

东兴兴晟混合型证券投资基金

2025 年中期报告

2025 年 06 月 30 日

基金管理人:东兴基金管理有限公司

基金托管人:浙商银行股份有限公司

送出日期:2025 年 08 月 29 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年8月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2025年1月1日起至2025年6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	65
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	65
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	66
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	66
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	66
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	66
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66
7.12 投资组合报告附注	66
§8 基金份额持有人信息	67
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	67
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	67

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	67
§9 开放式基金份额变动.....	68
§10 重大事件揭示.....	68
10.1 基金份额持有人大会决议.....	68
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	68
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	68
10.4 基金投资策略的改变	69
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	69
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	69
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	69
10.8 其他重大事件	70
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	71
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	71
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	71
§12 备查文件目录.....	71
12.1 备查文件目录	71
12.2 存放地点.....	72
12.3 查阅方式.....	72

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东兴兴晟混合型证券投资基金	
基金简称	东兴兴晟混合	
基金主代码	009327	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年08月05日	
基金管理人	东兴基金管理有限公司	
基金托管人	浙商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	18,331,660.26份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	东兴兴晟混合A	东兴兴晟混合C
下属分级基金的交易代码	009327	009328
报告期末下属分级基金的份额总额	13,577,644.07份	4,754,016.19份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		东兴基金管理有限公司	浙商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李宛霖	林彬
	联系电话	400-670-1800	0571-88269636
	电子邮箱	xxpl@dxamc.cn	zsyhzctgb@czbank.com
客户服务电话		400-670-1800	95527
传真		010-83770122	0571-88268688
注册地址		北京市丰台区东管头1号院1号楼1-190室	杭州市萧山区鸿宁路1788号
办公地址		北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座15层	杭州市拱墅区环城西路76号
邮政编码		100033	310006
法定代表人		牛南洁	陈海强（代为履行法定代表人职责）

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.dxamc.cn
基金中期报告备置地点	北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座15层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	东兴基金管理有限公司	北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座15层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期
	(2025年01月01日-2025年06月30日)

	东兴兴晟混合A	东兴兴晟混合C
本期已实现收益	1,828,616.68	456,703.22
本期利润	3,040,304.74	728,759.81
加权平均基金份额本期利润	0.1581	0.1191
本期加权平均净值利润率	13.90%	10.68%
本期基金份额净值增长率	14.16%	13.82%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2025年06月30日)	
期末可供分配利润	3,388,453.61	1,014,265.78
期末可供分配基金份额利润	0.2496	0.2133
期末基金资产净值	16,966,097.68	5,768,281.97
期末基金份额净值	1.2496	1.2133
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2025年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	24.96%	21.33%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东兴兴晟混合A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.16%	0.69%	1.62%	0.34%	3.54%	0.35%
过去三个月	7.89%	1.47%	1.28%	0.63%	6.61%	0.84%
过去六个月	14.16%	1.27%	0.13%	0.59%	14.03%	0.68%
过去一年	23.64%	1.58%	9.66%	0.82%	13.98%	0.76%
过去三年	9.05%	1.22%	-3.89%	0.65%	12.94%	0.57%

自基金合同生效起至今	24.96%	1.14%	-5.82%	0.69%	30.78%	0.45%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

东兴兴晟混合C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.09%	0.69%	1.62%	0.34%	3.47%	0.35%
过去三个月	7.72%	1.47%	1.28%	0.63%	6.44%	0.84%
过去六个月	13.82%	1.27%	0.13%	0.59%	13.69%	0.68%
过去一年	22.89%	1.58%	9.66%	0.82%	13.23%	0.76%
过去三年	7.11%	1.22%	-3.89%	0.65%	11.00%	0.57%
自基金合同生效起至今	21.33%	1.14%	-5.82%	0.69%	27.15%	0.45%

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





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

2、建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

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

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

东兴基金拥有一支行业经验丰富、具备高度凝聚力、战斗力和专业性的优秀团队。公司承载中国东方的红色基因，践行诚信、创新、激情、专注、协作的企业文化，坚持以投资者利益为上的原则，致力为客户持续创造价值。

截至2025年6月30日，本公司管理东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金、东兴蓝海财富灵活配置混合型证券投资基金、东兴安盈宝货币市场基金、东兴兴利债券型证券投资基金、东兴兴福一年定期开放债券型证券投资基金、东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金、东兴兴瑞一年定期开放债券型证券投资基金、东兴兴财短债债券型证券投资基金、东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金、东兴中证消费50指数证券投资基金、东兴兴晟混合型证券投资基金、东兴宸瑞量化混合型证券投资基金、东兴鑫享6个月滚动持有债券型发起式证券投资基金、东兴兴盈三个月定期开放债券型证券投资基金、东兴兴源债券型证券投资基金、东兴宸祥量化混合型证券投资基金、东兴连裕6个月滚动持有债券型证券投资基金、东兴连众一年持有期混合型证券投资基金、东兴数字经济混合型发起式证券投资基金、东兴鑫颐3个月滚动持有纯债债券型证券投资基金、东兴成长优选混合型发起式证券投资基金、东兴医药生物量化选股混合型证券投资基金、东兴兴诚利率债债券型证券投资基金、东兴宸泰量化选股混合型发起式证券投资基金、东兴红利优选混合型证券投资基金共25只开放式基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的 基金经理（助理）期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
李晨辉 先生	本基金 基金经 理	2020- 08-05	-	13年	毕业于中国科学院研究生院信号与信息处理专业，硕士研究生学历。2011年7月至2014年1月，任职东兴证券股份有限公司研究所行业研究员、高级行业研究员；2014年2月至2021年5月，任职东兴证券股份有限公司基金业务部高级研究员、基金经理助理、基金经理；2021年5月至今，任职东兴基金管理有限公司权益投资部基金经理。现任东兴兴晟混合型证券投资基金基金经理、东兴

					兴源债券型证券投资基金基金经理、东兴红利优选混合型证券投资基金基金经理。
李兵伟先生	本基金基金经理	2020-09-07	-	14年	毕业于中央财经大学金融学专业，硕士研究生学历。2010年7月至2015年9月，任职信达证券金融工程研究员、投资主办人；2015年9月至2021年5月，任职东兴证券股份有限公司基金业务部；2021年5月至2025年1月，任职东兴基金管理有限公司权益投资部基金经理；2025年1月至今，任职东兴基金管理有限公司量化投资部基金经理。现任东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东兴中证消费50指数证券投资基金基金经理、东兴兴晟混合型证券投资基金基金经理、东兴宸瑞量化混合型证券投资基金基金经理、东兴宸祥量化混合型证券投资基金基金经理、东兴连众一年持有期混合型证券投资基金基金经理、东兴医药生物量化选股混合型证券投资基金基金经理、东兴宸泰量化选股混合型发起式证券投资基金基金经理。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

基金管理人实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于交易所公开竞价交易，基金管理人执行交易系统内的公平交易程序；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易，在参与申购之前，各基金经理应在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量。在获配额度确定后，按照价格优先的原则对交易结果进行分配；如果申购价格相同，则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配。债券一级市场申购分配不足最小单位的，可由基金经理协商分配，协商不一致则由分管投资的公司领导决定；对于银行间市场交易，应按照场外交易流程执行，由各基金经理给出询价区间，交易部根据询价区间在银行间市场上应该按照价格优先、时间优先的原则进行询价并完成交易，并留存询价交易记录备查。

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

自2024年9月末权益市场快速上行以来，前期低迷的市场情绪得以显著改善。2025年上半年，权益市场整体呈现先抑后扬、震荡上行态势。上证综指于6月末触及上半年高点，并最终突破3400点，半年内累计上涨2.76%。在此期间，以分散化投资为核心优势的量化策略，有效捕捉了市场主要投资热点，取得了良好表现。分散投资作为经典的

风险管理手段，通过多元化配置降低单一资产风险，是本基金始终坚持的投资风控原则。长期来看，该策略的有效性已得到充分验证。此外，本基金会结合行业比较框架捕捉估值洼地。

