯材料	23,600	371,936.00	0.15
175	300226	上海钢联	16,000	365,920.00	0.15
176	600452	涪陵电力	34,140	361,542.60	0.15
177	000048	京基智农	20,000	360,000.00	0.15
178	600662	外服控股	70,800	358,956.00	0.15
179	300679	电连技术	6,000	358,200.00	0.15
180	600033	福建高速	91,900	356,572.00	0.15
181	601107	四川成渝	67,900	355,117.00	0.15
182	002649	博彦科技	29,300	355,116.00	0.15
183	688300	联瑞新材	5,496	353,942.40	0.15
184	002237	恒邦股份	35,000	353,500.00	0.15
185	301262	海看股份	14,200	353,154.00	0.15
186	600869	远东股份	74,200	352,450.00	0.15
187	600267	海正药业	42,300	351,090.00	0.15
188	300570	太辰光	4,800	348,960.00	0.15
189	002139	拓邦股份	25,300	344,333.00	0.14
190	002204	大连重工	69,000	343,620.00	0.14
191	002545	东方铁塔	48,600	341,658.00	0.14
192	002243	力合科创	42,200	340,132.00	0.14
193	300634	彩讯股份	15,600	340,080.00	0.14
194	688289	圣湘生物	14,959	339,569.30	0.14
195	688270	臻镭科技	9,700	339,500.00	0.14
196	000917	电广传媒	48,000	339,360.00	0.14
197	603876	鼎胜新材	38,300	338,955.00	0.14
198	688029	南微医学	5,000	337,950.00	0.14
199	000869	张裕 A	14,500	336,255.00	0.14
200	603583	捷昌驱动	13,600	336,056.00	0.14
201	603013	亚普股份	22,300	334,054.00	0.14
202	301205	联特科技	4,400	333,036.00	0.14
203	301511	德福科技	26,300	330,328.00	0.14
204	002698	博实股份	19,300	328,100.00	0.14
205	601208	东材科技	43,300	326,482.00	0.14
206	600648	外高桥	27,400	326,334.00	0.14
207	600835	上海机电	18,200	326,144.00	0.14

208	300244	迪安诊断	28,700	325,745.00	0.14
209	603638	艾迪精密	19,200	324,288.00	0.13
210	000913	钱江摩托	18,000	324,180.00	0.13
211	002091	江苏国泰	44,200	323,544.00	0.13
212	300034	钢研高纳	20,700	322,920.00	0.13
213	300856	科思股份	12,600	322,812.00	0.13
214	000762	西藏矿业	15,000	322,500.00	0.13
215	600100	同方股份	45,348	322,424.28	0.13
216	600217	中再资环	60,700	321,710.00	0.13
217	600211	西藏药业	8,700	321,378.00	0.13
218	605599	菜百股份	28,200	320,070.00	0.13
219	300352	北信源	60,500	319,440.00	0.13
220	600330	天通股份	44,700	317,370.00	0.13
221	603983	丸美生物	9,800	316,148.00	0.13
222	000528	柳 工	26,200	315,972.00	0.13
223	688389	普门科技	21,135	314,700.15	0.13
224	301327	华宝新能	4,100	314,511.00	0.13
225	300618	寒锐钴业	9,300	314,061.00	0.13
226	000415	渤海租赁	82,700	311,779.00	0.13
227	600320	振华重工	79,500	311,640.00	0.13
228	000582	北部湾港	39,400	310,472.00	0.13
229	002946	新乳业	21,200	307,612.00	0.13
230	301078	孩子王	26,700	303,846.00	0.13
231	300772	运达股份	22,900	303,196.00	0.13
232	000090	天健集团	73,700	302,907.00	0.13
233	002154	报 喜 鸟	67,600	298,116.00	0.12
234	603055	台华新材	26,900	298,052.00	0.12
235	603100	川仪股份	13,800	297,390.00	0.12
236	300393	中来股份	47,300	295,625.00	0.12
237	000012	南 玻 A	55,900	295,152.00	0.12
238	002544	普天科技	13,700	293,591.00	0.12
239	002267	陕天然气	34,600	292,370.00	0.12
240	600894	广日股份	20,000	292,000.00	0.12
241	002011	盾安环境	27,000	291,870.00	0.12
242	688066	航天宏图	14,300	291,720.00	0.12
243	600596	新安股份	33,200	291,496.00	0.12
244	300409	道氏技术	21,400	291,254.00	0.12
245	300492	华图山鼎	4,000	291,200.00	0.12
246	600055	万东医疗	19,275	291,052.50	0.12
247	600633	浙数文化	27,800	290,788.00	0.12
248	600780	通宝能源	51,600	290,508.00	0.12
249	600996	贵广网络	33,800	288,990.00	0.12
250	688347	华虹公司	6,200	288,114.00	0.12

251	601890	亚星锚链	36,900	287,451.00	0.12
252	300035	中科电气	19,200	287,040.00	0.12
253	600562	国睿科技	14,400	286,992.00	0.12
254	300166	东方国信	30,500	286,700.00	0.12
255	300762	上海瀚讯	13,600	286,008.00	0.12
256	300869	康泰医学	20,500	285,770.00	0.12
257	688548	广钢气体	28,365	285,635.55	0.12
258	000503	国新健康	26,000	285,480.00	0.12
259	600195	中牧股份	42,300	283,833.00	0.12
260	688007	光峰科技	19,186	283,760.94	0.12
261	300080	易成新能	64,900	283,613.00	0.12
262	600480	凌云股份	26,200	283,222.00	0.12
263	300663	科蓝软件	16,300	282,968.00	0.12
264	300171	东富龙	21,300	282,864.00	0.12
265	603636	南威软件	26,900	282,450.00	0.12
266	000766	通化金马	17,900	281,030.00	0.12
267	603881	数据港	12,380	280,407.00	0.12
268	300687	赛意信息	15,400	280,280.00	0.12
269	300451	创业慧康	62,200	278,656.00	0.12
270	300638	广和通	13,800	278,070.00	0.12
271	002948	青岛银行	70,900	275,092.00	0.11
272	600966	博汇纸业	52,900	272,964.00	0.11
273	300705	九典制药	15,200	272,840.00	0.11
274	002043	兔宝宝	22,900	272,052.00	0.11
275	600993	马应龙	10,400	271,544.00	0.11
276	300726	宏达电子	8,700	270,570.00	0.11
277	002755	奥赛康	21,200	269,452.00	0.11
278	301217	铜冠铜箔	24,100	267,028.00	0.11
279	601068	中铝国际	60,500	266,805.00	0.11
280	600717	天津港	54,773	266,744.51	0.11
281	300457	赢合科技	13,900	266,046.00	0.11
282	002839	张家港行	60,860	265,958.20	0.11
283	002127	南极电商	60,400	265,760.00	0.11
284	601886	江河集团	49,200	265,680.00	0.11
285	002534	西子洁能	23,900	265,529.00	0.11
286	688568	中科星图	5,200	265,356.00	0.11
287	600409	三友化工	49,100	265,140.00	0.11
288	000543	皖能电力	33,500	264,985.00	0.11
289	002060	广东建工	72,400	264,984.00	0.11
290	002190	成飞集成	13,700	264,958.00	0.11
291	605333	沪光股份	8,100	264,303.00	0.11
292	002434	万里扬	42,500	263,500.00	0.11
293	600363	联创光电	5,500	263,340.00	0.11

294	600604	市北高新	55,300	263,228.00	0.11
295	300735	光弘科技	9,400	263,106.00	0.11
296	600158	中体产业	31,800	262,986.00	0.11
297	600094	大名城	72,200	262,808.00	0.11
298	603218	日月股份	21,800	262,690.00	0.11
299	300257	开山股份	28,800	262,656.00	0.11
300	300620	光库科技	5,400	262,440.00	0.11
301	603123	翠微股份	32,600	262,430.00	0.11
302	002859	洁美科技	12,600	261,450.00	0.11
303	002588	史丹利	35,400	261,252.00	0.11
304	000901	航天科技	23,800	261,086.00	0.11
305	002101	广东鸿图	21,700	259,966.00	0.11
306	601022	宁波远洋	32,300	259,369.00	0.11
307	002222	福晶科技	8,000	259,200.00	0.11
308	600643	爱建集团	50,100	259,017.00	0.11
309	603383	顶点软件	6,900	258,750.00	0.11
310	603327	福蓉科技	21,300	258,582.00	0.11
311	688432	有研硅	22,873	258,464.90	0.11
312	300236	上海新阳	6,900	257,853.00	0.11
313	003039	顺控发展	19,700	257,676.00	0.11
314	688050	爱博医疗	2,830	257,614.90	0.11
315	603877	太平鸟	17,400	257,520.00	0.11
316	300761	立华股份	13,200	256,872.00	0.11
317	300456	赛微电子	14,900	255,982.00	0.11
318	601969	海南矿业	36,051	255,601.59	0.11
319	688183	生益电子	6,497	255,072.22	0.11
320	301090	华润材料	36,700	254,698.00	0.11
321	600667	太极实业	36,800	254,656.00	0.11
322	600335	国机汽车	40,752	253,884.96	0.11
323	300641	正丹股份	10,200	253,368.00	0.11
324	688351	微电生理	13,293	253,098.72	0.11
325	300123	亚光科技	43,600	252,880.00	0.11
326	603888	新华网	11,300	252,442.00	0.11
327	601015	陕西黑猫	75,400	251,836.00	0.10
328	603690	至纯科技	10,000	251,100.00	0.10
329	688596	正帆科技	7,030	249,916.50	0.10
330	002123	梦网科技	23,100	249,711.00	0.10
331	688352	颀中科技	20,583	249,671.79	0.10
332	688110	东芯股份	9,936	247,406.40	0.10
333	600210	紫江企业	37,400	247,214.00	0.10
334	002265	建设工业	10,600	246,662.00	0.10
335	688131	皓元医药	6,900	246,330.00	0.10
336	000088	盐田港	50,300	244,961.00	0.10

