

兴银中证 500 指数增强型证券投资基金

2023 年年度报告

2023 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:浙商银行股份有限公司

报告送出日期:2024 年 03 月 28 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。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年3月27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2023年1月1日起至12月31日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	11
3.4 过去三年基金的利润分配情况	11
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	21
§ 8 投资组合报告	47
8.1 期末基金资产组合情况	47
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	80
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	92

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	92
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	92
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	92
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	92
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	92
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	92
8.12 投资组合报告附注	92
§ 9 基金份额持有人信息	93
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	93
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	94
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	94
§ 10 开放式基金份额变动	94
§ 11 重大事件揭示	95
11.1 基金份额持有人大会决议	95
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	95
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	95
11.4 基金投资策略的改变	95
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	95
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	95
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	96
11.8 其他重大事件	96
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	98
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	98
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	98
§ 13 备查文件目录	99
13.1 备查文件目录	99
13.2 存放地点	99
13.3 查阅方式	99

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴银中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	兴银中证 500 指数增强	
基金主代码	010253	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 03 月 01 日	
基金管理人	兴银基金管理有限责任公司	
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	97,380,612.29 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 500 指数增强 A	兴银中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	010253	011205
报告期末下属分级基金的份额总额	33,886,165.83 份	63,494,446.46 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，力求实现超越标的指数的投资收益，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，追求获得超越标的指数的回报。本基金主要投资于中证 500 指数的成份股及备选成份股，为了获得超越指数的投资回报，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 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（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 500 指数增强 A	兴银中证 500 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	浙商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郑瑞健	朱巍
	联系电话	86-21-20296277	0571-87659806
	电子邮箱	zhengrj@hffunds.cn	zhuwei@czbank.com
客户服务电话		40000-96326	95527
传真		86-21-68630069	0571-88268688
注册地址		平潭综合实验区金井湾商务营运中心 6 号楼 11 层 03-3 房	浙江省杭州市萧山区鸿宁路 1788 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	杭州市拱墅区环城西路 76 号
邮政编码		200120	310006
法定代表人		吴若曼	陆建强

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 期间数据和指标	2023 年		2022 年		2021 年 03 月 01 日（基金合同生效日）-2021 年 12 月 31 日	
	兴银中证 500 指数增	兴银中证 500 指数增强 C				

	强 A	强 C	强 A	强 C	强 A	
本期已实现收益	- 2,631,903.6 2	- 5,265,421.2 6	- 8,890,157.5 5	- 38,406,441. 08	11,283,083. 57	18,649,179. 66
本期利润	- 1,803,878.6 0	- 3,496,994.2 6	- 10,290,040. 06	- 41,645,139. 87	12,432,267. 03	19,359,001. 16
加权平均基金份额本期利润	-0.0535	-0.0519	-0.2621	-0.3451	0.1626	0.1378
本期加权平均净值利润率	-5.82%	-5.67%	-26.41%	-34.62%	15.34%	12.60%
本期基金份额净值增长率	-6.15%	-6.33%	-21.25%	-21.41%	15.78%	15.53%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
期末可供分配利润	- 4,890,182.6 6	- 9,500,379.0 7	- 3,077,830.5 1	- 6,700,038.6 3	7,420,211.2 9	30,137,204. 77
期末可供分配基金份额利润	-0.1443	-0.1496	-0.0882	-0.0921	0.1578	0.1553
期末基金资产	28,995,983. 17	53,994,067. 39	31,814,554. 69	66,083,056. 93	54,448,992. 00	224,244,264 .88

净值						
期末基金 份额 净值	0.8557	0.8504	0.9118	0.9079	1.1578	1.1553
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
基金份额 累计 净值 增长率	-14.43%	-14.96%	-8.82%	-9.21%	15.78%	15.53%

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 500 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	-3.55%	0.75%	-4.36%	0.82%	0.81%	-0.07%
过去六个月	-8.09%	0.73%	-9.01%	0.81%	0.92%	-0.08%
过去一年	-6.15%	0.72%	-7.01%	0.78%	0.86%	-0.06%
自基金合同生效起至今	-14.43%	1.04%	-13.80%	1.02%	-0.63%	0.02%

兴银中证 500 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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

		②		④		
过去三个月	-3.59%	0.75%	-4.36%	0.82%	0.77%	-0.07%
过去六个月	-8.18%	0.73%	-9.01%	0.81%	0.83%	-0.08%
过去一年	-6.33%	0.72%	-7.01%	0.78%	0.68%	-0.06%
自基金合同生效起至今	-14.96%	1.04%	-13.80%	1.02%	-1.16%	0.02%

注：1、本基金成立于 2021 年 3 月 1 日；2、比较基准：中证 500 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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021年03月01日-2023年12月31日)