近期，量化投资受到市场较多关注，主要基于以下原因：首先，量化投资具备严格的风险管理体系，在波动率较高的市场环境下，其投资组合能有效控制回撤幅度；其次，量化策略依据定量分析指标进行投资组合调整，决策过程果断高效。其投资逻辑依托历史数据回测，具备透明性与可验证性，显著降低了人为情绪及心理因素的干扰；第三，量化模型能够综合处理财务数据、市场行情、新闻舆情、产业链关系等多维信息，多角度、多层次地把握投资机会。本基金的投资策略侧重于组合构建而非择时。我们秉承基本面量化理念，切实贯彻“价值投资”原则，通过成长性、估值水平、盈利能力等一系列具备坚实逻辑支撑的基本面因子，从多维度评估个股投资价值，致力于构建具备长期投资价值的股票组合。此外，我们定期评估因子有效性，及时纳入有效因子，剔除失效因子。在行业轮动加速、风格切换频繁的市场环境中，多因子策略展现出灵活调整配置的适应性优势。本基金兼顾高成长赛道与低估值价值股，强调“景气度投资”，优先布局政策支持或行业渗透率快速提升的领域

当前，A股市场整体估值水平仍处于合理水平，本基金将保持适中仓位，重心放在股票组合构建，通过持续的模型迭代与优化，致力于在组合构建过程中有效管理风险，同时兼顾产品业绩的弹性空间，力争及时把握权益市场的投资机遇。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2025年1月1日起至2025年6月30日，本基金A类份额净值增长率为14.16%，业绩比较基准收益率为0.13%，高于业绩比较基准14.03%；本基金C类份额净值增长率为13.82%，业绩比较基准收益率为0.13%，高于业绩比较基准13.69%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

根据国家统计局发布的2025年上半年宏观经济数据，中国经济在复杂多变的国际环境和国内多重压力下，呈现出稳中向好的发展态势。上半年，中国国内生产总值按不变价格计算，同比增长5.3%。分产业看，上半年第一产业增加值31,170亿元，同比增长3.7%；第二产业增加值239,050亿元，同比增长5.3%；第三产业增加值390,310亿元，同比增长5.5%。此外，货物进出口总额217,876亿元，同比增长2.9%。全国居民消费价格指数（CPI）同比下降0.1%。全国城镇调查失业率平均值为5.2%，较一季度下降0.1个百分点。全国居民人均可支配收入21,840元，同比名义增长5.3%。

总体而言，上半年中国经济展现出较强韧性，实现了稳中有进的发展态势。展望下半年，随着中美关税谈判取得阶段性积极进展，外部负面冲击有望逐步减弱，预计全年

GDP增速将维持在5.0%左右。国内经济政策将继续坚持“稳字当头”，着力用好现有政策空间。若未来遭遇超预期的外部冲击，不排除适时出台增量政策措施加以应对。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，受基金份额持有人赎回等影响，本基金存在基金资产净值连续六十个工作日低于五千万元的情况，但不存在连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形，本基金管理人已将此情况上报中国证监会并采取适当措施。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人--东兴基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对东兴基金管理有限公司编制和披露的东兴兴晟混合型证券投资基金2025年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了复核，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：东兴兴晟混合型证券投资基金

报告截止日：2025年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	751,000.27	1,135,778.09
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	19,610,824.72	34,039,036.43
其中：股票投资		18,101,614.74	31,706,277.06
基金投资		-	-
债券投资		1,509,209.98	2,332,759.37
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	2,500,543.84	5,000,292.47
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		130,208.66	3,295.06
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		22,992,577.49	40,178,402.05
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末

		2025年06月30日	2024年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		150,846.45	-
应付管理人报酬		19,432.18	56,509.79
应付托管费		3,886.44	11,301.96
应付销售服务费		3,050.08	2,899.20
应付投资顾问费		-	-
应交税费		100.95	366.18
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	80,881.74	78,442.37
负债合计		258,197.84	149,519.50
净 资 产:			
实收基金	6.4.7.7	18,331,660.26	36,692,013.74
未分配利润	6.4.7.8	4,402,719.39	3,336,868.81
净资产合计		22,734,379.65	40,028,882.55
负债和净资产总计		22,992,577.49	40,178,402.05

注：报告截止日2025年6月30日，基金份额总额18,331,660.26份；东兴兴晟混合A基金份额净值1.2496元，基金份额总额13,577,644.07份,东兴兴晟混合C基金份额净值1.2133元，基金份额总额4,754,016.19份。

6.2 利润表

会计主体：东兴兴晟混合型证券投资基金

本报告期：2025年01月01日至2025年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
-----	-----	----	---------

		2025年01月01 日至2025年06 月30日	2024年01月01日 至2024年06月30 日
一、营业总收入		3,982,161.72	-3,100,309.26
1.利息收入		28,870.29	66,525.47
其中：存款利息收入	6.4.7.9	724.32	1,868.84
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		28,145.97	64,656.63
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,409,599.92	-330,475.41
其中：股票投资收益	6.4.7.10	2,185,114.73	-1,163,515.88
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	12,357.06	27,886.72
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	212,128.13	805,153.75
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,483,744.65	-2,871,780.19
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	59,946.86	35,420.87
减：二、营业总支出		213,097.17	375,150.23
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	145,706.22	262,684.44
2.托管费	6.4.10.2.2	29,141.27	52,536.93
3.销售服务费	6.4.10.2.3	20,308.98	17,762.23
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.18	-	-

7.税金及附加		101.33	232.78
8.其他费用	6.4.7.19	17,839.37	41,933.85
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,769,064.55	-3,475,459.49
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,769,064.55	-3,475,459.49
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3,769,064.55	-3,475,459.49

6.3 净资产变动表

会计主体：东兴兴晟混合型证券投资基金

本报告期：2025年01月01日至2025年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	36,692,013.74	3,336,868.81	40,028,882.55
二、本期期初净资产	36,692,013.74	3,336,868.81	40,028,882.55
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-18,360,353.48	1,065,850.58	-17,294,502.90
（一）、综合收益总额	-	3,769,064.55	3,769,064.55
（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）	-18,360,353.48	-2,703,213.97	-21,063,567.45
其中：1.基金申购款	18,975,889.77	2,841,120.47	21,817,010.24
2.基金赎回款	-37,336,243.25	-5,544,334.44	-42,880,577.69
（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	18,331,660.26	4,402,719.39	22,734,379.65

项 目	上年度可比期间		
	2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	43,788,263.33	4,086,827.96	47,875,091.29
二、本期期初净资产	43,788,263.33	4,086,827.96	47,875,091.29
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	4,770,674.14	-3,705,774.44	1,064,899.70
（一）、综合收益总额	-	-3,475,459.49	-3,475,459.49
（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）	4,770,674.14	-230,314.95	4,540,359.19
其中：1.基金申购款	23,863,164.63	858,966.36	24,722,130.99
2.基金赎回款	-19,092,490.49	-1,089,281.31	-20,181,771.80
（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	48,558,937.47	381,053.52	48,939,990.99

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

牛南洁

黄言

王广辉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

中认购资金利息折合58,919.73份。本基金基金管理人为东兴基金管理有限公司（本基金原基金管理人为东兴证券股份有限公司，自2021年5月24日起变更为东兴基金管理有限公司），基金托管人为浙商银行股份有限公司。

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

基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为35%-80%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合企业会计准则及其他有关规定要求，真实、完整地反映了本基金2025年6月30日的财务状况以及2025年1月1日至2025年6月30日的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与上一年年度报告相一致。

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日。本期财务报表的实际编制期间为2025年1月1日至2025年6月30日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产的分类

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

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

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

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

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

2、金融负债的分类

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

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

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

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

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

6.4.4.8 损益平准金

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

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

（1）利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

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

（2）投资收益

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

债券、资产支持证券、同业存单等固定收益类金融资产的投资收益分为：

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

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

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

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

（3）公允价值变动损益

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

（4）其他收入

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

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

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

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

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

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

4、同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

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

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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