337	600908	无锡银行	41,300	244,083.00	0.10
338	688107	安路科技	8,244	243,857.52	0.10
339	600559	老白干酒	11,600	243,484.00	0.10
340	603283	赛腾股份	3,500	242,060.00	0.10
341	301216	万凯新材	23,700	241,740.00	0.10
342	001213	中铁特货	57,900	241,443.00	0.10
343	000089	深圳机场	34,900	240,461.00	0.10
344	002245	蔚蓝锂芯	22,400	239,456.00	0.10
345	603693	江苏新能	24,300	239,355.00	0.10
346	688315	诺禾致源	19,082	238,525.00	0.10
347	000422	湖北宜化	18,900	238,518.00	0.10
348	000761	本钢板材	74,500	238,400.00	0.10
349	688630	芯碁微装	4,124	238,037.28	0.10
350	688523	航天环宇	11,900	238,000.00	0.10
351	000025	特力A	14,400	237,888.00	0.10
352	603368	柳药集团	13,300	237,538.00	0.10
353	000736	中交地产	27,600	237,360.00	0.10
354	601515	东峰集团	59,200	235,616.00	0.10
355	002985	北摩高科	10,000	235,000.00	0.10
356	603328	依顿电子	23,800	234,668.00	0.10
357	600864	哈投股份	31,900	234,465.00	0.10
358	002174	游族网络	25,000	233,750.00	0.10
359	300672	国科微	3,500	233,625.00	0.10
360	688383	新益昌	5,200	233,324.00	0.10
361	600120	浙江东方	49,900	232,534.00	0.10
362	603093	南华期货	19,500	232,050.00	0.10
363	603477	巨星农牧	13,000	230,750.00	0.10
364	688016	心脉医疗	2,100	230,685.00	0.10
365	300576	容大感光	5,100	230,418.00	0.10
366	300049	福瑞股份	7,300	230,242.00	0.10
367	000681	视觉中国	11,000	229,020.00	0.10
368	688100	威胜信息	6,300	228,060.00	0.09
369	600577	精达股份	30,800	224,532.00	0.09
370	002351	漫步者	13,600	224,400.00	0.09
371	603083	剑桥科技	5,400	219,240.00	0.09
372	300655	晶瑞电材	21,900	204,984.00	0.09
373	000062	深圳华强	8,700	194,880.00	0.08
374	002906	华阳集团	6,000	184,500.00	0.08
375	603162	海通发展	16,700	153,640.00	0.06
376	002194	武汉凡谷	13,400	150,348.00	0.06
377	002851	麦格米特	2,400	147,504.00	0.06
378	000680	山推股份	14,900	144,530.00	0.06
379	601126	四方股份	8,200	139,072.00	0.06

380	603599	广信股份	11,500	138,575.00	0.06
381	301039	中集车辆	14,500	131,225.00	0.05
382	688608	恒玄科技	400	130,148.00	0.05
383	300685	艾德生物	5,700	129,960.00	0.05
384	300770	新媒股份	3,200	129,312.00	0.05
385	688200	华峰测控	1,216	127,072.00	0.05
386	603317	天味食品	9,500	126,730.00	0.05
387	688190	云路股份	1,352	124,384.00	0.05
388	000429	粤高速 A	8,300	122,010.00	0.05
389	002991	甘源食品	1,300	121,576.00	0.05
390	002324	普利特	12,600	120,078.00	0.05
391	688208	道通科技	2,964	116,070.24	0.05
392	002063	远光软件	20,100	115,776.00	0.05
393	600750	江中药业	4,900	111,230.00	0.05
394	002130	沃尔核材	4,400	111,100.00	0.05
395	002895	川恒股份	4,500	110,700.00	0.05
396	002390	信邦制药	23,600	107,380.00	0.04
397	000829	天音控股	8,100	106,758.00	0.04
398	601811	新华文轩	6,700	106,195.00	0.04
399	600710	苏美达	11,400	106,020.00	0.04
400	002484	江海股份	6,000	105,480.00	0.04
401	603306	华懋科技	3,300	104,313.00	0.04
402	601975	招商南油	33,200	103,916.00	0.04
403	300579	数字认证	3,300	103,686.00	0.04
404	003006	百亚股份	4,300	103,157.00	0.04
405	688318	财富趋势	600	102,600.00	0.04
406	600729	重庆百货	3,500	102,375.00	0.04
407	688392	骄成超声	2,503	102,122.40	0.04
408	000951	中国重汽	6,000	101,880.00	0.04
409	688019	安集科技	729	101,593.44	0.04
410	601101	昊华能源	12,300	101,229.00	0.04
411	002327	富安娜	11,400	100,776.00	0.04
412	300525	博思软件	6,400	99,712.00	0.04
413	300026	红日药业	26,200	99,298.00	0.04
414	300119	瑞普生物	5,400	99,198.00	0.04
415	688484	南芯科技	2,716	97,884.64	0.04
416	601096	宏盛华源	22,300	97,005.00	0.04
417	603075	热威股份	5,200	96,876.00	0.04
418	001311	多利科技	3,700	95,423.00	0.04
419	688279	峰昭科技	600	94,620.00	0.04
420	301015	百洋医药	3,900	94,419.00	0.04
421	002978	安宁股份	3,300	93,786.00	0.04
422	002125	湘潭电化	9,300	93,744.00	0.04

423	600012	皖通高速	5,300	93,545.00	0.04
424	600550	保变电气	11,600	91,060.00	0.04
425	000581	威孚高科	4,800	90,624.00	0.04
426	600548	深高速	6,700	90,316.00	0.04
427	600059	古越龙山	10,000	88,800.00	0.04
428	001308	康冠科技	3,200	88,000.00	0.04
429	002605	姚记科技	3,300	87,978.00	0.04
430	002151	北斗星通	3,300	87,582.00	0.04
431	605577	龙版传媒	6,000	87,180.00	0.04
432	300470	中密控股	2,300	86,710.00	0.04
433	002416	爱施德	5,300	86,231.00	0.04
434	300855	图南股份	3,900	85,488.00	0.04
435	002911	佛燃能源	6,700	84,688.00	0.04
436	002925	盈趣科技	5,400	84,564.00	0.04
437	600223	福瑞达	11,000	83,160.00	0.03
438	301035	润丰股份	1,700	82,824.00	0.03
439	600621	华鑫股份	5,000	82,400.00	0.03
440	600285	羚锐制药	3,700	81,992.00	0.03
441	603005	晶方科技	2,900	81,925.00	0.03
442	002233	塔牌集团	10,600	81,302.00	0.03
443	601882	海天精工	3,700	81,141.00	0.03
444	002270	华明装备	4,800	81,072.00	0.03
445	002088	鲁阳节能	6,300	80,577.00	0.03
446	603871	嘉友国际	4,160	80,496.00	0.03
447	002158	汉钟精机	4,300	79,636.00	0.03
448	688150	莱特光电	3,500	78,820.00	0.03
449	601702	华峰铝业	4,300	78,776.00	0.03
450	300623	捷捷微电	2,300	78,568.00	0.03
451	601163	三角轮胎	5,200	78,364.00	0.03
452	600123	兰花科创	9,100	77,896.00	0.03
453	002701	奥瑞金	13,700	77,679.00	0.03
454	300298	三诺生物	3,000	77,430.00	0.03
455	603730	岱美股份	8,600	77,314.00	0.03
456	002048	宁波华翔	6,100	76,982.00	0.03
457	603279	景津装备	4,300	76,884.00	0.03
458	600456	宝钛股份	2,700	76,815.00	0.03
459	600916	中国黄金	8,900	76,718.00	0.03
460	603919	金徽酒	3,900	76,440.00	0.03
461	301207	华兰疫苗	4,300	75,293.00	0.03
462	300841	康华生物	1,379	75,183.08	0.03
463	688526	科前生物	5,258	75,136.82	0.03
464	600259	广晟有色	2,700	75,087.00	0.03
465	002315	焦点科技	1,800	75,024.00	0.03