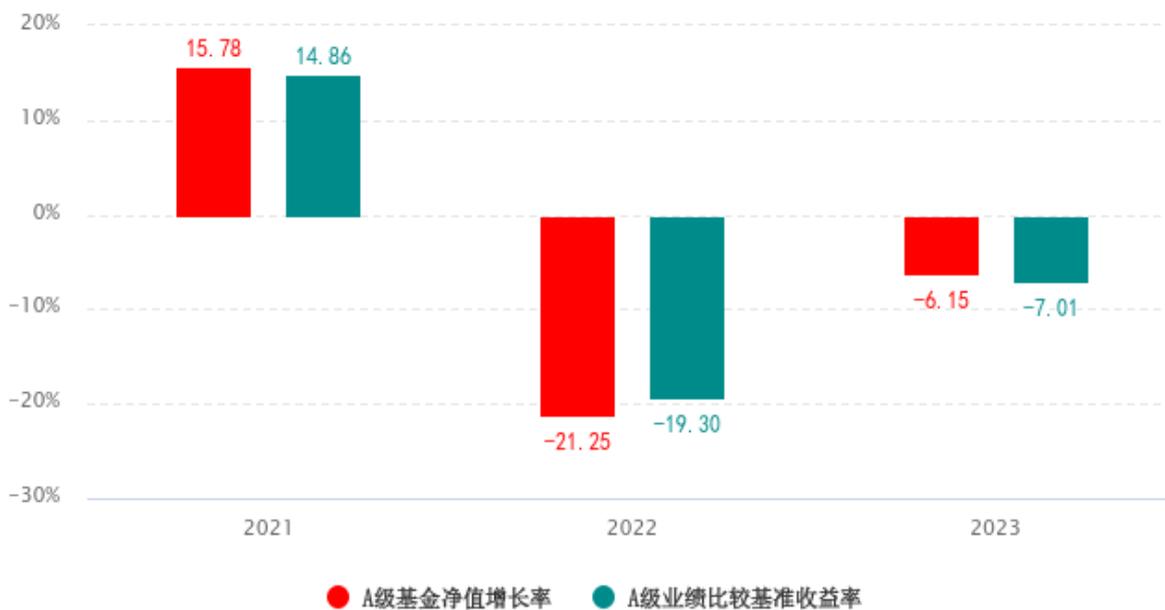


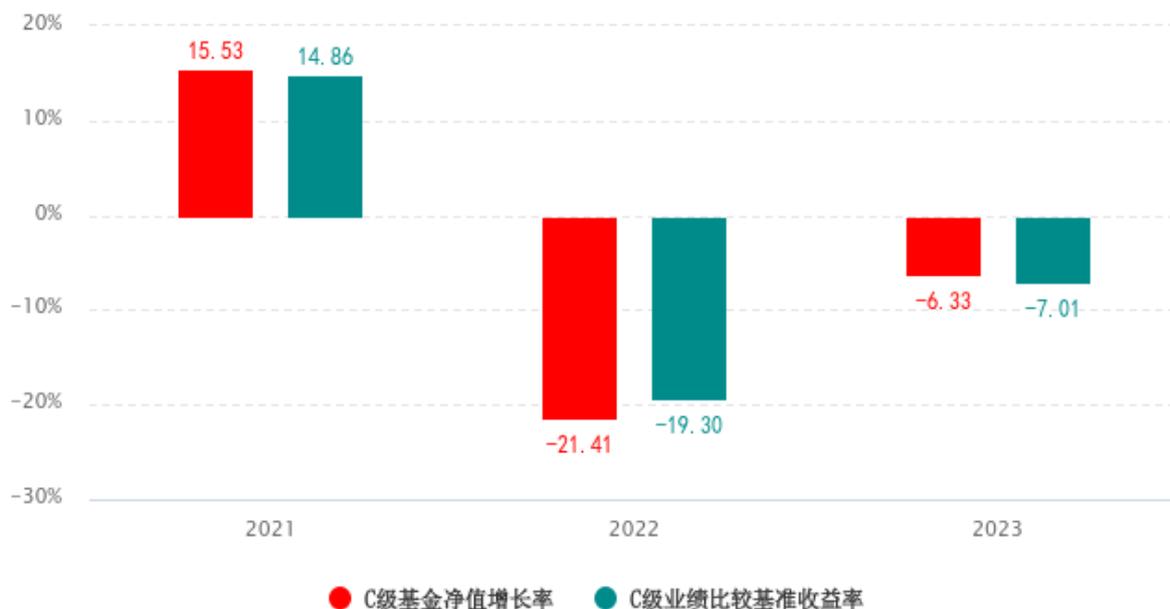
C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021年03月01日-2023年12月31日)



注：1、本基金成立于 2021 年 3 月 1 日；2、比较基准：中证 500 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 2021 年 3 月 1 日；2、比较基准：中证 500 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：本基金过往三年内未进行过利润分配。

§ 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

兴银基金管理有限责任公司，注册地为福建省平潭综合实验区，公司主要办公场所位于上海市浦东新区。公司股东为华福证券有限责任公司与国脉科技股份有限公司。本公司经证监会证监许可（2013）1289 号文批准，于 2013 年 10 月 25 日成立。2016 年 9 月 23 日，公司股东同比例增资，公司注册资本由 10,000 万元变更为 14,300 万元。增资后股东出资比例维持不变，华福证券有限责任公司出资比例为 76%，国脉科技股份有限公司出资比例为 24%。2016 年 10 月 24 日，公司法定名称由“华福基金管理有限责任公司”变更为“兴银基金管理有限责任公司”。截至报告期末，本公司共管理基金 50 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	2021-03-01	2023-02-24	12 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责任公司，现任指数与量化投资部基金经理。
林学晨	本基金的基金经理	2021-07-16	-	9 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责任公司，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。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情形，无须披露该项。