6.4.4.12 分部报告

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

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他需要披露的重要会计政策和会计估计。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

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

财税【2016】140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税【2017】2号《财政部、国家税务总局关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税【2017】56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作、财税【2017】90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税【2023】39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，主要税项列示如下：

- 1.于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。自2018年1月1日起，在基金运营过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。
- 2.对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。
- 3.对基金取得的股票股息、红利收入，自2015年9月8日起，基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。
- 4.对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。
- 5.对于基金从事A股买卖，自2008年09月19日起，由出让方按0.1%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税；自2023年8月28日起证券交易印花税实施减半征收。
- 6.基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免于缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日
活期存款	538,736.24
等于：本金	538,731.57
加：应计利息	4.67

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	212,264.03
等于：本金	212,252.02
加：应计利息	12.01
减：坏账准备	-
合计	751,000.27

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券资金账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		17,231,498.39	-	18,101,614.74	870,116.35
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,502,064.00	8,139.98	1,509,209.98	-994.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,502,064.00	8,139.98	1,509,209.98	-994.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		18,733,562.39	8,139.98	19,610,824.72	869,122.35

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	2,500,543.84	-
银行间市场	-	-
合计	2,500,543.84	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	80,881.74
合计	80,881.74

注：预提费用为按日计提的审计费和信息披露费。

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 东兴兴晟混合A

金额单位：人民币元

项目 (东兴兴晟混合A)	本期 2025年01月01日至2025年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	31,976,319.54	31,976,319.54
本期申购	11,507,236.84	11,507,236.84
本期赎回（以“-”号填列）	-29,905,912.31	-29,905,912.31
本期末	13,577,644.07	13,577,644.07

6.4.7.7.2 东兴兴晟混合C

金额单位：人民币元

项目 (东兴兴晟混合C)	本期 2025年01月01日至2025年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,715,694.20	4,715,694.20
本期申购	7,468,652.93	7,468,652.93
本期赎回（以“-”号填列）	-7,430,330.94	-7,430,330.94
本期末	4,754,016.19	4,754,016.19

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 东兴兴晟混合A

单位：人民币元

项目 (东兴兴晟混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,306,480.86	-2,281,014.85	3,025,466.01
本期期初	5,306,480.86	-2,281,014.85	3,025,466.01
本期利润	1,828,616.68	1,211,688.06	3,040,304.74
本期基金份额交易产生的变动数	-3,605,453.04	928,135.90	-2,677,317.14
其中：基金申购款	2,587,828.56	-734,733.09	1,853,095.47

基金赎回款	-6,193,281.60	1,662,868.99	-4,530,412.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,529,644.50	-141,190.89	3,388,453.61

6.4.7.8.2 东兴兴晟混合C

单位：人民币元

项目 (东兴兴晟混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	644,550.24	-333,147.44	311,402.80
本期期初	644,550.24	-333,147.44	311,402.80
本期利润	456,703.22	272,056.59	728,759.81
本期基金份额交易产生的变动数	-32,503.90	6,607.07	-25,896.83
其中：基金申购款	1,449,790.30	-461,765.30	988,025.00
基金赎回款	-1,482,294.20	468,372.37	-1,013,921.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,068,749.56	-54,483.78	1,014,265.78

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
活期存款利息收入	114.59
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	609.73
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	724.32

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

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
卖出股票成交总额	126,263,466.83
减：卖出股票成本总额	123,897,677.28
减：交易费用	180,674.82
买卖股票差价收入	2,185,114.73

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
债券投资收益——利息收入	18,167.82
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-5,810.76
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	12,357.06

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,037,792.62
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,005,789.76
减：应计利息总额	37,813.62
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-5,810.76

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
股票投资产生的股利收益	212,128.13
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	212,128.13

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
1.交易性金融资产	1,483,744.65
——股票投资	1,487,034.89
——债券投资	-3,290.24
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-

合计	1,483,744.65
----	--------------

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
基金赎回费收入	59,066.51
转换费收入	880.35
合计	59,946.86

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
审计费用	7,439.10
信息披露费	10,000.27
证券出借违约金	-
其他	400.00
合计	17,839.37

注：其他为证券账户开户费。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本基金本报告期末不存在需要说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本基金报告报出日，本基金不存在需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
东兴证券股份有限公司	基金管理人的控股股东、基金销售机构
东兴基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
浙商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
大连银行股份有限公司	与基金管理人同一实际控制人的关联方、基金销售机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2025年01月01日至2025年06月30日		2024年01月01日至2024年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
东兴证券股份有限公司	235,069,446.90	100.00%	293,752,854.31	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2025年01月01日至2025年06月30日		2024年01月01日至2024年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
东兴证券股份有限公司	1,502,229.00	100.00%	5,404,116.00	100.00%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2025年01月01日至2025年06月30日		2024年01月01日至2024年06月30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
东兴证券股份有限公司	236,312,000.00	100.00%	534,900,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期			
	2025年01月01日至2025年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余 额	占期末应付佣 金总额的比例
东兴证券股份有限公司	116,266.64	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间			
	2024年01月01日至2024年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余 额	占期末应付佣 金总额的比例
东兴证券股份有限公司	235,195.81	100.00%	-	0.00%

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至20 25年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至20 24年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	145,706.22	262,684.44
其中：应支付销售机构的客户维护费	58,754.73	85,584.62
应支付基金管理人的净管理费	86,951.49	177,099.82

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

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025 年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	29,141.27	52,536.93

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

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025年01月01日至2025年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东兴兴晟混合A	东兴兴晟混合C	合计
东兴证券股份有限公司	0.00	11,273.12	11,273.12
浙商银行股份有限公司	0.00	7,282.52	7,282.52
大连银行股份有限公司	0.00	357.74	357.74
东兴基金管理有限公司	0.00	37.16	37.16
合计	0.00	18,950.54	18,950.54
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

	东兴兴晟混合A	东兴兴晟混合C	合计
东兴证券股份有限公司	0.00	6,920.89	6,920.89
浙商银行股份有限公司	0.00	7,810.16	7,810.16
大连银行股份有限公司	0.00	644.40	644.40
东兴基金管理有限公司	0.00	66.22	66.22
合计	0.00	15,441.67	15,441.67

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.60%的年费率计提。C类基金份额销售服务费的计算方法如下：

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

H为C类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E为前一日的C类基金份额基金资产净值

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间，未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间，未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2025年01月01日至2025年06月30日		2024年01月01日至2024年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浙商银行股份有限公司	538,736.24	114.59	481,367.96	525.52

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间，本基金无其他关联交易事项的说明。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

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

6.4.12 期末（2025年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
400268	中航产融	2025-04-03	退市转新三板	3.47	2025-07-18	3.30	100	411.50	347.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	1,509,209.98	2,332,759.37

合计	1,509,209.98	2,332,759.37
----	--------------	--------------

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。
2、未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末持有按长期信用评级列示的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金所持证券除附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的

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

于2025年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	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
-----	-------	-------	--------	------	------	-----	----

2025年06月30日							
资产							
货币资金	750,983.59	-	-	-	-	16.68	751,000.27
交易性金融资产	-	-	1,501,070.00	-	-	18,109,754.72	19,610,824.72
买入返售金融资产	2,500,000.00	-	-	-	-	543.84	2,500,543.84
应收申购款	-	-	-	-	-	130,208.66	130,208.66
资产总计	3,250,983.59	-	1,501,070.00	-	-	18,240,523.90	22,992,577.49
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	150,846.45	150,846.45
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	19,432.18	19,432.18
应付托管费	-	-	-	-	-	3,886.44	3,886.44
应付销售服务费	-	-	-	-	-	3,050.08	3,050.08
应交税费	-	-	-	-	-	100.95	100.95
其他负债	-	-	-	-	-	80,881.74	80,881.74
负债总计	-	-	-	-	-	258,197.84	258,197.84
利率敏感度缺口	3,250,983.59	-	1,501,070.00	-	-	17,982,326.06	22,734,379.65
上年度末 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	1,135,737.78	-	-	-	-	40.31	1,135,778.09
交易性金融资产	300,240.00	-	2,007,660.00	-	-	31,731,136.43	34,039,036.43
买入返售金融资产	5,000,000.00	-	-	-	-	292.47	5,000,292.47
应收申购款	-	-	-	-	-	3,295.06	3,295.06
资产总计	6,435,977.78	-	2,007,660.00	-	-	31,734,764.27	40,178,402.05
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	56,509.79	56,509.79
应付托管费	-	-	-	-	-	11,301.96	11,301.96
应付销售服务费	-	-	-	-	-	2,899.20	2,899.20
应交税费	-	-	-	-	-	366.18	366.18
其他负债	-	-	-	-	-	78,442.37	78,442.37
负债总计	-	-	-	-	-	149,519.50	149,519.50
利率敏感度缺口	6,435,977.78	-	2,007,660.00	-	-	31,585,244.77	40,028,882.55