466	688366	昊海生科	1,238	74,998.04	0.03
467	603043	广州酒家	4,500	74,835.00	0.03
468	605296	神农集团	2,700	74,790.00	0.03
469	300741	华宝股份	4,300	74,777.00	0.03
470	000735	罗牛山	11,200	74,592.00	0.03
471	688348	昱能科技	1,500	73,200.00	0.03
472	000767	晋控电力	28,800	72,864.00	0.03
473	688531	日联科技	1,524	72,588.12	0.03
474	002096	易普力	6,100	72,468.00	0.03
475	601038	一拖股份	4,900	72,422.00	0.03
476	000935	四川双马	5,000	72,400.00	0.03
477	002302	西部建设	11,000	72,380.00	0.03
478	001696	宗申动力	2,900	72,210.00	0.03
479	000156	华数传媒	10,000	72,000.00	0.03
480	300820	英杰电气	1,300	71,825.00	0.03
481	600477	杭萧钢构	27,400	70,418.00	0.03
482	000795	英洛华	7,225	70,299.25	0.03
483	600201	生物股份	10,200	69,972.00	0.03
484	603866	桃李面包	10,600	69,960.00	0.03
485	688631	莱斯信息	800	69,672.00	0.03
486	300130	新国都	3,200	69,312.00	0.03
487	301029	怡合达	2,800	69,216.00	0.03
488	301348	蓝箭电子	2,700	69,174.00	0.03
489	000801	四川九洲	4,800	68,688.00	0.03
490	301095	广立微	1,300	67,691.00	0.03
491	301171	易点天下	2,400	67,656.00	0.03
492	600064	南京高科	8,300	64,491.00	0.03
493	002891	中宠股份	1,800	64,260.00	0.03
494	603039	泛微网络	1,300	63,700.00	0.03
495	000498	山东路桥	10,500	62,475.00	0.03
496	603466	风语筑	6,700	62,444.00	0.03
497	000969	安泰科技	5,600	62,440.00	0.03
498	000603	盛达资源	5,200	62,348.00	0.03
499	605589	圣泉集团	2,600	61,308.00	0.03
500	300459	汤姆猫	10,600	60,844.00	0.03
501	002145	中核钛白	14,275	60,526.00	0.03
502	000682	东方电子	5,600	59,976.00	0.02
503	000928	中钢国际	9,400	59,878.00	0.02
504	002597	金禾实业	2,600	59,358.00	0.02
505	000902	新洋丰	4,400	57,376.00	0.02
506	002773	康弘药业	2,900	56,840.00	0.02
507	600388	龙净环保	4,400	55,660.00	0.02
508	002585	双星新材	10,400	55,536.00	0.02

509	002226	江南化工	10,200	55,284.00	0.02
510	603533	掌阅科技	2,700	54,837.00	0.02
511	300366	创意信息	5,700	53,010.00	0.02
512	688372	伟测科技	713	41,724.76	0.02
513	688696	极米科技	400	39,208.00	0.02
514	688167	炬光科技	600	38,220.00	0.02
515	688185	康希诺	600	36,630.00	0.02
516	688522	纳睿雷达	600	33,804.00	0.01
517	688326	经纬恒润	400	33,640.00	0.01
518	301031	中熔电气	300	31,206.00	0.01
519	688048	长光华芯	800	31,192.00	0.01
520	688409	富创精密	600	30,942.00	0.01
521	603337	杰克股份	1,000	30,460.00	0.01
522	688686	奥普特	400	30,244.00	0.01
523	603699	纽威股份	1,300	28,821.00	0.01
524	002003	伟星股份	2,000	28,340.00	0.01
525	600458	时代新材	2,200	28,182.00	0.01
526	688658	悦康药业	1,950	28,099.50	0.01
527	002214	大立科技	2,500	27,875.00	0.01
528	000848	承德露露	3,100	27,807.00	0.01
529	001301	尚太科技	400	27,420.00	0.01
530	688337	普源精电	700	27,300.00	0.01
531	002010	传化智联	6,000	27,180.00	0.01
532	688116	天奈科技	700	27,167.00	0.01
533	605507	国邦医药	1,300	27,079.00	0.01
534	600422	昆药集团	1,700	26,945.00	0.01
535	300482	万孚生物	1,200	26,892.00	0.01
536	601222	林洋能源	3,800	26,866.00	0.01
537	300363	博腾股份	1,700	26,809.00	0.01
538	600649	城投控股	6,000	26,700.00	0.01
539	688586	江航装备	2,770	26,508.90	0.01
540	601528	瑞丰银行	4,700	26,461.00	0.01
541	300357	我武生物	1,300	26,416.00	0.01
542	000065	北方国际	2,700	26,406.00	0.01
543	601137	博威合金	1,300	26,390.00	0.01
544	300827	上能电气	600	26,340.00	0.01
545	688261	东微半导	626	26,285.74	0.01
546	002108	沧州明珠	7,300	26,207.00	0.01
547	600323	瀚蓝环境	1,100	25,982.00	0.01
548	300861	美畅股份	1,300	25,935.00	0.01
549	601949	中国出版	3,600	25,848.00	0.01
550	002332	仙琚制药	2,600	25,844.00	0.01
551	600449	宁夏建材	1,700	25,534.00	0.01

552	300776	帝尔激光	400	25,432.00	0.01
553	600782	新钢股份	7,600	25,384.00	0.01
554	002254	泰和新材	2,700	25,380.00	0.01
555	300438	鹏辉能源	900	25,299.00	0.01
556	301367	怡和嘉业	400	25,200.00	0.01
557	000837	秦川机床	2,800	25,116.00	0.01
558	600163	中闽能源	4,100	24,969.00	0.01
559	600461	洪城环境	2,500	24,875.00	0.01
560	002274	华昌化工	3,200	24,864.00	0.01
561	301376	致欧科技	1,300	24,856.00	0.01
562	300850	新强联	1,300	24,843.00	0.01
563	002928	华夏航空	3,200	24,832.00	0.01
564	002396	星网锐捷	1,300	24,687.00	0.01
565	300455	航天智装	1,900	24,624.00	0.01
566	002993	奥海科技	600	24,600.00	0.01
567	688141	杰华特	800	24,488.00	0.01
568	002807	江阴银行	5,600	24,360.00	0.01
569	002126	银轮股份	1,300	24,336.00	0.01
570	603323	苏农银行	4,600	24,334.00	0.01
571	002837	英维克	600	24,240.00	0.01
572	002987	京北方	1,700	24,191.00	0.01
573	002913	奥士康	1,000	24,110.00	0.01
574	002777	久远银海	1,400	24,108.00	0.01
575	600502	安徽建工	5,000	23,900.00	0.01
576	002242	九阳股份	2,300	23,828.00	0.01
577	300101	振芯科技	1,100	23,826.00	0.01
578	600821	金开新能	4,400	23,760.00	0.01
579	001322	箭牌家居	2,900	23,461.00	0.01
580	688779	五矿新能	4,400	23,408.00	0.01
581	002183	怡 亚 通	5,200	23,348.00	0.01
582	300568	星源材质	2,400	23,328.00	0.01
583	002675	东诚药业	1,900	23,218.00	0.01
584	300346	南大光电	600	23,154.00	0.01
585	001236	弘业期货	2,400	23,136.00	0.01
586	002458	益生股份	2,400	23,064.00	0.01
587	300045	华力创通	1,100	22,979.00	0.01
588	603997	继峰股份	2,000	22,900.00	0.01
589	001270	铖昌科技	600	22,860.00	0.01
590	688388	嘉元科技	1,548	22,802.04	0.01
591	301363	美好医疗	700	22,694.00	0.01
592	002537	海联金汇	3,900	22,425.00	0.01
593	600446	金证股份	1,300	22,412.00	0.01
594	601963	重庆银行	2,400	22,272.00	0.01

595	603530	神马电力	900	22,239.00	0.01
596	002497	雅化集团	1,900	22,230.00	0.01
597	300036	超图软件	1,300	22,074.00	0.01
598	300443	金雷股份	1,100	21,912.00	0.01
599	002833	弘亚数控	1,300	21,879.00	0.01
600	603267	鸿远电子	600	21,738.00	0.01
601	600997	开滦股份	3,200	21,632.00	0.01
602	000597	东北制药	4,100	21,607.00	0.01
603	000059	华锦股份	4,500	21,555.00	0.01
604	300432	富临精工	1,400	21,532.00	0.01
605	301559	中集环科	1,400	21,490.00	0.01
606	603171	税友股份	700	21,350.00	0.01
607	603678	火炬电子	700	21,350.00	0.01
608	301155	海力风电	400	21,324.00	0.01
609	002612	朗姿股份	1,300	21,268.00	0.01
610	000657	中钨高新	2,300	21,183.00	0.01
611	300416	苏试试验	1,800	21,168.00	0.01
612	300379	东方通	1,400	21,126.00	0.01
613	002761	浙江建投	2,400	21,072.00	0.01
614	688097	博众精工	798	20,947.50	0.01
615	601187	厦门银行	3,700	20,868.00	0.01
616	688206	概伦电子	1,100	20,801.00	0.01
617	002171	楚江新材	2,500	20,500.00	0.01
618	300284	苏交科	2,000	20,300.00	0.01
619	002518	科士达	900	20,277.00	0.01
620	300725	药石科技	600	20,160.00	0.01
621	301180	万祥科技	1,300	20,111.00	0.01
622	600006	东风股份	2,700	19,899.00	0.01
623	301268	铭利达	1,200	19,896.00	0.01
624	300777	中简科技	700	19,803.00	0.01
625	003012	东鹏控股	2,800	18,508.00	0.01
626	001914	招商积余	1,700	17,969.00	0.01
627	001309	德明利	200	17,440.00	0.01
628	688322	奥比中光	264	12,276.00	0.01
629	601326	秦港股份	200	670.00	0.00
630	600929	雪天盐业	87	486.33	0.00

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	000050	深天马 A	15,700	141,771.00	0.06