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同向交易价差的分析，确保公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

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 500 指数增强 A 基金份额净值为 0.8557 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-6.15%，同期业绩比较基准收益率为-7.01%；截至报告期末兴银中证 500 指数增强 C 基金份额净值为 0.8504 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-6.33%，同期业绩比较基准收益率为-7.01%。

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 2023 年，随着疫情政策的调整，我们认为可以关注市场的三条主线：

1、 疫情放开和地产托底的政策预期；展望 2023 年，我们认为消费复苏和地产企稳不仅是具

备业绩弹性的主线，也是宏观经济向上的主要推动力，是其他主线盈利复苏的前提假设。

2、互联网+数字经济；2022 年底中央经济工作会议旗帜鲜明支持数字经济和平台企业发展，我们预计互联网和数字经济有望在 2023 年的经济复苏过程中继续扮演重要角色。

3、后疫情时代的医疗行业机会：从新冠防治、到后疫情时代持续复苏的医药细分领域。医药板块受疫情影响，内部结构分化十分显著，伴随主要城市疫情快速“过峰”，当前市场对业绩的预期已经渡过新冠的预防、治疗阶段，开始进入后疫情时代行业盈利长期修复的环节。

围绕上述主线，投资者可以关注消费、计算机、医疗器械、新能源等行业的投资机会。

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与优化。本基金管理人主要监察稽核工作如下：

(1) 加强公司和基金日常运作的合规审核。做好在新基金产品开发、新投资品种、及其他创新业务中法律、合规及风险控制方面的支持，坚持定期对投资、研究、交易、核算、销售等各项业务实施事前、事中、事后的合规性审核，确保基金运作的诚信和合法合规性符合监管要求。

(2) 深入重点专项稽核工作。本基金管理人进一步梳理业务模式、主要监管规则、潜在风险点等，全面、深入地对关键业务领域进行专项稽核，内容涵盖相关业务领域的各个重要环节的内部控制与风险防范，促进制度规章及时更新，优化操作流程，提升业务线合规管理及风控意识。

(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，并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。本基金管理人及时根据新颁布的法律法规开展合规宣传培训工作，通过专题培训、律师讲座、合规期刊等多种形式进一步加强内部合规培训力度，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，做好旗下各支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，努力防范和控制各种风险，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。

本报告期内本基金没有应分配但尚未分配的利润。

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——兴银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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对兴银基金管理有限公司编制和披露的兴银中证 500 指数增强型证券投资基金 2023 年年度报告中财务指标、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 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 2401567 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 500 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了后附的兴银中证 500 指数增强型证券投资基金（以下简称“该基金”）财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表、2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>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 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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。</p>
强调事项	—
其他事项	—

其他信息	<p>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 2023 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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>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。</p> <p>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：</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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</p>

	<p>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。</p> <p>(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。</p> <p>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。</p>	
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	欧梦澈
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	2024-03-27	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：兴银中证 500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	4,582,838.77	9,211,826.00
结算备付金		2,166,173.16	4,743,451.77
存出保证金		290,276.55	1,398,548.44
交易性金融资产	7.4.7.2	76,351,790.94	83,057,935.12
其中：股票投资		76,351,790.94	83,057,935.12
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		58,058.78	44,560.04
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-

资产总计		83,449,138.20	98,456,321.37
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		0.01	864.00
应付赎回款		72,695.14	76,753.96
应付管理人报酬		56,253.31	68,639.95
应付托管费		14,063.32	17,160.00
应付销售服务费		9,104.65	11,537.38
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	306,971.21	383,754.46
负债合计		459,087.64	558,709.75
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	97,380,612.29	107,675,480.76
未分配利润	7.4.7.8	-14,390,561.73	-9,777,869.14
净资产合计		82,990,050.56	97,897,611.62
负债和净资产总计		83,449,138.20	98,456,321.37

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 97,380,612.29 份。其中兴银中证 500 指数增强 A 基金份额净值 0.8557 元，基金份额总额 33,886,165.83 份；兴银中证 500 指数增强 C 基金份额净值 0.8504 元，基金份额总额 63,494,446.46 份。

7.2 利润表

会计主体：兴银中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-3,930,655.78	-49,714,122.12
1. 利息收入		40,887.06	113,264.61
其中：存款利息收入	7.4.7.9	40,887.06	112,445.43
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		-	819.18
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-6,581,135.30	-45,250,317.31
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-7,932,429.12	-43,310,804.18
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	-	-
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	-133,047.23	-3,840,966.83
股利收益	7.4.7.15	1,484,341.05	1,901,453.70
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	2,596,452.02	-4,638,581.30
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	13,140.44	61,511.88
减：二、营业总支出		1,370,217.08	2,221,057.81
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	742,945.49	1,290,500.67
2. 托管费	7.4.10.2.2	185,736.35	322,625.22
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	123,649.59	244,431.92
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		1,325.65	-
8. 其他费用	7.4.7.18	316,560.00	363,500.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-5,300,872.86	-51,935,179.93
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-5,300,872.86	-51,935,179.93
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-5,300,872.86	-51,935,179.93