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日		上年度末 2024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	18,101,614.74	79.62	31,706,277.06	79.21
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,509,209.98	6.64	2,332,759.37	5.83
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	19,610,824.72	86.26	34,039,036.43	85.04

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	市场其他变量保持不变，只有业绩比较基准所对应的市场组合价格发生合理、可能的变动；		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日

	业绩比较基准变动+5%	2,130,892.66	3,183,964.29
	业绩比较基准变动-5%	-2,130,892.66	-3,183,964.29

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	18,101,267.74	31,706,277.06
第二层次	1,509,556.98	2,332,759.37
第三层次	-	-
合计	19,610,824.72	34,039,036.43

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本报告期内不存在持有的金融工具公允价值所属层次间发生重大变动的情况。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期内不存在持有非持续以公允价值计量的金融工具的情况。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括货币资金、买入返售金融资产、应收申购款和应付赎回款、其他应付款项，其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	18,101,614.74	78.73
	其中：股票	18,101,614.74	78.73
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,509,209.98	6.56
	其中：债券	1,509,209.98	6.56
	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	2,500,543.84	10.88
	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	751,000.27	3.27
8	其他各项资产	130,208.66	0.57
9	合计	22,992,577.49	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	15,863.00	0.07
B	采矿业	800,408.60	3.52
C	制造业	11,361,688.05	49.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	50,854.82	0.22
E	建筑业	11,403.20	0.05
F	批发和零售业	232,653.70	1.02
G	交通运输、仓储和邮政业	132,503.70	0.58
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,151,561.45	9.46
J	金融业	1,961,976.54	8.63
K	房地产业	2,545.00	0.01
L	租赁和商务服务业	200,247.08	0.88
M	科学研究和技术服务业	625,078.85	2.75
N	水利、环境和公共设施管理业	298,374.55	1.31
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	10,734.00	0.05
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	239,727.00	1.05
S	综合	5,995.20	0.03
	合计	18,101,614.74	79.62

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	603236	移远通信	5,600	480,480.00	2.11
2	001283	豪鹏科技	7,300	397,485.00	1.75
3	002543	万和电气	34,200	379,962.00	1.67
4	000425	徐工机械	44,800	348,096.00	1.53
5	301171	易点天下	11,900	318,087.00	1.40
6	688123	聚辰股份	3,917	317,237.83	1.40
7	301080	百普赛斯	4,400	314,732.00	1.38
8	688486	龙迅股份	4,686	313,399.68	1.38
9	002801	微光股份	8,900	288,093.00	1.27
10	000708	中信特钢	24,300	285,768.00	1.26
11	603596	伯特利	5,400	284,526.00	1.25
12	301291	明阳电气	6,800	279,820.00	1.23
13	688401	路维光电	7,977	276,801.90	1.22
14	688696	极米科技	2,415	276,179.40	1.21

15	600517	国网英大	52,800	269,280.00	1.18
16	300790	宇瞳光学	12,700	265,557.00	1.17
17	000166	申万宏源	52,700	264,554.00	1.16
18	300922	天秦装备	9,100	254,254.00	1.12
19	601728	中国电信	32,700	253,425.00	1.11
20	688258	卓易信息	5,193	251,496.99	1.11
21	000100	TCL科技	58,000	251,140.00	1.10
22	601168	西部矿业	15,000	249,450.00	1.10
23	002159	三特索道	16,200	249,318.00	1.10
24	688800	瑞可达	4,888	240,489.60	1.06
25	600989	宝丰能源	14,700	237,258.00	1.04
26	002673	西部证券	30,100	237,188.00	1.04
27	002142	宁波银行	8,600	235,296.00	1.03
28	603201	常润股份	12,600	232,470.00	1.02
29	603328	依顿电子	23,200	227,592.00	1.00
30	601211	国泰海通	11,700	224,172.00	0.99
31	601098	中南传媒	16,600	217,792.00	0.96
32	002736	国信证券	18,500	213,120.00	0.94
33	605507	国邦医药	10,700	211,539.00	0.93
34	688076	诺泰生物	5,621	209,213.62	0.92
35	600785	新华百货	17,800	208,794.00	0.92
36	601688	华泰证券	11,700	208,377.00	0.92
37	601377	兴业证券	33,600	207,984.00	0.91
38	688213	思特威	2,027	207,199.94	0.91
39	000975	山金国际	10,800	204,552.00	0.90
40	300373	扬杰科技	3,900	202,410.00	0.89
41	688196	卓越新能	4,207	202,230.49	0.89
42	600050	中国联通	37,600	200,784.00	0.88
43	301195	北路智控	5,500	196,900.00	0.87
44	601958	金钼股份	17,500	191,450.00	0.84
45	301170	锡南科技	7,100	190,067.00	0.84

46	003008	开普检测	8,900	189,125.00	0.83
47	600801	华新水泥	15,300	181,152.00	0.80
48	002850	科达利	1,600	181,072.00	0.80
49	000725	京东方A	44,700	178,353.00	0.78
50	601989	中国重工	38,300	177,712.00	0.78
51	300218	安利股份	11,600	173,768.00	0.76
52	688503	聚和材料	4,151	171,809.89	0.76
53	605123	派克新材	2,200	171,380.00	0.75
54	600482	中国动力	7,400	170,718.00	0.75
55	300035	中科电气	10,000	168,800.00	0.74
56	603678	火炬电子	4,400	167,332.00	0.74
57	605183	确成股份	9,400	164,500.00	0.72
58	603073	彩蝶实业	9,500	160,075.00	0.70
59	688279	峰昭科技	848	157,304.00	0.69
60	603300	海南华铁	13,600	151,640.00	0.67
61	002876	三利谱	5,900	148,621.00	0.65
62	601089	福元医药	8,900	148,452.00	0.65
63	600938	中国海油	5,500	143,605.00	0.63
64	600150	中国船舶	4,200	136,668.00	0.60
65	688109	品茗科技	4,314	134,294.82	0.59
66	001231	农心科技	6,500	130,780.00	0.58
67	002864	盘龙药业	4,300	121,561.00	0.53
68	605155	西大门	9,900	118,503.00	0.52
69	603170	宝立食品	9,500	118,465.00	0.52
70	688073	毕得医药	1,862	108,033.24	0.48
71	688300	联瑞新材	2,319	107,949.45	0.47
72	301328	维峰电子	2,500	105,375.00	0.46
73	002661	克明食品	10,400	104,104.00	0.46
74	301323	新莱福	2,300	102,028.00	0.45
75	002492	恒基达鑫	17,100	100,206.00	0.44
76	002149	西部材料	4,800	95,280.00	0.42