2	300048	合康新能	27,300	137,592.00	0.06
3	300172	中电环保	27,200	137,360.00	0.06
4	688079	美迪凯	15,829	137,079.14	0.06
5	603158	腾龙股份	16,900	136,552.00	0.06
6	600268	国电南自	20,200	135,744.00	0.06
7	601555	东吴证券	17,300	134,940.00	0.06
8	002546	新联电子	31,000	134,230.00	0.06
9	300369	绿盟科技	18,600	133,734.00	0.06
10	300241	瑞丰光电	24,100	132,309.00	0.06
11	300565	科信技术	11,000	131,890.00	0.05
12	688093	世华科技	5,812	117,344.28	0.05
13	300449	汉邦高科	14,700	115,395.00	0.05
14	300545	联得装备	3,600	112,788.00	0.05
15	600980	北矿科技	7,300	111,544.00	0.05
16	600573	惠泉啤酒	9,900	111,474.00	0.05
17	300636	同和药业	13,900	110,783.00	0.05
18	300228	富瑞特装	15,700	110,685.00	0.05
19	300471	厚普股份	11,700	110,682.00	0.05
20	603385	惠达卫浴	17,400	110,664.00	0.05
21	002615	哈尔斯	13,900	110,505.00	0.05
22	601008	连云港	28,800	110,304.00	0.05
23	603727	博迈科	9,600	110,208.00	0.05
24	603161	科华控股	10,600	110,134.00	0.05
25	002671	龙泉股份	24,300	110,079.00	0.05
26	002863	今飞凯达	23,600	109,504.00	0.05
27	603098	森特股份	11,400	109,440.00	0.05
28	600433	冠豪高新	34,500	109,365.00	0.05
29	600684	珠江股份	33,100	109,230.00	0.05
30	000548	湖南投资	21,200	109,180.00	0.05
31	603987	康德莱	15,200	109,136.00	0.05
32	603177	德创环保	14,800	108,928.00	0.05
33	300194	福安药业	24,400	108,824.00	0.05
34	603823	百合花	11,700	108,810.00	0.05
35	600180	瑞茂通	25,300	108,790.00	0.05
36	300342	天银机电	6,700	108,741.00	0.05
37	600495	晋西车轴	28,600	108,680.00	0.05
38	300400	劲拓股份	6,700	108,674.00	0.05
39	300111	向日葵	33,500	108,540.00	0.05
40	603058	永吉股份	12,300	108,486.00	0.05
41	300320	海达股份	11,300	108,480.00	0.05
42	002548	金新农	27,300	108,381.00	0.05
43	603020	爱普股份	14,000	108,360.00	0.05
44	300018	中元股份	16,000	108,320.00	0.05

45	300289	利德曼	22,100	108,290.00	0.05
46	300065	海兰信	13,200	108,240.00	0.05
47	301332	德尔玛	10,800	108,216.00	0.05
48	300247	融捷健康	30,200	108,116.00	0.04
49	300190	维尔利	30,800	108,108.00	0.04
50	300158	振东制药	25,000	108,000.00	0.04
51	300069	金利华电	8,200	107,994.00	0.04
52	300132	青松股份	21,900	107,967.00	0.04
53	603079	圣达生物	8,000	107,760.00	0.04
54	300510	金冠股份	25,400	107,696.00	0.04
55	300439	美康生物	10,300	107,635.00	0.04
56	300987	川网传媒	7,600	107,616.00	0.04
57	300248	新开普	11,100	107,559.00	0.04
58	300335	迪森股份	22,300	107,486.00	0.04
59	300271	华宇软件	15,300	107,406.00	0.04
60	301013	利和兴	9,100	106,925.00	0.04
61	300074	华平股份	26,800	106,664.00	0.04
62	600990	四创电子	5,000	106,400.00	0.04
63	300322	硕贝德	8,100	106,191.00	0.04
64	300511	雪榕生物	30,600	106,182.00	0.04
65	300279	和晶科技	17,500	106,050.00	0.04
66	300150	世纪瑞尔	24,200	105,996.00	0.04
67	300721	怡达股份	8,700	105,966.00	0.04
68	300283	温州宏丰	19,300	105,957.00	0.04
69	300011	鼎汉技术	14,500	105,560.00	0.04
70	300507	苏奥传感	15,700	105,190.00	0.04
71	600969	郴电国际	16,300	104,809.00	0.04
72	002636	金安国纪	13,500	104,490.00	0.04
73	603936	博敏电子	12,400	104,408.00	0.04
74	688313	仕佳光子	5,478	89,784.42	0.04
75	002387	维信诺	8,600	88,408.00	0.04
76	601717	郑煤机	6,800	88,264.00	0.04
77	600517	国网英大	16,000	88,160.00	0.04
78	600758	辽宁能源	25,600	88,064.00	0.04
79	600444	国机通用	5,700	86,697.00	0.04
80	600731	湖南海利	15,200	86,640.00	0.04
81	600583	海油工程	15,800	86,426.00	0.04
82	603209	兴通股份	5,400	86,292.00	0.04
83	688260	昀冢科技	6,100	85,095.00	0.04
84	600098	广州发展	13,200	84,744.00	0.04
85	002180	纳思达	3,000	84,510.00	0.04
86	000725	京东方 A	19,200	84,288.00	0.04
87	600746	江苏索普	12,000	84,120.00	0.03

88	601608	中信重工	20,000	84,000.00	0.03
89	603367	辰欣药业	6,100	83,814.00	0.03
90	601089	福元医药	5,200	83,200.00	0.03
91	688468	科美诊断	12,140	83,159.00	0.03
92	600637	东方明珠	10,700	83,032.00	0.03
93	300453	三鑫医疗	11,100	82,806.00	0.03
94	600525	长园集团	16,900	82,472.00	0.03
95	300401	花园生物	5,600	82,096.00	0.03
96	601061	中信金属	11,300	82,038.00	0.03
97	002942	新农股份	5,800	81,896.00	0.03
98	002538	司尔特	14,500	81,490.00	0.03
99	000623	吉林敖东	4,700	81,169.00	0.03
100	300433	蓝思科技	3,700	81,030.00	0.03
101	601728	中国电信	11,200	80,864.00	0.03
102	688659	元琛科技	11,900	80,325.00	0.03
103	300771	智莱科技	7,600	79,952.00	0.03
104	002365	永安药业	10,000	79,900.00	0.03
105	300445	康斯特	4,900	79,723.00	0.03
106	300234	开尔新材	17,000	79,390.00	0.03
107	003020	立方制药	4,400	79,376.00	0.03
108	002250	联化科技	14,400	79,344.00	0.03
109	002923	润都股份	8,300	79,182.00	0.03
110	600351	亚宝药业	13,000	79,170.00	0.03
111	002284	亚太股份	10,200	78,948.00	0.03
112	002724	海洋王	14,300	76,076.00	0.03
113	300476	胜宏科技	1,700	71,553.00	0.03
114	300239	东宝生物	10,500	65,730.00	0.03
115	600714	金瑞矿业	6,700	65,124.00	0.03
116	600191	华资实业	9,300	64,356.00	0.03
117	688660	电气风电	7,100	63,900.00	0.03
118	605080	浙江自然	2,700	63,450.00	0.03
119	603307	扬州金泉	1,700	60,860.00	0.03
120	601888	中国中免	900	60,309.00	0.03
121	603703	盛洋科技	5,400	59,454.00	0.02
122	000417	合百集团	9,300	59,334.00	0.02
123	300435	中泰股份	4,900	59,192.00	0.02
124	002630	华西能源	17,000	59,160.00	0.02
125	300816	艾可蓝	2,300	58,995.00	0.02
126	601566	九牧王	7,000	58,870.00	0.02
127	002912	中新赛克	2,300	58,857.00	0.02
128	300956	英力股份	2,600	58,760.00	0.02
129	600416	湘电股份	5,200	58,708.00	0.02
130	688199	久日新材	3,900	58,695.00	0.02

131	600488	津药药业	13,800	58,512.00	0.02
132	688051	佳华科技	2,800	58,296.00	0.02
133	605169	洪通燃气	5,700	57,969.00	0.02
134	603080	新疆火炬	3,600	57,888.00	0.02
135	002273	水晶光电	2,600	57,772.00	0.02
136	688189	南新制药	8,833	57,767.82	0.02
137	600499	科达制造	7,400	57,720.00	0.02
138	603768	常青股份	4,800	57,696.00	0.02
139	600805	悦达投资	13,000	57,590.00	0.02
140	603527	众源新材	6,000	57,540.00	0.02
141	601579	会稽山	5,200	57,512.00	0.02
142	688510	航亚科技	3,300	57,486.00	0.02
143	300174	元力股份	3,900	57,408.00	0.02
144	300560	中富通	3,700	57,276.00	0.02
145	600356	恒丰纸业	7,500	57,225.00	0.02
146	300656	民德电子	2,300	57,224.00	0.02
147	600704	物产中大	11,300	57,178.00	0.02
148	601177	杭齿前进	6,900	57,132.00	0.02
149	603601	再升科技	17,000	57,120.00	0.02
150	603357	设计总院	6,300	57,078.00	0.02
151	600113	浙江东日	4,100	57,072.00	0.02
152	603978	深圳新星	3,700	57,017.00	0.02
153	000153	丰原药业	9,300	57,009.00	0.02
154	603758	秦安股份	6,900	56,994.00	0.02
155	600237	铜峰电子	8,700	56,985.00	0.02
156	603217	元利科技	3,500	56,980.00	0.02
157	600439	瑞贝卡	16,900	56,953.00	0.02
158	603311	金海高科	5,700	56,943.00	0.02
159	600819	耀皮玻璃	10,600	56,922.00	0.02
160	600846	同济科技	6,600	56,892.00	0.02
161	603858	步长制药	3,600	56,880.00	0.02
162	600493	凤竹纺织	11,000	56,870.00	0.02
163	600200	江苏吴中	6,100	56,852.00	0.02
164	002462	嘉事堂	4,400	56,848.00	0.02
165	600332	白云山	2,000	56,840.00	0.02
166	688505	复旦张江	7,410	56,834.70	0.02
167	603332	苏州龙杰	6,600	56,826.00	0.02
168	601118	海南橡胶	10,500	56,805.00	0.02
169	600262	北方股份	3,100	56,761.00	0.02
170	002106	莱宝高科	5,200	56,732.00	0.02
171	603681	永冠新材	4,400	56,716.00	0.02
172	300797	钢研纳克	4,800	56,688.00	0.02
173	688602	康鹏科技	8,200	56,662.00	0.02