7.3 净资产变动表

会计主体：兴银中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 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	107,675,480.76	-9,777,869.14	97,897,611.62
二、本期期初净资产	107,675,480.76	-9,777,869.14	97,897,611.62
三、本期增减变动额（减少以	-10,294,868.47	-4,612,692.59	-14,907,561.06

“-”号填列)			
(一)、综合收益总额	-	-5,300,872.86	-5,300,872.86
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-10,294,868.47	688,180.27	-9,606,688.20
其中:1.基金申购款	27,182,506.87	-2,238,973.76	24,943,533.11
2.基金赎回款	-37,477,375.34	2,927,154.03	-34,550,221.31
(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	97,380,612.29	-14,390,561.73	82,990,050.56
项 目	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 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	241,135,840.82	37,557,416.06	278,693,256.88
二、本期期初净资产	241,135,840.82	37,557,416.06	278,693,256.88
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-133,460,360.06	-47,335,285.20	-180,795,645.26
(一)、综合收益总额	-	-51,935,179.93	-51,935,179.93
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-133,460,360.06	4,599,894.73	-128,860,465.33
其中:1.基金申购款	43,010,772.70	286,501.80	43,297,274.50
2.基金赎回款	-176,471,132.76	4,313,392.93	-172,157,739.83
(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	107,675,480.76	-9,777,869.14	97,897,611.62

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:

赵建兴

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 500 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”)证监许可(2020)3444 号注册募集。《兴银中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2021 年 3 月 1 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 264,037,562.28 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》、《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 500 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，含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、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 500 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>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

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 2023 年 12 月 31 日的财务状况、2023 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。

本基金现无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。

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。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。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

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；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；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；本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机构另有规定的，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。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税

[2023] 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

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

b) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

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

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

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

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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	4,582,838.77	9,211,826.00
等于：本金	4,582,541.53	9,210,852.55

加：应计利息	297.24	973.45
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	4,582,838.77	9,211,826.00

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		76,497,181.93	-	76,351,790.94	-145,390.99
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		76,497,181.93	-	76,351,790.94	-145,390.99
项目		上年度末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		85,687,451.46	-	83,057,935.12	2,629,516.34
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		85,687,451.46	-	83,057,935.12	-

				2,629,516.34
--	--	--	--	--------------

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 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	2,212,453.33	-	-	-
——股指期货	2,212,453.33	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,212,453.33	-	-	-
项目	上年度末 2022 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	9,549,420.00	-	-	-
——股指期货	9,549,420.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	9,549,420.00	-	-	-

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/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2401	中证 500 股指期货 IC2401	2	2,174,720.00	-37,733.33
合计				-37,733.33
减：可抵销期货暂收款				-37,733.33
净额				-

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报告期末无买入返售金融资产。

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报告期末无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报告期末无其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	26.57
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	108,721.21	141,977.89
其中：交易所市场	108,721.21	141,977.89
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	98,250.00	141,750.00
应付指数使用费	100,000.00	100,000.00
合计	306,971.21	383,754.46

7.4.7.7 实收基金**兴银中证 500 指数增强 A**

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	34,892,385.20	34,892,385.20
本期申购	7,113,883.70	7,113,883.70
本期赎回（以“-”号填列）	-8,120,103.07	-8,120,103.07
本期末	33,886,165.83	33,886,165.83

兴银中证 500 指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	72,783,095.56	72,783,095.56
本期申购	20,068,623.17	20,068,623.17
本期赎回（以“-”号填列）	-29,357,272.27	-29,357,272.27
本期末	63,494,446.46	63,494,446.46

7.4.7.8 未分配利润

兴银中证 500 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	-1,653,645.45	-1,424,185.06	-3,077,830.51
本期期初	-1,653,645.45	-1,424,185.06	-3,077,830.51
本期利润	-2,631,903.62	828,025.02	-1,803,878.60
本期基金份额交易产生的变动数	-58,357.38	49,883.83	-8,473.55
其中：基金申购款	-498,948.23	-123,075.22	-622,023.45
基金赎回款	440,590.85	172,959.05	613,549.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,343,906.45	-546,276.21	-4,890,182.66

兴银中证 500 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	-3,740,450.57	-2,959,588.06	-6,700,038.63
本期期初	-3,740,450.57	-2,959,588.06	-6,700,038.63
本期利润	-5,265,421.26	1,768,427.00	-3,496,994.26
本期基金份额交易产生的变动数	526,389.88	170,263.94	696,653.82
其中：基金申购款	-1,225,322.18	-391,628.13	-1,616,950.31
基金赎回款	1,751,712.06	561,892.07	2,313,604.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-8,479,481.95	-1,020,897.12	-9,500,379.07

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	17,832.75	59,063.58

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	22,196.86	50,083.26
其他	857.45	3,298.59
合计	40,887.06	112,445.43

注：其他为交易保证金利息收入。

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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	1,311,159,454.24	3,177,098,519.35
减：卖出股票成本总额	1,317,221,234.57	3,215,291,631.70
减：交易费用	1,870,648.79	5,117,691.83
买卖股票差价收入	-7,932,429.12	-43,310,804.18