77	300976	达瑞电子	1,400	69,706.00	0.31
78	301327	华宝新能	1,300	66,768.00	0.29
79	300547	川环科技	1,700	51,374.00	0.23
80	300907	康平科技	1,600	43,856.00	0.19
81	000776	广发证券	2,400	40,344.00	0.18
82	002938	鹏鼎控股	1,200	38,436.00	0.17
83	002045	国光电器	2,200	35,112.00	0.15
84	300228	富瑞特装	4,500	35,055.00	0.15
85	000415	渤海租赁	10,500	34,965.00	0.15
86	301031	中熔电气	432	34,408.80	0.15
87	300335	迪森股份	6,200	33,852.00	0.15
88	002594	比亚迪	100	33,191.00	0.15
89	605499	东鹏饮料	100	31,405.00	0.14
90	301158	德石股份	1,500	26,070.00	0.11
91	300150	世纪瑞尔	5,100	25,602.00	0.11
92	301035	润丰股份	400	23,736.00	0.10
93	001218	丽臣实业	1,300	23,725.00	0.10
94	001230	劲旅环境	1,100	22,517.00	0.10
95	002648	卫星化学	1,240	21,489.20	0.09
96	002895	川恒股份	900	20,304.00	0.09
97	000719	中原传媒	1,500	18,615.00	0.08
98	600967	内蒙一机	900	17,415.00	0.08
99	600436	片仔癀	87	17,400.87	0.08
100	001266	宏英智能	500	13,225.00	0.06
101	002028	思源电气	170	12,394.70	0.05
102	301330	熵基科技	440	11,893.20	0.05
103	000729	燕京啤酒	900	11,637.00	0.05
104	301061	匠心家居	150	11,631.00	0.05
105	002666	德联集团	2,200	11,198.00	0.05
106	000089	深圳机场	1,600	11,040.00	0.05
107	688419	耐科装备	289	10,773.92	0.05

108	605098	行动教育	300	10,734.00	0.05
109	600577	精达股份	1,400	10,416.00	0.05
110	301007	德迈仕	322	9,978.78	0.04
111	688557	兰剑智能	317	9,487.81	0.04
112	300969	恒帅股份	140	9,377.20	0.04
113	301004	嘉益股份	140	9,272.20	0.04
114	688523	航天环宇	408	8,776.08	0.04
115	002961	瑞达期货	400	8,400.00	0.04
116	300845	捷安高科	728	8,139.04	0.04
117	688379	华光新材	233	8,075.78	0.04
118	688233	神工股份	254	8,069.58	0.04
119	688517	金冠电气	558	8,024.04	0.04
120	688283	坤恒顺维	289	7,933.05	0.03
121	605166	聚合顺	700	7,833.00	0.03
122	002752	昇兴股份	1,400	7,798.00	0.03
123	300747	锐科激光	325	7,696.00	0.03
124	603309	维力医疗	600	7,632.00	0.03
125	002264	新华都	1,200	7,620.00	0.03
126	002987	京北方	364	7,589.40	0.03
127	300587	天铁科技	1,046	7,541.66	0.03
128	603507	振江股份	300	7,524.00	0.03
129	600061	国投资本	1,000	7,520.00	0.03
130	300109	新开源	450	7,465.50	0.03
131	002394	联发股份	900	7,407.00	0.03
132	300806	斯迪克	448	7,392.00	0.03
133	603031	安孚科技	245	7,249.55	0.03
134	300684	中石科技	300	7,164.00	0.03
135	300772	运达股份	556	7,161.28	0.03
136	600362	江西铜业	300	7,029.00	0.03
136	002772	众兴菌业	900	7,029.00	0.03
138	300388	节能国祯	1,000	6,960.00	0.03

139	301076	新瀚新材	200	6,956.00	0.03
140	603987	康德莱	900	6,930.00	0.03
141	688099	晶晨股份	96	6,816.96	0.03
142	000885	城发环境	500	6,660.00	0.03
143	002206	海利得	1,300	6,643.00	0.03
144	600693	东百集团	1,100	6,600.00	0.03
145	300815	玉禾田	320	6,576.00	0.03
146	603611	诺力股份	300	6,462.00	0.03
147	300541	先进数通	390	6,337.50	0.03
148	601108	财通证券	800	6,328.00	0.03
149	603590	康辰药业	200	6,288.00	0.03
150	603192	汇得科技	300	6,270.00	0.03
151	605168	三人行	210	6,180.30	0.03
152	603989	艾华集团	400	6,160.00	0.03
153	002484	江海股份	300	6,147.00	0.03
154	600694	大商股份	330	6,121.50	0.03
155	300401	花园生物	400	6,084.00	0.03
156	000833	粤桂股份	480	5,995.20	0.03
157	300625	三雄极光	500	5,945.00	0.03
158	601966	玲珑轮胎	400	5,868.00	0.03
159	300719	安达维尔	300	5,835.00	0.03
160	601825	沪农商行	600	5,820.00	0.03
161	001215	千味央厨	200	5,698.00	0.03
162	688217	睿昂基因	225	5,692.50	0.03
163	688226	威腾电气	217	5,672.38	0.02
164	003017	大洋生物	220	5,610.00	0.02
165	600176	中国巨石	489	5,574.60	0.02
166	688255	凯尔达	165	5,558.85	0.02
167	300759	康龙化成	225	5,521.50	0.02
168	603577	汇金通	600	5,508.00	0.02
168	603020	爱普股份	600	5,508.00	0.02

170	301302	华如科技	200	5,502.00	0.02
171	605377	华旺科技	624	5,497.44	0.02
172	603903	中持股份	700	5,467.00	0.02
173	300629	新劲刚	250	5,422.50	0.02
174	600488	津药药业	1,300	5,421.00	0.02
175	601137	博威合金	300	5,337.00	0.02
176	603508	思维列控	200	5,296.00	0.02
177	000951	中国重汽	300	5,274.00	0.02
178	688628	优利德	157	5,267.35	0.02
179	002807	江阴银行	1,100	5,225.00	0.02
180	605066	天正电气	700	5,215.00	0.02
181	688550	瑞联新材	120	5,161.20	0.02
182	603529	爱玛科技	150	5,160.00	0.02
183	600233	圆通速递	400	5,156.00	0.02
184	603829	洛凯股份	300	5,136.00	0.02
185	002156	通富微电	200	5,124.00	0.02
186	688336	三生国健	94	5,098.56	0.02
187	002340	格林美	800	5,080.00	0.02
188	600765	中航重机	300	5,064.00	0.02
189	300327	中颖电子	209	5,061.98	0.02
190	603267	鸿远电子	100	5,027.00	0.02
191	688183	生益电子	97	4,966.40	0.02
192	002970	锐明技术	100	4,940.00	0.02
193	600372	中航机载	400	4,824.00	0.02
194	000807	云铝股份	300	4,794.00	0.02
195	002063	远光软件	800	4,760.00	0.02
196	688543	国科军工	79	4,755.01	0.02
197	300482	万孚生物	220	4,697.00	0.02
198	301010	晶雪节能	272	4,656.64	0.02
199	002881	美格智能	100	4,640.00	0.02
200	600163	中闽能源	900	4,608.00	0.02

201	001308	康冠科技	200	4,524.00	0.02
202	601918	新集能源	700	4,522.00	0.02
203	002321	华英农业	1,900	4,484.00	0.02
204	603093	南华期货	200	4,466.00	0.02
205	603533	掌阅科技	200	4,462.00	0.02
206	688391	钜泉科技	150	4,453.50	0.02
207	688591	泰凌微	92	4,406.80	0.02
208	002027	分众传媒	600	4,380.00	0.02
209	300970	华绿生物	300	4,350.00	0.02
210	601298	青岛港	500	4,345.00	0.02
211	002276	万马股份	300	4,332.00	0.02
212	002803	吉宏股份	300	4,278.00	0.02
213	300514	友讯达	300	4,224.00	0.02
214	001206	依依股份	200	4,200.00	0.02
215	603228	景旺电子	100	4,184.00	0.02
216	300823	建科智能	280	4,169.20	0.02
217	688166	博瑞医药	77	4,135.67	0.02
218	002391	长青股份	700	4,102.00	0.02
219	002185	华天科技	400	4,040.00	0.02
220	002179	中航光电	100	4,036.00	0.02
221	002449	国星光电	400	4,032.00	0.02
222	688325	赛微微电	83	3,984.00	0.02
223	688315	诺禾致源	278	3,925.36	0.02
224	603369	今世缘	100	3,893.00	0.02
225	002826	易明医药	200	3,890.00	0.02
226	603926	铁流股份	340	3,862.40	0.02
227	601117	中国化学	500	3,835.00	0.02
228	688032	禾迈股份	38	3,794.68	0.02
229	002384	东山精密	100	3,777.00	0.02
230	002438	江苏神通	300	3,774.00	0.02
231	002835	同为股份	200	3,754.00	0.02