174	600665	天地源	18,100	56,653.00	0.02
175	688221	前沿生物	5,803	56,637.28	0.02
176	300534	陇神戎发	6,500	56,550.00	0.02
177	601002	晋亿实业	13,000	56,550.00	0.02
178	600367	红星发展	4,900	56,546.00	0.02
179	600708	光明地产	15,200	56,544.00	0.02
180	600249	两面针	11,100	56,499.00	0.02
181	300214	日科化学	10,100	56,459.00	0.02
182	300993	玉马遮阳	5,000	56,450.00	0.02
183	600879	航天电子	6,300	56,448.00	0.02
184	603685	晨丰科技	4,800	56,448.00	0.02
185	688597	煜邦电力	5,800	56,434.00	0.02
186	603266	天龙股份	3,500	56,350.00	0.02
187	002448	中原内配	9,000	56,340.00	0.02
188	601958	金钼股份	5,600	56,336.00	0.02
189	688247	宣泰医药	5,600	56,336.00	0.02
190	002367	康力电梯	8,200	56,334.00	0.02
191	600854	春兰股份	12,300	56,334.00	0.02
192	301062	上海艾录	4,300	56,330.00	0.02
193	603006	联明股份	5,400	56,322.00	0.02
194	600592	龙溪股份	5,700	56,316.00	0.02
195	600727	鲁北化工	7,600	56,316.00	0.02
196	603012	创力集团	10,600	56,286.00	0.02
197	688519	南亚新材	2,647	56,275.22	0.02
198	600790	轻纺城	15,000	56,250.00	0.02
199	600051	宁波联合	8,600	56,244.00	0.02
200	600207	安彩高科	12,600	56,196.00	0.02
201	000590	启迪药业	7,900	56,169.00	0.02
202	600130	波导股份	11,900	56,168.00	0.02
203	605339	南侨食品	3,300	56,166.00	0.02
204	603628	清源股份	4,500	56,160.00	0.02
205	600251	冠农股份	7,700	56,133.00	0.02
206	603687	大胜达	7,700	56,133.00	0.02
207	300621	维业股份	5,900	56,109.00	0.02
208	601133	柏诚股份	5,000	56,100.00	0.02
209	601007	金陵饭店	8,000	56,080.00	0.02
210	300344	立方数科	12,600	56,070.00	0.02
211	603810	丰山集团	6,200	56,048.00	0.02
212	600128	苏豪弘业	6,900	56,028.00	0.02
213	601956	东贝集团	11,600	56,028.00	0.02
214	600523	贵航股份	4,700	56,024.00	0.02
215	603698	航天工程	3,600	56,016.00	0.02
216	600703	三安光电	4,600	55,982.00	0.02

217	600570	恒生电子	2,000	55,980.00	0.02
218	300084	海默科技	10,400	55,952.00	0.02
219	603187	海容冷链	5,000	55,950.00	0.02
220	603933	睿能科技	3,600	55,944.00	0.02
221	603577	汇金通	7,000	55,930.00	0.02
222	603538	美诺华	4,400	55,924.00	0.02
223	603967	中创物流	5,700	55,917.00	0.02
224	600152	维科技术	9,300	55,893.00	0.02
225	002451	摩恩电气	8,900	55,892.00	0.02
226	600739	辽宁成大	5,400	55,890.00	0.02
227	002342	巨力索具	17,300	55,879.00	0.02
228	300082	奥克股份	8,900	55,803.00	0.02
229	601700	风范股份	12,400	55,800.00	0.02
230	300201	海伦哲	10,600	55,756.00	0.02
231	600742	一汽富维	6,300	55,755.00	0.02
232	300883	龙利得	10,400	55,744.00	0.02
233	300195	长荣股份	9,900	55,737.00	0.02
234	600362	江西铜业	2,700	55,728.00	0.02
235	300603	立昂技术	5,000	55,700.00	0.02
236	300513	恒实科技	6,100	55,693.00	0.02
237	603221	爱丽家居	6,100	55,693.00	0.02
238	600644	乐山电力	9,100	55,692.00	0.02
239	600722	金牛化工	11,900	55,692.00	0.02
240	600636	国新文化	6,000	55,680.00	0.02
241	603222	济民健康	8,200	55,678.00	0.02
242	600061	国投资本	7,400	55,648.00	0.02
243	300050	世纪鼎利	10,400	55,640.00	0.02
244	603168	莎普爱思	8,300	55,610.00	0.02
245	300670	大烨智能	9,600	55,584.00	0.02
246	688038	中科通达	4,574	55,574.10	0.02
247	300055	万邦达	11,600	55,564.00	0.02
248	603060	国检集团	7,600	55,556.00	0.02
249	603551	奥普科技	5,200	55,536.00	0.02
250	688328	深科达	3,707	55,530.86	0.02
251	603011	合锻智能	8,100	55,485.00	0.02
252	300221	银禧科技	9,500	55,480.00	0.02
253	600099	林海股份	6,300	55,440.00	0.02
254	002104	恒宝股份	8,200	55,432.00	0.02
255	300943	春晖智控	4,300	55,427.00	0.02
256	603738	泰晶科技	3,700	55,426.00	0.02
257	001203	大中矿业	6,400	55,424.00	0.02
258	300929	华骐环保	6,700	55,409.00	0.02
259	600192	长城电工	9,600	55,392.00	0.02

260	603618	杭电股份	10,200	55,386.00	0.02
261	300710	万隆光电	3,100	55,366.00	0.02
262	300423	昇辉科技	8,000	55,360.00	0.02
263	603900	莱绅通灵	10,000	55,300.00	0.02
264	600960	渤海汽车	16,600	55,278.00	0.02
265	603066	音飞储存	5,200	55,276.00	0.02
266	603065	宿迁联盛	7,600	55,252.00	0.02
267	603528	多伦科技	7,000	55,160.00	0.02
268	300429	强力新材	4,600	55,154.00	0.02
269	300131	英唐智控	6,800	55,148.00	0.02
270	601599	浙文影业	15,400	55,132.00	0.02
271	300193	佳士科技	6,200	55,118.00	0.02
272	688081	兴图新科	3,500	55,090.00	0.02
273	600105	永鼎股份	11,100	55,056.00	0.02
274	600872	中炬高新	2,500	55,050.00	0.02
275	688418	震有科技	1,887	55,024.92	0.02
276	603212	赛伍技术	5,400	54,972.00	0.02
277	300673	佩蒂股份	3,100	54,963.00	0.02
278	002613	北玻股份	13,600	54,944.00	0.02
279	603696	安记食品	6,700	54,940.00	0.02
280	600379	宝光股份	5,800	54,926.00	0.02
281	600622	光大嘉宝	17,000	54,910.00	0.02
282	300410	正业科技	10,200	54,876.00	0.02
283	600353	旭光电子	7,600	54,872.00	0.02
284	300909	汇创达	2,300	54,855.00	0.02
285	300935	盈建科	2,200	54,802.00	0.02
286	603002	宏昌电子	10,200	54,774.00	0.02
287	300888	稳健医疗	1,300	54,704.00	0.02
288	300907	康平科技	2,600	54,704.00	0.02
289	300219	鸿利智汇	7,300	54,677.00	0.02
290	301033	迈普医学	1,300	54,665.00	0.02
291	603336	宏辉果蔬	12,800	54,656.00	0.02
292	301301	川宁生物	4,600	54,556.00	0.02
293	301379	天山电子	2,700	54,540.00	0.02
294	300864	南大环境	2,600	54,522.00	0.02
295	688508	芯朋微	1,266	54,400.02	0.02
296	688045	必易微	1,700	54,230.00	0.02
297	000544	中原环保	6,200	54,126.00	0.02
298	300032	金龙机电	12,000	54,120.00	0.02
299	000726	鲁泰A	8,300	54,116.00	0.02
300	688073	毕得医药	1,100	54,076.00	0.02
301	002111	威海广泰	4,900	53,998.00	0.02
302	603739	蔚蓝生物	4,500	53,955.00	0.02