7.4.7.10.2 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

7.4.7.11 债券投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间内无债券投资收益。

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间内无资产支持证券投资收益。

7.4.7.13 贵金属投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间内无贵金属投资收益。

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：无。

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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	-114,526.67	-3,818,800.00
减：其他衍生工具收益应缴纳	13,256.51	-

增值税		
减：交易费用	5,264.05	22,166.83
合计	-133,047.23	-3,840,966.83

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	1,484,341.05	1,901,453.70
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,484,341.05	1,901,453.70

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	2,484,125.35	-4,366,248.44
——股票投资	2,484,125.35	-4,366,248.44
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	112,326.67	-276,380.00
——权证投资	-	-
——期货投资	112,326.67	-276,380.00
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-4,047.14
合计	2,596,452.02	-4,638,581.30

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	13,133.92	61,291.50
转换费收入	6.52	220.38
合计	13,140.44	61,511.88

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	36,500.00	43,500.00
信息披露费	80,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	200,000.00	200,000.00
银行汇划费	60.00	-
合计	316,560.00	363,500.00

7.4.7.19 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

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
兴银基金管理有限责任公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
浙商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
华福证券有限责任公司	基金管理人的股东、基金销售机构
国脉科技股份有限公司	基金管理人的股东
上海兴瀚资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

注：本基金与关联方的所有交易均是在正常业务中按照一般商业条款订立。

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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 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	328,385,458.74	12.54%	1,773,414,134.07	28.45%

7.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间内无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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 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	-	-	10,000,000.00	100.00%

注：本基金本报告期内无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 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	75,953.89	13.70%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 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	410,212.91	29.26%	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的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。权证交易不计佣金。

2、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等。

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 2023 年 01 月 01 日至	上年度可比期间 2022 年 01 月
----	----------------------	---------------------

	2023 年 12 月 31 日	01 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	742,945.49	1,290,500.67
其中：应支付销售机构的客户维护费	323,124.37	443,946.06
应支付基金管理人的净管理费	419,821.12	846,554.61

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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	185,736.35	322,625.22

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 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 500 指数增强 A	兴银中证 500 指数增强 C	合计
华福证券	-	3,697.98	3,697.98
浙商银行	-	5,817.66	5,817.66
兴银基金	-	1.01	1.01
合计	-	9,516.65	9,516.65
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 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 500 指数增强 A	兴银中证 500 指数增强 C	合计
浙商银行	-	6,981.51	6,981.51

兴银基金	-	61,302.05	61,302.05
华福证券	-	3,396.10	3,396.10
合计	-	71,679.66	71,679.66

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.20%，销售服务费计提的计算公式如下：

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

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

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：本基金本报告期及上年度可比期间内无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。

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

兴银中证 500 指数增强 A

份额单位：份

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2021 年 03 月 01 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	2,649,624.28	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	2,649,624.28	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.72%	-

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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日 至 2022 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
浙商银行股份有限 公司	4,582,838.77	17,832.75	9,211,826.00	59,063.58

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。

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内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

无其他需要说明的关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2023 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：无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

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**

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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：本基金于本报告期末及上年度末均未持有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：本基金于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。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于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。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有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：本基金于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。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于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。

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，确保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，有效保障基金持有人利益。

本基金所持大部分证券为依法上市的股票等资产，本报告期末本基金持有的资产均能及时变现。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 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	4,582,838.77	-	-	-	-	-	4,582,838.77
结算备付金	2,166,173.16	-	-	-	-	-	2,166,173.16
存出保证金	290,276.55	-	-	-	-	-	290,276.55
交易性金融资产	-	-	-	-	-	76,351,790.94	76,351,790.94
应收申购款	-	-	-	-	-	58,058.78	58,058.78
资产总计	7,039,288.48	-	-	-	-	76,409,849.72	83,449,138.20
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	0.01	0.01
应付赎回款	-	-	-	-	-	72,695.14	72,695.14
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	56,253.31	56,253.31
应付托管费	-	-	-	-	-	14,063.32	14,063.32
应付销售服务费	-	-	-	-	-	9,104.65	9,104.65
其他负债	-	-	-	-	-	306,971.21	306,971.21
负债总计	-	-	-	-	-	459,087.64	459,087.64
利率敏感度缺口	7,039,288.48	-	-	-	-	75,950,762.08	82,990,050.56
上年度末 2022 年 12 月 31	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

日							
资产							
货币资金	9,211,826.00	-	-	-	-	-	9,211,826.00
结算备付金	4,743,451.77	-	-	-	-	-	4,743,451.77
存出保证金	1,398,548.44	-	-	-	-	-	1,398,548.44
交易性金融资产	-	-	-	-	-	83,057,935.12	83,057,935.12
应收申购款	-	-	-	-	-	44,560.04	44,560.04
资产总计	15,353,826.21	-	-	-	-	83,102,495.16	98,456,321.37
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	864	864
应付赎回款	-	-	-	-	-	76,753.96	76,753.96
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	68,639.95	68,639.95
应付托管费	-	-	-	-	-	17,160.00	17,160.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-	11,537.38	11,537.38
其他负债	-	-	-	-	-	383,754.46	383,754.46
负债总计	-	-	-	-	-	558,709.75	558,709.75
利率敏感度缺口	15,353,826.21	-	-	-	-	82,543,785.41	97,897,611.62