232	688621	阳光诺和	75	3,741.75	0.02
233	603799	华友钴业	100	3,702.00	0.02
234	002332	仙琚制药	400	3,668.00	0.02
235	301418	协昌科技	100	3,654.00	0.02
236	688186	广大特材	127	3,633.47	0.02
237	603919	金徽酒	200	3,620.00	0.02
238	300660	江苏雷利	80	3,539.20	0.02
239	601609	金田股份	500	3,505.00	0.02
240	603966	法兰泰克	376	3,489.28	0.02
241	600486	扬农化工	60	3,480.00	0.02
242	002401	中远海科	200	3,472.00	0.02
243	002475	立讯精密	100	3,469.00	0.02
244	603013	亚普股份	200	3,456.00	0.02
245	300363	博腾股份	200	3,416.00	0.02
246	002335	科华数据	80	3,414.40	0.02
247	002286	保龄宝	300	3,399.00	0.01
248	600584	长电科技	100	3,369.00	0.01
249	002519	银河电子	600	3,354.00	0.01
250	600875	东方电气	200	3,348.00	0.01
251	688585	上纬新材	427	3,322.06	0.01
252	601949	中国出版	500	3,320.00	0.01
253	601618	中国中冶	1,100	3,278.00	0.01
254	603859	能科科技	100	3,232.00	0.01
255	300476	胜宏科技	24	3,225.12	0.01
256	002466	天齐锂业	100	3,204.00	0.01
257	002236	大华股份	200	3,176.00	0.01
258	600894	广日股份	300	3,147.00	0.01
259	600548	深高速	300	3,141.00	0.01
260	600479	千金药业	300	3,120.00	0.01
261	603699	纽威股份	100	3,117.00	0.01
262	002953	日丰股份	299	3,103.62	0.01

263	600377	宁沪高速	200	3,068.00	0.01
264	000960	锡业股份	200	3,060.00	0.01
265	002985	北摩高科	100	3,025.00	0.01
266	688799	华纳药厂	73	3,014.90	0.01
267	600513	联环药业	300	3,009.00	0.01
268	600637	东方明珠	400	2,988.00	0.01
269	000534	万泽股份	200	2,984.00	0.01
270	688093	世华科技	96	2,980.80	0.01
271	300656	民德电子	110	2,940.30	0.01
272	002705	新宝股份	200	2,940.00	0.01
273	002990	盛视科技	100	2,931.00	0.01
274	688087	英科再生	114	2,929.80	0.01
275	600051	宁波联合	400	2,904.00	0.01
276	002129	TCL中环	375	2,880.00	0.01
277	300693	盛弘股份	96	2,876.16	0.01
278	002980	华盛昌	140	2,825.20	0.01
279	003002	壶化股份	100	2,814.00	0.01
280	000783	长江证券	400	2,772.00	0.01
281	688566	吉贝尔	101	2,746.19	0.01
282	601311	骆驼股份	300	2,709.00	0.01
283	600731	湖南海利	370	2,697.30	0.01
284	300775	三角防务	100	2,686.00	0.01
285	002407	多氟多	220	2,681.80	0.01
286	300644	南京聚隆	100	2,671.00	0.01
287	002073	软控股份	300	2,667.00	0.01
288	603380	易德龙	100	2,660.00	0.01
289	603385	惠达卫浴	400	2,656.00	0.01
290	603351	威尔药业	100	2,648.00	0.01
291	600392	盛和资源	200	2,634.00	0.01
292	603985	恒润股份	169	2,633.02	0.01
293	002249	大洋电机	400	2,632.00	0.01

294	300919	中伟股份	80	2,630.40	0.01
295	603755	日辰股份	100	2,612.00	0.01
296	300811	铂科新材	56	2,598.96	0.01
297	605090	九丰能源	100	2,581.00	0.01
298	688439	振华风光	44	2,563.00	0.01
299	688128	中国电研	104	2,548.00	0.01
300	603556	海兴电力	100	2,547.00	0.01
301	688575	亚辉龙	174	2,538.66	0.01
302	601665	齐鲁银行	400	2,528.00	0.01
303	002448	中原内配	300	2,511.00	0.01
304	300705	九典制药	160	2,491.20	0.01
305	000001	平安银行	200	2,414.00	0.01
306	002824	和胜股份	140	2,408.00	0.01
307	601066	中信建投	100	2,405.00	0.01
308	603897	长城科技	100	2,390.00	0.01
309	300881	盛德鑫泰	80	2,388.80	0.01
310	300785	值得买	75	2,387.25	0.01
311	300642	透景生命	160	2,355.20	0.01
312	002318	久立特材	100	2,339.00	0.01
313	601166	兴业银行	100	2,334.00	0.01
314	300611	美力科技	100	2,329.00	0.01
315	601009	南京银行	200	2,324.00	0.01
316	603277	银都股份	145	2,320.00	0.01
317	603630	拉芳家化	100	2,242.00	0.01
318	605218	伟时电子	100	2,238.00	0.01
319	603725	天安新材	260	2,236.00	0.01
320	688208	道通科技	73	2,233.80	0.01
321	002216	三全食品	200	2,214.00	0.01
322	603855	华荣股份	100	2,213.00	0.01
323	600128	苏豪弘业	200	2,184.00	0.01
324	002003	伟星股份	200	2,182.00	0.01

325	002790	瑞尔特	300	2,181.00	0.01
326	000968	蓝焰控股	300	2,175.00	0.01
327	000553	安道麦A	300	2,166.00	0.01
328	002557	洽洽食品	100	2,162.00	0.01
329	688601	力芯微	54	2,157.30	0.01
330	603896	寿仙谷	100	2,133.00	0.01
331	603600	永艺股份	200	2,128.00	0.01
332	688291	金橙子	70	2,121.70	0.01
333	600483	福能股份	220	2,120.80	0.01
334	603156	养元饮品	100	2,116.00	0.01
335	002262	恩华药业	100	2,078.00	0.01
336	002054	德美化工	300	2,064.00	0.01
337	000830	鲁西化工	200	2,060.00	0.01
338	600007	中国国贸	100	2,058.00	0.01
339	300645	正元智慧	100	2,049.00	0.01
340	688616	西力科技	160	2,035.20	0.01
341	688521	芯原股份	21	2,026.50	0.01
342	300207	欣旺达	100	2,006.00	0.01
343	603203	快克智能	80	1,989.60	0.01
344	601669	中国电建	400	1,948.00	0.01
345	600030	中信证券	70	1,933.40	0.01
346	000906	浙商中拓	300	1,911.00	0.01
347	688259	创耀科技	48	1,903.20	0.01
348	002833	弘亚数控	116	1,897.76	0.01
349	002910	庄园牧场	200	1,884.00	0.01
350	600885	宏发股份	84	1,874.04	0.01
351	000778	新兴铸管	500	1,860.00	0.01
352	688689	银河微电	80	1,845.60	0.01
353	688026	洁特生物	112	1,836.80	0.01
354	603365	水星家纺	100	1,836.00	0.01
355	300711	广哈通信	80	1,830.40	0.01