303	688699	明微电子	1,500	53,910.00	0.02
304	688334	西高院	3,300	53,889.00	0.02
305	301099	雅创电子	1,300	53,885.00	0.02
306	600288	大恒科技	6,300	53,802.00	0.02
307	300789	唐源电气	3,600	53,784.00	0.02
308	688681	科汇股份	4,987	53,709.99	0.02
309	300708	聚灿光电	4,300	53,707.00	0.02
310	300822	贝仕达克	2,600	53,690.00	0.02
311	300360	炬华科技	3,200	53,664.00	0.02
312	601188	龙江交通	14,900	53,640.00	0.02
313	300270	中威电子	7,500	53,625.00	0.02
314	301439	泓淋电力	3,900	53,625.00	0.02
315	300207	欣旺达	2,400	53,544.00	0.02
316	603106	恒银科技	6,800	53,516.00	0.02
317	002412	汉森制药	8,900	53,489.00	0.02
318	603386	骏亚科技	4,800	53,376.00	0.02
319	300254	仟源医药	6,100	53,375.00	0.02
320	300978	东箭科技	4,900	53,361.00	0.02
321	300203	聚光科技	3,500	53,305.00	0.02
322	300326	凯利泰	8,200	53,300.00	0.02
323	600235	民丰特纸	9,400	53,298.00	0.02
324	002454	松芝股份	8,000	53,200.00	0.02
325	002961	瑞达期货	3,700	53,169.00	0.02
326	300716	泉为科技	4,300	53,148.00	0.02
327	688155	先惠技术	1,400	53,116.00	0.02
328	300922	天秦装备	3,700	53,095.00	0.02
329	601199	江南水务	9,600	53,088.00	0.02
330	002845	同兴达	3,500	53,060.00	0.02
331	301121	紫建电子	1,000	53,060.00	0.02
332	300500	启迪设计	5,000	53,050.00	0.02
333	603856	东宏股份	4,800	53,040.00	0.02
334	601858	中国科传	2,600	52,988.00	0.02
335	300517	海波重科	6,300	52,983.00	0.02
336	300144	宋城演艺	5,700	52,953.00	0.02
337	000900	现代投资	12,000	52,920.00	0.02
338	301370	国科恒泰	4,900	52,920.00	0.02
339	301028	东亚机械	4,900	52,871.00	0.02
340	000554	泰山石油	8,900	52,866.00	0.02
341	300365	恒华科技	8,600	52,804.00	0.02
342	002228	合兴包装	17,600	52,800.00	0.02
343	300885	海昌新材	4,800	52,800.00	0.02
344	603387	基蛋生物	6,400	52,800.00	0.02
345	688401	路维光电	2,000	52,780.00	0.02

346	002206	海 利 得	12,300	52,767.00	0.02
347	600168	武汉控股	11,900	52,717.00	0.02
348	300016	北陆药业	8,500	52,700.00	0.02
349	300752	隆利科技	3,100	52,700.00	0.02
350	688030	山石网科	3,400	52,700.00	0.02
351	688252	天德钰	2,200	52,690.00	0.02
352	300001	特锐德	2,400	52,680.00	0.02
353	300940	南极光	3,900	52,650.00	0.02
354	000551	创元科技	4,400	52,624.00	0.02
355	300485	赛升药业	7,500	52,575.00	0.02
356	002969	嘉美包装	16,900	52,559.00	0.02
357	002590	万安科技	4,300	52,546.00	0.02
358	002788	鹭燕医药	6,400	52,544.00	0.02
359	000404	长虹华意	7,100	52,540.00	0.02
360	300845	捷安高科	4,100	52,521.00	0.02
361	300733	西菱动力	4,500	52,515.00	0.02
362	002645	华宏科技	7,700	52,514.00	0.02
363	300191	潜能恒信	4,100	52,480.00	0.02
364	688136	科兴制药	2,400	52,464.00	0.02
365	002160	常铝股份	14,100	52,452.00	0.02
366	002672	东江环保	12,400	52,452.00	0.02
367	605138	盛泰集团	9,500	52,440.00	0.02
368	002823	凯中精密	3,700	52,429.00	0.02
369	300515	三德科技	4,400	52,404.00	0.02
370	301003	江苏博云	2,400	52,392.00	0.02
371	001332	锡装股份	1,500	52,380.00	0.02
372	300404	博济医药	6,000	52,380.00	0.02
373	600109	国金证券	6,000	52,380.00	0.02
374	000702	正虹科技	7,900	52,377.00	0.02
375	000601	韶能股份	12,900	52,374.00	0.02
376	300970	华绿生物	4,400	52,360.00	0.02
377	002926	华西证券	6,300	52,353.00	0.02
378	002666	德联集团	12,000	52,320.00	0.02
379	601108	财通证券	6,400	52,288.00	0.02
380	300440	运达科技	6,600	52,272.00	0.02
381	300642	透景生命	3,700	52,244.00	0.02
382	300587	天铁股份	11,900	52,241.00	0.02
383	300986	志特新材	4,300	52,202.00	0.02
384	300200	高盟新材	6,300	52,164.00	0.02
385	300140	节能环保	8,700	52,113.00	0.02
386	688663	新风光	2,400	52,104.00	0.02
387	300501	海顺新材	3,900	52,065.00	0.02
388	300539	横河精密	4,900	52,038.00	0.02

389	002522	浙江众成	13,300	52,003.00	0.02
390	300610	晨化股份	5,200	52,000.00	0.02
391	300281	金明精机	9,300	51,987.00	0.02
392	300514	友讯达	3,600	51,984.00	0.02
393	688023	安恒信息	1,273	51,938.40	0.02
394	000960	锡业股份	3,700	51,911.00	0.02
395	688210	统联精密	2,600	51,896.00	0.02
396	002806	华锋股份	4,600	51,888.00	0.02
397	300731	科创新源	2,400	51,864.00	0.02
398	301389	隆扬电子	3,100	51,832.00	0.02
399	301220	亚香股份	1,400	51,828.00	0.02
400	300659	中孚信息	3,200	51,808.00	0.02
401	300611	美力科技	4,900	51,793.00	0.02
402	002982	湘佳股份	2,900	51,765.00	0.02
403	001208	华菱线缆	5,700	51,756.00	0.02
404	002707	众信旅游	7,000	51,730.00	0.02
405	300967	晓鸣股份	4,400	51,700.00	0.02
406	600468	百利电气	11,000	51,700.00	0.02
407	301260	格力博	3,900	51,675.00	0.02
408	002939	长城证券	6,300	51,660.00	0.02
409	300215	电科院	8,700	51,591.00	0.02
410	300684	中石科技	2,300	51,589.00	0.02
411	300790	宇瞳光学	2,700	51,543.00	0.02
412	688512	慧智微	5,200	51,532.00	0.02
413	002500	山西证券	8,200	51,496.00	0.02
414	688109	品茗科技	2,100	51,471.00	0.02
415	301025	读客文化	5,400	51,462.00	0.02
416	688222	成都先导	4,177	51,460.64	0.02
417	300815	玉禾田	3,300	51,447.00	0.02
418	300643	万通智控	4,300	51,428.00	0.02
419	301011	华立科技	2,000	51,380.00	0.02
420	000862	银星能源	10,400	51,376.00	0.02
421	300722	新余国科	1,900	51,338.00	0.02
422	002980	华盛昌	2,000	51,300.00	0.02
423	300350	华鹏飞	9,500	51,300.00	0.02
424	688158	优刻得	3,662	51,194.76	0.02
425	300306	远方信息	4,400	51,040.00	0.02
426	300916	朗特智能	1,700	51,000.00	0.02
427	300951	博硕科技	1,700	50,779.00	0.02
428	300631	久吾高科	2,400	50,640.00	0.02
429	301020	密封科技	2,700	50,625.00	0.02
430	300662	科锐国际	2,400	50,544.00	0.02
431	300302	同有科技	3,200	50,432.00	0.02

432	600261	阳光照明	15,400	50,358.00	0.02
433	301102	兆讯传媒	4,600	50,278.00	0.02
434	300743	天地数码	3,300	50,259.00	0.02
435	688381	帝奥微	2,600	50,128.00	0.02
436	688567	孚能科技	4,300	49,880.00	0.02
437	688316	青云科技	1,472	49,312.00	0.02
438	002801	微光股份	2,000	48,920.00	0.02
439	688173	希荻微	4,400	48,752.00	0.02
440	688307	中润光学	1,952	46,848.00	0.02
441	603817	海峡环保	8,000	44,640.00	0.02
442	688099	晶晨股份	644	44,229.92	0.02
443	688195	腾景科技	1,076	43,233.68	0.02
444	300849	锦盛新材	3,000	42,150.00	0.02
445	300806	斯迪克	3,100	40,145.00	0.02
446	002379	宏创控股	4,400	39,468.00	0.02
447	600959	江苏有线	11,700	39,195.00	0.02
448	300585	奥联电子	2,600	37,336.00	0.02
449	000039	中集集团	4,600	35,742.00	0.01
450	002294	信立泰	1,100	34,023.00	0.01
451	300054	鼎龙股份	1,300	33,826.00	0.01
452	000883	湖北能源	6,700	33,366.00	0.01
453	002353	杰瑞股份	900	33,291.00	0.01
454	002128	电投能源	1,700	33,286.00	0.01
455	600141	兴发集团	1,500	32,550.00	0.01
456	002931	锋龙股份	2,000	32,520.00	0.01
457	002442	龙星化工	5,400	32,454.00	0.01
458	601168	西部矿业	2,000	32,140.00	0.01
459	000559	万向钱潮	5,200	31,980.00	0.01
460	000060	中金岭南	6,800	31,892.00	0.01
461	603129	春风动力	200	31,414.00	0.01
462	688550	瑞联新材	1,000	31,290.00	0.01
463	002202	金风科技	3,000	30,990.00	0.01
464	600820	隧道股份	4,300	30,917.00	0.01
465	600380	健康元	2,700	30,429.00	0.01
466	600521	华海药业	1,700	30,379.00	0.01
467	601156	东航物流	1,800	30,366.00	0.01
468	688425	铁建重工	6,900	30,360.00	0.01
469	600582	天地科技	4,900	30,282.00	0.01
470	600578	京能电力	8,600	30,272.00	0.01
471	600406	国电南瑞	1,200	30,264.00	0.01
472	600496	精工钢构	10,000	30,200.00	0.01
473	600887	伊利股份	1,000	30,180.00	0.01
474	002857	三晖电气	2,400	30,144.00	0.01