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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	-	-
	市场利率下降 25 个基点	-	-

注：于 12 月 31 日，本基金未持有对利率敏感的金融资产与金融负债。因此，市场利率的变动对本基金资产的净值无重大影响。

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汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

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

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 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	76,351,790.94	92.00	83,057,935.12	84.84
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	76,351,790.94	92.00	83,057,935.12	84.84

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除下述市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上涨 5%	2,857,166.30	3,921,685.91
	沪深 300 指数下跌 5%	-2,857,166.30	-3,921,685.91

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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	76,351,790.94	83,057,935.12
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	76,351,790.94	83,057,935.12

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。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 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（2022 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 2023 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	76,351,790.94	91.50
	其中：股票	76,351,790.94	91.50
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	6,749,011.93	8.09
8	其他各项资产	348,335.33	0.42
9	合计	83,449,138.20	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	353,169.00	0.43
B	采矿业	2,394,933.00	2.89
C	制造业	38,898,842.74	46.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,366,338.00	2.85
E	建筑业	902,807.00	1.09
F	批发和零售业	1,110,693.08	1.34
G	交通运输、仓储和邮政业	1,979,904.00	2.39
H	住宿和餐饮业	179,630.00	0.22
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,276,569.97	3.95
J	金融业	4,840,372.00	5.83
K	房地产业	628,679.00	0.76
L	租赁和商务服务业	904,163.00	1.09
M	科学研究和技术服务业	317,795.06	0.38
N	水利、环境和公共设施管理业	827,182.00	1.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	6,120.00	0.01
Q	卫生和社会工作	292,442.00	0.35
R	文化、体育和娱乐业	1,702,985.81	2.05
S	综合	324,774.00	0.39
	合计	61,307,399.66	73.87

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	45,352.00	0.05
B	采矿业	274,981.00	0.33
C	制造业	10,587,033.39	12.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	388,393.00	0.47
E	建筑业	240,950.00	0.29
F	批发和零售业	380,064.00	0.46
G	交通运输、仓储和邮政业	229,900.00	0.28
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,272,379.26	1.53

J	金融业	478,126.00	0.58
K	房地产业	208,023.00	0.25
L	租赁和商务服务业	215,587.00	0.26
M	科学研究和技术服务业	362,235.33	0.44
N	水利、环境和公共设施管理业	241,367.30	0.29
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	20,208.00	0.02
Q	卫生和社会工作	4,538.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	95,254.00	0.11
S	综合	-	-
	合计	15,044,391.28	18.13

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	600901	江苏金租	180,800	875,072.00	1.05
2	002925	盈趣科技	38,900	757,383.00	0.91
3	600582	天地科技	122,700	667,488.00	0.80
4	000050	深天马 A	61,100	650,715.00	0.78
5	000598	兴蓉环境	112,500	640,125.00	0.77
6	000513	丽珠集团	17,300	605,673.00	0.73
7	002273	水晶光电	43,200	584,928.00	0.70
8	002429	兆驰股份	104,200	581,436.00	0.70
9	002019	亿帆医药	38,000	561,640.00	0.68
10	600863	内蒙华电	138,900	541,710.00	0.65
11	000960	锡业股份	37,100	531,272.00	0.64
12	600707	彩虹股份	78,000	526,500.00	0.63
13	002078	太阳纸业	42,900	522,093.00	0.63
14	600066	宇通客车	36,900	488,925.00	0.59
15	000060	中金岭南	111,121	480,042.72	0.58
16	600350	山东高速	68,500	475,390.00	0.57
17	603228	景旺电子	20,800	469,248.00	0.57
18	002600	领益智造	68,800	465,088.00	0.56
19	300296	利亚德	77,000	462,000.00	0.56
20	002010	传化智联	99,900	461,538.00	0.56
21	601717	郑煤机	35,700	451,605.00	0.54
22	300009	安科生物	44,100	450,702.00	0.54
23	600637	东方明珠	58,300	438,416.00	0.53