356	000589	贵州轮胎	400	1,828.00	0.01
357	600761	安徽合力	100	1,774.00	0.01
358	600741	华域汽车	100	1,765.00	0.01
358	002821	凯莱英	20	1,765.00	0.01
360	603698	航天工程	100	1,762.00	0.01
361	002687	乔治白	379	1,758.56	0.01
362	688049	炬芯科技	29	1,754.50	0.01
363	688018	乐鑫科技	12	1,753.20	0.01
364	603871	嘉友国际	162	1,741.50	0.01
365	002182	宝武镁业	140	1,713.60	0.01
366	000407	胜利股份	500	1,700.00	0.01
367	002842	翔鹭钨业	200	1,670.00	0.01
368	600104	上汽集团	100	1,605.00	0.01
369	300059	东方财富	68	1,572.84	0.01
370	600459	贵研铂业	100	1,551.00	0.01
371	300791	仙乐健康	65	1,547.65	0.01
372	000629	钒钛股份	600	1,536.00	0.01
373	600621	华鑫股份	100	1,531.00	0.01
374	600487	亨通光电	100	1,530.00	0.01
375	002536	飞龙股份	100	1,496.00	0.01
376	002327	富安娜	200	1,484.00	0.01
377	600557	康缘药业	100	1,478.00	0.01
378	688560	明冠新材	97	1,471.49	0.01
379	601231	环旭电子	100	1,463.00	0.01
380	600897	厦门空港	100	1,459.00	0.01
381	600795	国电电力	300	1,452.00	0.01
382	000598	兴蓉环境	200	1,442.00	0.01
383	603367	辰欣药业	100	1,402.00	0.01
384	002452	长高电新	200	1,390.00	0.01
385	603810	丰山集团	84	1,366.68	0.01
386	603579	荣泰健康	50	1,363.00	0.01

387	603317	天味食品	120	1,334.40	0.01
388	002049	紫光国微	20	1,317.20	0.01
389	002809	红墙股份	100	1,306.00	0.01
390	300699	光威复材	40	1,266.80	0.01
391	603305	旭升集团	96	1,252.80	0.01
392	003041	真爱美家	44	1,214.84	0.01
393	600123	兰花科创	180	1,173.60	0.01
394	600760	中航沈飞	20	1,172.40	0.01
395	002889	东方嘉盛	78	1,170.78	0.01
396	003038	鑫铂股份	60	1,169.40	0.01
397	603938	三孚股份	80	1,150.40	0.01
398	300638	广和通	40	1,145.20	0.01
399	300610	晨化股份	100	1,140.00	0.01
400	603056	德邦股份	69	1,098.48	0.00
401	603408	建霖家居	100	1,097.00	0.00
402	601898	中煤能源	100	1,094.00	0.00
403	603968	醋化股份	96	1,091.52	0.00
404	600888	新疆众和	160	1,091.20	0.00
405	600059	古越龙山	100	1,091.00	0.00
406	603081	大丰实业	100	1,082.00	0.00
407	601229	上海银行	100	1,061.00	0.00
408	605567	春雪食品	100	1,023.00	0.00
409	600348	华阳股份	150	999.00	0.00
410	600461	洪城环境	100	964.00	0.00
411	601985	中国核电	100	932.00	0.00
412	603955	大千生态	30	931.20	0.00
413	600267	海正药业	100	925.00	0.00
414	603883	老百姓	44	924.44	0.00
415	600271	航天信息	100	924.00	0.00
416	688378	奥来德	53	893.05	0.00
417	688798	艾为电子	13	886.60	0.00

418	002829	星网宇达	40	872.80	0.00
419	002184	海得控制	65	851.50	0.00
420	601998	中信银行	100	850.00	0.00
421	002885	京泉华	60	849.00	0.00
422	002580	圣阳股份	60	847.80	0.00
423	688577	浙海德曼	18	844.02	0.00
424	603993	洛阳钼业	100	842.00	0.00
425	600223	福瑞达	100	822.00	0.00
426	688369	致远互联	31	818.09	0.00
427	601186	中国铁建	100	801.00	0.00
428	603086	先达股份	80	784.00	0.00
429	688508	芯朋微	14	781.48	0.00
430	000990	诚志股份	100	756.00	0.00
431	601238	广汽集团	100	749.00	0.00
432	600873	梅花生物	69	737.61	0.00
433	002825	纳尔股份	71	708.58	0.00
434	603738	泰晶科技	48	704.64	0.00
435	688510	航亚科技	29	701.22	0.00
436	002001	新和成	32	680.64	0.00
437	603118	共进股份	60	676.20	0.00
438	300034	钢研高纳	40	665.20	0.00
439	688611	杭州柯林	20	652.60	0.00
440	603359	东珠生态	100	652.00	0.00
440	603233	大参林	40	652.00	0.00
442	601956	东贝集团	100	650.00	0.00
443	002039	黔源电力	40	635.20	0.00
444	601872	招商轮船	100	626.00	0.00
445	002849	威星智能	40	624.00	0.00
446	603043	广州酒家	40	623.20	0.00
447	603323	苏农银行	110	617.10	0.00
448	600820	隧道股份	100	610.00	0.00

449	688606	奥泰生物	9	604.80	0.00
450	600997	开滦股份	100	589.00	0.00
451	601288	农业银行	100	588.00	0.00
452	000027	深圳能源	89	567.82	0.00
453	002886	沃特股份	30	564.60	0.00
454	600583	海油工程	100	546.00	0.00
455	300789	唐源电气	20	532.60	0.00
456	603697	有友食品	40	527.60	0.00
457	003019	宸展光电	15	525.45	0.00
458	300636	同和药业	68	522.24	0.00
459	002507	涪陵榨菜	40	511.60	0.00
460	300639	凯普生物	88	510.40	0.00
461	600325	华发股份	100	487.00	0.00
462	002728	特一药业	56	470.96	0.00
463	603659	璞泰来	25	469.50	0.00
464	300593	新雷能	35	469.00	0.00
465	300696	爱乐达	20	451.60	0.00
466	600295	鄂尔多斯	48	418.08	0.00
467	002763	汇洁股份	60	414.00	0.00
468	300995	奇德新材	9	400.32	0.00
469	600928	西安银行	100	392.00	0.00
470	000625	长安汽车	30	382.80	0.00
471	002777	久远银海	20	365.20	0.00
472	002228	合兴包装	100	353.00	0.00
473	400268	中航产融	100	347.00	0.00
474	002498	汉缆股份	100	338.00	0.00
475	600368	五洲交通	78	330.72	0.00
476	605189	富春染织	26	322.92	0.00
477	601975	招商南油	100	292.00	0.00
478	300737	科顺股份	60	289.20	0.00
479	603639	海利尔	20	281.00	0.00

480	002983	芯瑞达	13	275.47	0.00
481	603386	骏亚科技	20	253.00	0.00
482	601388	怡球资源	100	252.00	0.00
483	600390	五矿资本	40	233.20	0.00
484	688679	通源环境	15	224.55	0.00
485	688559	海目星	6	197.40	0.00
486	603939	益丰药房	8	195.76	0.00
487	688078	龙软科技	5	158.50	0.00
488	002873	新天药业	16	149.44	0.00
489	688698	伟创电气	2	94.40	0.00
490	688625	呈和科技	3	91.74	0.00
491	688722	同益中	4	85.08	0.00
492	688819	天能股份	3	83.28	0.00
493	688518	联赢激光	4	81.56	0.00
494	600328	中盐化工	10	76.50	0.00
495	688358	祥生医疗	2	59.30	0.00
496	688122	西部超导	1	51.88	0.00
497	688260	昀冢科技	3	49.44	0.00
498	688223	晶科能源	7	36.33	0.00
499	688596	正帆科技	1	33.92	0.00
500	688150	莱特光电	1	24.72	0.00
501	688556	高测股份	3	21.54	0.00
502	688067	爱威科技	1	21.51	0.00
503	688004	博汇科技	1	19.90	0.00
504	688329	艾隆科技	1	19.24	0.00
505	688711	宏微科技	1	17.59	0.00
506	688659	元琛科技	2	17.46	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金 资产净值比 例(%)
1	001283	豪鹏科技	1,267,398.00	3.17
2	000415	渤海租赁	1,254,059.00	3.13
3	300628	亿联网络	1,039,009.00	2.60
4	600163	中闽能源	990,756.00	2.48
5	600066	宇通客车	969,581.00	2.42
6	301195	北路智控	955,149.00	2.39
7	688131	皓元医药	947,570.32	2.37
8	603236	移远通信	892,870.00	2.23
9	301050	雷电微力	797,875.00	1.99
10	300611	美力科技	794,421.00	1.98
11	688080	映翰通	782,291.35	1.95
12	601811	新华文轩	781,253.00	1.95
13	301529	福赛科技	769,260.00	1.92
14	000807	云铝股份	769,187.00	1.92
15	000404	长虹华意	765,107.00	1.91
16	601728	中国电信	753,856.00	1.88
17	002500	山西证券	735,385.00	1.84
18	002864	盘龙药业	729,146.00	1.82
19	603987	康德莱	729,126.00	1.82
20	600731	湖南海利	721,831.00	1.80