475	688009	中国通号	4,800	30,048.00	0.01
476	601668	中国建筑	5,000	30,000.00	0.01
477	002768	国恩股份	1,300	29,991.00	0.01
478	002653	海思科	900	29,925.00	0.01
479	600008	首创环保	9,100	29,848.00	0.01
480	600528	中铁工业	3,700	29,822.00	0.01
481	002831	裕同科技	1,100	29,810.00	0.01
482	600219	南山铝业	7,600	29,716.00	0.01
483	603115	海星股份	2,300	29,693.00	0.01
484	688378	奥来德	1,300	29,653.00	0.01
485	002140	东华科技	3,000	29,640.00	0.01
486	002984	森麒麟	1,200	29,592.00	0.01
487	600968	海油发展	6,900	29,463.00	0.01
488	002064	华峰化学	3,600	29,448.00	0.01
489	601106	中国一重	10,100	29,391.00	0.01
490	300825	阿尔特	2,600	29,380.00	0.01
491	603416	信捷电气	700	29,365.00	0.01
492	000425	徐工机械	3,700	29,341.00	0.01
493	000975	山金国际	1,900	29,203.00	0.01
494	600998	九州通	5,700	29,184.00	0.01
495	002532	天山铝业	3,700	29,119.00	0.01
496	600282	南钢股份	6,200	29,078.00	0.01
497	300950	德固特	1,800	29,070.00	0.01
498	601117	中国化学	3,500	29,015.00	0.01
499	600096	云天化	1,300	28,990.00	0.01
500	601808	中海油服	1,900	28,975.00	0.01
501	000729	燕京啤酒	2,400	28,896.00	0.01
502	002293	罗莱生活	3,700	28,860.00	0.01
503	600795	国电电力	6,300	28,854.00	0.01
504	002440	闰土股份	4,300	28,853.00	0.01
505	600284	浦东建设	4,600	28,842.00	0.01
506	600352	浙江龙盛	2,800	28,812.00	0.01
507	003013	地铁设计	1,900	28,728.00	0.01
508	002385	大北农	6,600	28,578.00	0.01
509	002001	新 和 成	1,300	28,561.00	0.01
510	600642	申能股份	3,000	28,470.00	0.01
511	600690	海尔智家	1,000	28,470.00	0.01
512	002138	顺络电子	900	28,332.00	0.01
513	600018	上港集团	4,600	28,152.00	0.01
514	000598	兴蓉环境	3,700	28,083.00	0.01
515	601918	新集能源	3,900	28,002.00	0.01
516	000997	新 大 陆	1,400	27,930.00	0.01
517	600497	驰宏锌锗	5,000	27,850.00	0.01

518	601006	大秦铁路	4,100	27,798.00	0.01
519	000401	冀东水泥	5,300	27,719.00	0.01
520	688509	正元地信	6,980	27,710.60	0.01
521	003816	中国广核	6,700	27,671.00	0.01
522	000739	普洛药业	1,700	27,642.00	0.01
523	603916	苏博特	3,700	27,602.00	0.01
524	300648	星云股份	1,200	27,600.00	0.01
525	600737	中粮糖业	2,700	27,567.00	0.01
526	600339	中油工程	7,700	27,566.00	0.01
527	300808	久量股份	1,200	27,564.00	0.01
528	603600	永艺股份	2,300	27,347.00	0.01
529	688772	珠海冠宇	1,700	27,336.00	0.01
530	002035	华帝股份	3,700	27,158.00	0.01
531	000959	首钢股份	8,900	27,145.00	0.01
532	600901	江苏金租	5,200	27,144.00	0.01
533	300508	维宏股份	1,000	27,050.00	0.01
534	300628	亿联网络	700	27,020.00	0.01
535	600875	东方电气	1,700	27,013.00	0.01
536	300558	贝达药业	500	26,965.00	0.01
537	002696	百洋股份	5,700	26,961.00	0.01
538	300408	三环集团	700	26,957.00	0.01
539	600312	平高电气	1,400	26,880.00	0.01
540	002262	恩华药业	1,100	26,785.00	0.01
541	002414	高德红外	3,600	26,748.00	0.01
542	002556	辉隆股份	4,800	26,736.00	0.01
543	002057	中钢天源	3,700	26,714.00	0.01
544	600308	华泰股份	7,300	26,572.00	0.01
545	601615	明阳智能	2,100	26,481.00	0.01
546	600183	生益科技	1,100	26,455.00	0.01
547	002758	浙农股份	3,000	26,250.00	0.01
548	002300	太阳电缆	4,900	26,166.00	0.01
549	002368	太极股份	1,100	26,048.00	0.01
550	003018	金富科技	2,800	25,928.00	0.01
551	600361	创新新材	6,700	25,862.00	0.01
552	000636	风华高科	1,800	25,830.00	0.01
553	688496	清越科技	3,000	25,710.00	0.01
554	002441	众业达	3,300	25,674.00	0.01
555	301086	鸿富瀚	500	25,435.00	0.01
556	603173	福斯达	1,100	25,355.00	0.01
557	000423	东阿阿胶	400	25,088.00	0.01
558	000963	华东医药	700	24,220.00	0.01
559	601601	中国太保	700	23,856.00	0.01
560	300246	宝莱特	3,600	23,724.00	0.01

561	002858	力盛体育	1,900	21,736.00	0.01
562	688584	上海合晶	1,081	21,144.36	0.01
563	601968	宝钢包装	4,100	20,295.00	0.01
564	601966	玲珑轮胎	1,100	19,844.00	0.01
565	002382	蓝帆医疗	3,700	18,981.00	0.01
566	300259	新天科技	3,700	12,950.00	0.01
567	601698	中国卫通	400	8,160.00	0.00
568	601618	中国中冶	2,000	6,600.00	0.00
569	002876	三利谱	100	2,566.00	0.00
570	300540	蜀道装备	100	2,452.00	0.00
571	301032	新柴股份	200	1,878.00	0.00
572	300402	宝色股份	100	1,475.00	0.00
573	002166	莱茵生物	100	747.00	0.00
574	000565	渝三峡 A	100	541.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	002004	华邦健康	5,306,778.00	2.69
2	688128	中国电研	5,072,731.10	2.57
3	600717	天津港	5,036,579.82	2.55
4	002498	汉缆股份	4,962,022.00	2.51
5	600366	宁波韵升	4,906,517.00	2.49
6	300183	东软载波	4,839,975.00	2.45
7	600059	古越龙山	4,810,933.00	2.44
8	002706	良信股份	4,808,952.70	2.44
9	300406	九强生物	4,807,879.00	2.44
10	000758	中色股份	4,779,376.00	2.42
11	600575	淮河能源	4,778,387.00	2.42
12	600531	豫光金铅	4,771,540.00	2.42
13	603055	台华新材	4,769,588.00	2.42
14	300232	洲明科技	4,754,940.00	2.41
15	603733	仙鹤股份	4,737,142.00	2.40
16	603888	新华网	4,731,330.00	2.40
17	601969	海南矿业	4,680,339.68	2.37
18	300602	飞荣达	4,675,529.59	2.37
19	601678	滨化股份	4,664,985.00	2.36
20	002267	陕天然气	4,583,753.00	2.32
21	600874	创业环保	4,515,840.00	2.29
22	601311	骆驼股份	4,515,706.00	2.29
23	300303	聚飞光电	4,514,009.00	2.29