24	002939	长城证券	52,800	422,400.00	0.51
25	000039	中集集团	54,800	419,220.00	0.51
26	600282	南钢股份	113,100	418,470.00	0.50
27	601000	唐山港	118,300	414,050.00	0.50
28	603866	桃李面包	53,500	409,810.00	0.49
29	300253	卫宁健康	56,000	402,640.00	0.49
30	300558	贝达药业	7,800	402,090.00	0.48
31	300136	信维通信	17,000	401,200.00	0.48
32	002056	横店东磁	29,500	399,430.00	0.48
33	600398	海澜之家	53,800	399,196.00	0.48
34	601608	中信重工	103,300	398,738.00	0.48
35	600737	中粮糖业	48,300	397,992.00	0.48
36	000959	首钢股份	114,000	394,440.00	0.48
37	300776	帝尔激光	6,500	391,690.00	0.47
38	300866	安克创新	4,400	389,840.00	0.47
39	002152	广电运通	31,700	388,642.00	0.47
40	300251	光线传媒	46,200	376,530.00	0.45
41	600549	厦门钨业	21,900	376,242.00	0.45
42	000930	中粮科技	55,600	369,184.00	0.44
43	600517	国网英大	77,000	367,290.00	0.44
44	600977	中国电影	29,700	363,528.00	0.44
45	002138	顺络电子	13,200	356,532.00	0.43
46	002373	千方科技	30,600	343,026.00	0.41
47	600739	辽宁成大	28,900	340,442.00	0.41
48	002064	华峰化学	50,600	339,526.00	0.41
49	002958	青农商行	129,200	338,504.00	0.41
50	601958	金钼股份	35,300	333,585.00	0.40
51	600927	永安期货	21,100	331,481.00	0.40
52	000623	吉林敖东	21,700	328,538.00	0.40
53	002563	森马服饰	56,200	324,274.00	0.39
54	600497	驰宏锌锗	63,400	320,170.00	0.39
55	600131	国网信通	21,000	318,150.00	0.38
56	002511	中顺洁柔	31,700	317,000.00	0.38
57	600970	中材国际	33,800	315,692.00	0.38
58	600820	隧道股份	54,700	315,072.00	0.38
59	300285	国瓷材料	13,200	305,184.00	0.37
60	603225	新风鸣	21,300	302,460.00	0.36
61	000400	许继电气	13,700	300,852.00	0.36
62	000559	万向钱潮	56,300	292,197.00	0.35
63	600879	航天电子	37,300	287,583.00	0.35
64	601568	北元集团	60,200	285,348.00	0.34
65	300088	长信科技	42,500	284,325.00	0.34
66	600060	海信视像	13,600	284,240.00	0.34

67	002223	鱼跃医疗	8,200	283,556.00	0.34
68	601991	大唐发电	116,600	282,172.00	0.34
69	600642	申能股份	43,800	281,196.00	0.34
70	000997	新大陆	14,300	280,423.00	0.34
71	002008	大族激光	13,500	279,720.00	0.34
72	002408	齐翔腾达	52,800	278,784.00	0.34
73	300257	开山股份	17,600	277,376.00	0.33
74	601168	西部矿业	19,400	276,838.00	0.33
75	000878	云南铜业	25,400	276,606.00	0.33
76	603185	弘元绿能	8,300	276,224.00	0.33
77	000581	威孚高科	18,100	272,767.00	0.33
78	600155	华创云信	32,600	271,884.00	0.33
79	002867	周大生	17,900	271,722.00	0.33
80	600566	济川药业	8,600	270,298.00	0.33
81	600535	天士力	15,700	267,214.00	0.32
82	600481	双良节能	31,500	266,490.00	0.32
83	002044	美年健康	44,200	265,642.00	0.32
84	300001	特锐德	13,200	265,320.00	0.32
85	000967	盈峰环境	55,800	265,050.00	0.32
86	601098	中南传媒	26,000	264,420.00	0.32
87	600126	杭钢股份	49,600	264,368.00	0.32
88	300861	美畅股份	7,900	262,991.00	0.32
89	002262	恩华药业	9,500	257,640.00	0.31
90	002030	达安基因	26,600	257,488.00	0.31
91	601298	青岛港	40,800	252,144.00	0.30
92	603568	伟明环保	15,700	251,200.00	0.30
93	002128	电投能源	17,000	242,590.00	0.29
94	000156	华数传媒	32,400	238,788.00	0.29
95	600390	五矿资本	50,700	237,276.00	0.29
96	600377	宁沪高速	22,800	233,700.00	0.28
97	000937	冀中能源	32,600	232,764.00	0.28
98	601106	中国一重	79,800	229,824.00	0.28
99	002653	海思科	9,900	229,185.00	0.28
100	603160	汇顶科技	3,300	228,030.00	0.27
101	002439	启明星辰	8,400	226,800.00	0.27
102	300070	碧水源	44,800	223,552.00	0.27
103	300676	华大基因	4,600	220,800.00	0.27
104	000636	风华高科	15,900	217,194.00	0.26
105	600871	石化油服	117,200	214,476.00	0.26
106	600416	湘电股份	13,400	212,792.00	0.26
107	600486	扬农化工	3,350	211,452.00	0.25
108	002203	海亮股份	18,900	210,735.00	0.25
109	600663	陆家嘴	24,000	210,000.00	0.25