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

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金 资产净值比
----	------	------	----------	----------------

				例(%)
1	300628	亿联网络	1,231,840.00	3.08
2	603040	新坐标	1,174,099.20	2.93
3	000415	渤海租赁	1,173,259.00	2.93
4	601811	新华文轩	1,172,877.00	2.93
5	003017	大洋生物	1,166,537.00	2.91
6	002938	鹏鼎控股	1,121,745.00	2.80
7	688419	耐科装备	1,121,438.09	2.80
8	603236	移远通信	1,079,972.00	2.70
9	688080	映翰通	1,069,372.29	2.67
10	688252	天德钰	1,018,913.20	2.55
11	301195	北路智控	987,474.00	2.47
12	603507	振江股份	980,960.00	2.45
13	600066	宇通客车	965,541.00	2.41
14	001283	豪鹏科技	961,301.00	2.40
15	688131	皓元医药	959,055.01	2.40
16	600163	中闽能源	917,422.00	2.29
17	300611	美力科技	909,358.00	2.27
18	603577	汇金通	848,351.00	2.12
19	301418	协昌科技	846,884.00	2.12
20	688772	珠海冠宇	835,825.08	2.09
21	300207	欣旺达	824,480.00	2.06
22	002206	海利得	821,182.00	2.05
23	688026	洁特生物	819,180.56	2.05

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

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	108,805,980.07
卖出股票收入（成交）总额	126,263,466.83

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

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	1,509,209.98	6.64
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	1,509,209.98	6.64

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	102298	国债2508	10,000	1,003,090.14	4.41
2	019758	24国债21	3,000	302,691.95	1.33
3	019730	23国债27	2,000	203,427.89	0.89
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期内未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，本期未出现被监管部门立案调查的情形；上海移远通信技术股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

7.12.2基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库
本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

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

5	应收申购款	130,208.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	130,208.66

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
东兴兴晟混合A	508	26,727.65	168.45	0.00%	13,577,475.62	100.00%
东兴兴晟混合C	267	17,805.30	0.00	0.00%	4,754,016.19	100.00%
合计	775	23,653.76	168.45	0.00%	18,331,491.81	100.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	东兴兴晟混合A	112,227.89	0.83%
	东兴兴晟混合C	11,159.68	0.23%
	合计	123,387.57	0.67%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区
----	------	--------------

		间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	东兴兴晟混合A	0~10
	东兴兴晟混合C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	东兴兴晟混合A	0~10
	东兴兴晟混合C	0
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	东兴兴晟混合A	东兴兴晟混合C
基金合同生效日(2020年08月05日)基金份额总额	281,613,922.92	103,380,254.95
本报告期期初基金份额总额	31,976,319.54	4,715,694.20
本报告期基金总申购份额	11,507,236.84	7,468,652.93
减：本报告期基金总赎回份额	29,905,912.31	7,430,330.94
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	13,577,644.07	4,754,016.19

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

东兴基金管理有限公司2025年1月20日发布公告以通讯方式组织召开本基金份额持有人大会，会议审议事项：《关于持续运作东兴兴晟混合型证券投资基金的议案》；由于本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的本基金基金份额总数小于权益登记日本基金基金份额总数的二分之一，未达到法定的基金份额持有人大会召开条件，于2025年2月27日公告本次基金份额持有人大会召开失败。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人的重大人事变动如下：黄言先生于2025年1月7日任公司财务负责人。
本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东兴证券股份有限公司	2	235,069,446.90	100.00%	116,266.64	100.00%	-

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

2、交易单元的选择标准和程序

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

券商选择程序：公司根据以上标准对不同证券公司进行考察、选择和确定。在满足证券公司选择标准的前提下，公司应当与提供证券交易服务的证券公司签订委托协议，约定双方的权利义务，明确服务内容、收取交易佣金的价格标准与计算方式。证券公司

的选择由研究部发起，由合规法律部对选择标准、选择程序是否符合法规及本制度规定进行初步合规审查后，报督察长进行合规性审查和总经理审批，公司与其建立合作关系并签署委托协议。

3、本基金本报告期内未新增租用交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东兴证券股份有限公司	1,502,229.00	100.00%	236,312,000.00	100.00%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东兴基金管理有限公司高级管理人员变更公告	指定报刊、指定网站	2025-01-08
2	东兴基金管理有限公司关于以通讯方式召开东兴兴晟混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	指定报刊、指定网站	2025-01-20
3	东兴基金管理有限公司关于以通讯方式召开东兴兴晟混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	指定报刊、指定网站	2025-01-21
4	东兴基金管理有限公司关于以通讯方式召开东兴兴晟混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	指定报刊、指定网站	2025-01-22
5	东兴基金管理有限公司旗下全部基金2024年第四季度报告提示性公告	指定报刊、指定网站	2025-01-22
6	东兴兴晟混合型证券投资基金2024年第4季度报告	指定网站	2025-01-22
7	东兴基金管理有限公司关于东兴兴晟混合型证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告	指定报刊、指定网站	2025-02-27
8	东兴基金管理有限公司旗下全部基金2024年年度报告提示性公告	指定报刊、指定网站	2025-03-28
9	东兴基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司交易及佣金支付情况（2024年度）	指定网站	2025-03-28
10	东兴兴晟混合型证券投资基金2024年年度报告	指定网站	2025-03-28
11	东兴基金管理有限公司旗下全部基金2025年第一季度报告提示性公告	指定报刊、指定网站	2025-04-22

12	东兴兴晟混合型证券投资基金2025年第1季度报告	指定网站	2025-04-22
13	东兴兴晟混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	指定网站	2025-04-23
14	东兴兴晟混合型证券投资基金基金招募说明书（更新）（2025年第1号）	指定网站	2025-04-23
15	东兴基金管理有限公司关于旗下公募基金产品风险等级更新的公告	指定报刊、指定网站	2025-05-10
16	东兴基金管理有限公司关于实际控制人变更获得中国证监会核准的公告	指定报刊、指定网站	2025-06-07
17	东兴基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件及完善身份基本信息的公告	指定报刊、指定网站	2025-06-26

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2025年1月1日 - 2025年2月16日	19,262,986.80	-	19,262,986.80	-	0.00%
产品特有风险							
1、本基金为混合型基金，基金资产主要投资于股票市场与债券市场，因此股市、债市的变化将影响到基金业绩表现。在调整资产配置比例时，不能完全抵御市场整体下跌风险，基金净值表现因此可能受到影响。本基金管理人将发挥专业研究优势，加强对市场、上市公司基本面和固定收益类产品的深入研究，持续优化组合配置，以控制特定风险。此外，由于本基金还可以投资其他品种，这些品种的价格也可能因市场中的各类变化而出现一定幅度的波动，产生特定的风险，并影响到整体基金的投资收益。							
2、本基金可投资股指期货，股指期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，指数微小的变动就可能会使投资人权益遭受较大损失。股指期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来重大损失。							
3、本基金可投资于在全国银行间债券市场或证券交易所交易的资产支持证券，基金管理人将本着谨慎和控制风险的原则进行资产支持证券投资，但由于资产支持证券具有一定的信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿还风险等风险，可能导致包括基金净值波动在内的各项风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

一、中国证监会核准东兴兴晟混合型证券投资基金募集的文件

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

12.2 存放地点

北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座15层

12.3 查阅方式

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

东兴基金管理有限公司
二〇二五年八月二十九日