24	002020	京新药业	4,504,129.98	2.28
25	600993	马应龙	4,416,805.00	2.24
26	300035	中科电气	4,406,079.00	2.23
27	600850	电科数字	4,404,041.00	2.23
28	300409	道氏技术	4,391,091.00	2.22
29	002250	联化科技	4,389,718.15	2.22
30	002063	远光软件	4,385,905.00	2.22
31	000968	蓝焰控股	4,371,471.00	2.21
32	300031	宝通科技	4,359,153.00	2.21
33	300319	麦捷科技	4,334,426.00	2.20
34	600478	科力远	4,325,538.00	2.19
35	600459	贵研铂业	4,324,944.08	2.19
36	300638	广和通	4,321,424.20	2.19
37	603612	索通发展	4,303,322.00	2.18
38	603583	捷昌驱动	4,284,249.00	2.17
39	600037	歌华有线	4,279,971.00	2.17
40	300702	天宇股份	4,275,650.01	2.17
41	000928	中钢国际	4,255,199.78	2.16
42	002099	海翔药业	4,234,822.00	2.15
43	600662	外服控股	4,220,565.00	2.14
44	603113	金能科技	4,219,022.00	2.14
45	600710	苏美达	4,202,321.00	2.13
46	600248	陕建股份	4,201,783.00	2.13
47	300457	赢合科技	4,190,910.00	2.12
48	601886	江河集团	4,182,290.00	2.12
49	603766	隆鑫通用	4,168,815.00	2.11
50	002011	盾安环境	4,123,687.00	2.09
51	688209	英集芯	4,121,290.81	2.09
52	300369	绿盟科技	4,103,703.00	2.08
53	603530	神马电力	4,100,780.89	2.08
54	600810	神马股份	4,099,680.35	2.08
55	600776	东方通信	4,094,078.00	2.07
56	300737	科顺股份	4,080,333.80	2.07
57	600577	精达股份	4,079,303.00	2.07
58	300352	北信源	4,076,827.00	2.07
59	603328	依顿电子	4,072,566.00	2.06
60	603368	柳药集团	4,065,185.00	2.06
61	600929	雪天盐业	4,055,375.52	2.05
62	000030	富奥股份	4,050,275.00	2.05
63	300463	迈克生物	4,049,751.00	2.05
64	000828	东莞控股	4,043,143.00	2.05
65	300180	华峰超纤	4,016,173.00	2.03
66	000035	中国天楹	4,015,544.00	2.03

67	002946	新乳业	4,014,122.00	2.03
68	300475	香农芯创	3,977,593.00	2.02

8.4.2 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	600059	古越龙山	5,070,864.79	2.57
2	600717	天津港	5,054,363.18	2.56
3	603733	仙鹤股份	4,868,377.00	2.47
4	600575	淮河能源	4,836,549.00	2.45
5	002498	汉缆股份	4,771,855.00	2.42
6	002004	华邦健康	4,758,255.00	2.41
7	603055	台华新材	4,744,144.00	2.40
8	000928	中钢国际	4,656,633.11	2.36
9	600577	精达股份	4,647,463.00	2.35
10	002063	远光软件	4,605,806.93	2.33
11	300319	麦捷科技	4,602,513.00	2.33
12	688128	中国电研	4,585,838.84	2.32
13	002267	陕天然气	4,561,357.00	2.31
14	300035	中科电气	4,541,223.00	2.30
15	601969	海南矿业	4,523,336.79	2.29
16	600366	宁波韵升	4,488,597.60	2.27
17	300638	广和通	4,480,433.00	2.27
18	300303	聚飞光电	4,477,563.03	2.27
19	603888	新华网	4,458,456.00	2.26
20	300183	东软载波	4,454,364.11	2.26
21	600810	神马股份	4,423,762.00	2.24
22	603328	依顿电子	4,415,802.00	2.24
23	603113	金能科技	4,389,298.00	2.22
24	000758	中色股份	4,383,928.00	2.22
25	600710	苏美达	4,374,020.00	2.22
26	002706	良信股份	4,364,972.00	2.21
27	300406	九强生物	4,356,623.00	2.21
28	300409	道氏技术	4,341,679.55	2.20
29	603766	隆鑫通用	4,341,658.00	2.20
30	600929	雪天盐业	4,329,348.00	2.19
31	002250	联化科技	4,321,824.00	2.19
32	600993	马应龙	4,269,516.00	2.16
33	603583	捷昌驱动	4,262,585.00	2.16
34	300232	洲明科技	4,244,681.53	2.15
35	603530	神马电力	4,243,247.00	2.15
36	601678	滨化股份	4,187,703.00	2.12

37	600776	东方通信	4,177,596.99	2.12
38	000969	安泰科技	4,166,523.00	2.11
39	002274	华昌化工	4,163,200.90	2.11
40	600531	豫光金铅	4,158,660.00	2.11
41	300602	飞荣达	4,145,795.00	2.10
42	601886	江河集团	4,097,522.00	2.08
43	601311	骆驼股份	4,050,200.20	2.05
44	300369	绿盟科技	4,014,319.00	2.03
45	002011	盾安环境	4,005,770.59	2.03
46	002135	东南网架	4,000,689.00	2.03
47	600850	电科数字	3,999,954.00	2.03
48	300323	华灿光电	3,993,192.00	2.02
49	002020	京新药业	3,987,388.00	2.02
50	002544	普天科技	3,969,294.00	2.01

8.4.3 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	2,926,573,790.75
卖出股票收入（成交）总额	2,891,260,735.96

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	3,023,284.93	1.26
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,023,284.93	1.26

8.6 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	019749	24 国债 15	30,000	3,023,284.93	1.26

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

运用衍生品捕捉利率变动的波段交易机会，并通过期现套利、跨期套利和跨品种套利等择机增厚收益，同时灵活调整组合敞口，控制回撤。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包含国债期货，无相关投资政策。

8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

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

报告期内，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

无。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,858,209.60
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	2,771,235.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,629,444.91

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
兴银中证 1000 指数增强 A	2,078	61,683.27	5,103,113.75	3.98%	123,074,722.66	96.02%
兴银中证 1000 指数增强 C	3,107	47,938.28	977,046.35	0.66%	147,967,177.29	99.34%
合计	5,185	53,446.88	6,080,160.10	2.19%	271,041,899.95	97.81%

9.2 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	兴银中证 1000 指数增	1,299,529.53	1.013849%

人员持有本基金	强 A		
	兴银中证 1000 指数增强 C	211.25	0.000142%
	合计	1,299,740.78	0.469014%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	兴银中证 1000 指数增强 A	0
	兴银中证 1000 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	兴银中证 1000 指数增强 A	>100
	兴银中证 1000 指数增强 C	0
	合计	>100

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	兴银中证 1000 指数增强 A	兴银中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日（2022 年 01 月 26 日）基金份额总额	170,524,346.65	97,896,229.17
本报告期期初基金份额总额	135,428,115.13	101,419,348.25
本报告期基金总申购份额	36,876,335.99	175,530,784.91
减：本报告期基金总赎回份额	44,126,614.71	128,005,909.52
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	128,177,836.41	148,944,223.64

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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) 基金管理人于 2024 年 4 月 20 日公告，吴真子女士担任公司督察长，郑瑞健先生不再担任公司督察长。
- (2) 基金管理人于 2024 年 7 月 23 日公告，陈晓毅先生担任公司首席信息官，董事长吴若曼女士代为履行公司总经理职务，赵建兴先生不再担任公司总经理及首席信息官。
- (3) 基金管理人于 2024 年 12 月 21 日公告，沈阳女士不再担任公司副总经理。
- (4) 2024 年 12 月 9 日，根据工作安排，宋菁女士不再担任平安银行股份有限公司资产托管部副总经理。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

无。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自合同生效日（2022 年 1 月 26 日）起聘请毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。本报告期内本基金应付审计费 36,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内，基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华福证券	2	5,817,341,235.84	100.00%	1,369,452.61	100.00%	-

注：基金租用证券公司交易单元的选择标准是：

- (1) 内部管理规范、严谨；具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (2) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能够针对基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；
- (3) 能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动资源，协助基金投资；
- (4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

选择程序：本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选证券公司的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的证券公司。

11.7.2 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
华福证券	2,999,760.00	100.00%	2,000,000.00	100.00%	-	-	-	-

11.8 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	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	上海证券报、证券日报、证券	2024-03-28

	下部分基金 2023 年年度报告提示性公告	时报、中国证券报	
4	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	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	兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金基金经理变更公告	证券时报、指定网站	2024-04-26
11	兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）（2024 年第 1 号）、兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金基金产品资料概要（A 类份额）（更新）、兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金基金产品资料概要（C 类份额）（更新）	指定网站、中数平台	2024-04-30
12	兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金基金经理变更公告	证券时报、指定网站	2024-05-01
13	兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）（2024 年第 2 号）、兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金基金产品资料概要（A 类份额）（更新）、兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金基金产品资料概要（C 类份额）（更新）	指定网站、中数平台	2024-05-07
14	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
15	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
16	基金产品资料概要（更新）	指定网站、中数平台	2024-06-20

17	关于旗下部分基金在招商银行开通基金转换业务的公告	上海证券报、证券时报、证券日报、中国证券报、指定网站	2024-07-04
18	2024 年 2 季度报告	指定网站	2024-07-19
19	兴银基金管理有限责任公司旗下基金 2024 年第 2 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	2024-07-19
20	兴银基金管理有限责任公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报	2024-07-23
21	2024 年中期报告	指定网站	2024-08-30
22	兴银基金管理有限责任公司旗下部分基金 2024 年中期报告提示性公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报	2024-08-30
23	招募说明书（更新）	指定网站、中数平台	2024-09-30
24	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、证券日报、证券时报、中国证券报	2024-10-09
25	2024 年 2 季度报告	指定网站	2024-10-25
26	兴银基金管理有限责任公司旗下基金 2024 年第 3 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	2024-10-25
27	关于旗下部分基金参与深圳前海微众银行股份有限公司费率优惠活动的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报	2024-12-06
28	兴银基金管理有限责任公司关于住所变更的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报	2024-12-12
29	兴银基金管理有限责任公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报	2024-12-21

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予基金募集注册的文件
2. 《兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》
3. 《兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金托管协议》
4. 《兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书》
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照
6. 中国证监会要求的其他文件

13.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处。

13.3 查阅方式

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

兴银基金管理有限责任公司
二〇二五年三月三十一日