110	000830	鲁西化工	20,800	208,624.00	0.25
111	600141	兴发集团	11,400	208,050.00	0.25
112	600862	中航高科	9,300	205,995.00	0.25
113	002414	高德红外	28,100	205,130.00	0.25
114	000563	陕国投 A	67,000	203,680.00	0.25
115	603218	日月股份	16,400	202,868.00	0.24
116	688188	柏楚电子	800	202,488.00	0.24
117	603688	石英股份	2,300	199,824.00	0.24
118	002595	豪迈科技	6,700	199,459.00	0.24
119	688029	南微医学	2,058	199,214.40	0.24
120	600998	九州通	28,408	199,140.08	0.24
121	600598	北大荒	16,500	197,505.00	0.24
122	000009	中国宝安	16,800	197,232.00	0.24
123	600177	雅戈尔	30,100	197,155.00	0.24
124	002926	华西证券	25,400	197,104.00	0.24
125	002025	航天电器	4,100	196,882.00	0.24
126	000887	中鼎股份	15,800	195,446.00	0.24
127	603305	旭升集团	9,900	195,327.00	0.24
128	002683	广东宏大	9,700	194,776.00	0.23
129	603596	伯特利	2,800	194,040.00	0.23
130	600415	小商品城	26,500	193,980.00	0.23
131	688006	杭可科技	8,248	193,663.04	0.23
132	688387	信科移动	26,777	193,062.17	0.23
133	688208	道通科技	8,084	191,995.00	0.23
134	002568	百润股份	7,800	191,958.00	0.23
135	688297	中无人机	5,000	191,650.00	0.23
136	601058	赛轮轮胎	16,300	191,525.00	0.23
137	603267	鸿远电子	3,800	190,760.00	0.23
138	300118	东方日升	10,800	190,620.00	0.23
139	601611	中国核建	27,500	190,575.00	0.23
140	002791	坚朗五金	4,700	190,303.00	0.23
141	002531	天顺风能	16,400	190,240.00	0.23
142	603786	科博达	2,660	189,817.60	0.23
143	000591	太阳能	34,000	189,720.00	0.23
144	601636	旗滨集团	27,700	189,468.00	0.23
145	002399	海普瑞	16,060	188,383.80	0.23
146	300144	宋城演艺	19,000	187,530.00	0.23
147	600529	山东药玻	7,300	186,880.00	0.23
148	600580	卧龙电驱	15,900	186,507.00	0.22
149	603927	中科软	6,200	185,876.00	0.22
150	002558	巨人网络	16,500	183,810.00	0.22
151	603650	彤程新材	5,500	183,150.00	0.22
152	600062	华润双鹤	9,700	180,420.00	0.22

153	002739	万达电影	13,800	179,676.00	0.22
154	002294	信立泰	5,500	179,630.00	0.22
155	600258	首旅酒店	11,500	179,630.00	0.22
156	002572	索菲亚	11,200	178,640.00	0.22
157	000898	鞍钢股份	71,700	178,533.00	0.22
158	688002	睿创微纳	4,030	178,206.60	0.21
159	600755	厦门国贸	25,300	176,341.00	0.21
160	000703	恒逸石化	25,800	173,376.00	0.21
161	000970	中科三环	16,700	172,845.00	0.21
162	601233	桐昆股份	11,400	172,482.00	0.21
163	002092	中泰化学	28,000	170,800.00	0.21
164	600867	通化东宝	15,700	170,031.00	0.20
165	601992	金隅集团	87,800	167,698.00	0.20
166	000547	航天发展	19,700	164,889.00	0.20
167	601228	广州港	52,000	162,760.00	0.20
168	300682	朗新科技	9,900	162,261.00	0.20
169	600500	中化国际	36,200	160,004.00	0.19
170	002065	东华软件	25,800	159,186.00	0.19
171	688425	铁建重工	40,092	159,165.24	0.19
172	002625	光启技术	10,700	158,146.00	0.19
173	001872	招商港口	9,800	156,408.00	0.19
174	000825	太钢不锈	41,900	156,287.00	0.19
175	600583	海油工程	26,100	155,034.00	0.19
176	002353	杰瑞股份	5,500	154,605.00	0.19
177	601179	中国西电	30,800	151,844.00	0.18
178	002422	科伦药业	5,200	151,060.00	0.18
179	600848	上海临港	14,800	148,740.00	0.18
180	300888	稳健医疗	3,900	145,275.00	0.18
181	000998	隆平高科	10,100	142,410.00	0.17
182	002080	中材科技	8,900	141,688.00	0.17
183	601828	美凯龙	35,900	138,933.00	0.17
184	300037	新宙邦	2,900	137,170.00	0.17
185	000089	深圳机场	21,100	135,673.00	0.16
186	600166	福田汽车	49,600	135,408.00	0.16
187	603707	健友股份	8,800	132,000.00	0.16
188	600079	人福医药	5,200	129,272.00	0.16
189	600673	东阳光	17,400	127,542.00	0.15
190	000958	电投产融	32,000	126,080.00	0.15
191	002028	思源电气	2,400	124,896.00	0.15
192	002432	九安医疗	3,300	124,311.00	0.15
193	002423	中粮资本	17,800	118,904.00	0.14
194	600352	浙江龙盛	14,000	117,600.00	0.14
195	600704	物产中大	26,300	116,509.00	0.14

196	603077	和邦生物	47,500	112,100.00	0.14
197	000975	银泰黄金	7,400	111,000.00	0.13
198	603156	养元饮品	5,200	110,552.00	0.13
199	002465	海格通信	8,600	110,510.00	0.13
200	601187	厦门银行	21,400	108,498.00	0.13
201	688728	格科微	5,295	108,388.65	0.13
202	000933	神火股份	6,400	107,520.00	0.13
203	601231	环旭电子	7,100	107,281.00	0.13
204	600873	梅花生物	11,200	106,960.00	0.13
205	600959	江苏有线	33,300	104,562.00	0.13
206	000423	东阿阿胶	2,100	103,572.00	0.12
207	600967	内蒙一机	12,500	103,250.00	0.12
208	002532	天山铝业	17,000	102,170.00	0.12
209	000778	新兴铸管	26,700	101,994.00	0.12
210	002032	苏泊尔	1,900	100,719.00	0.12
211	000728	国元证券	14,700	100,401.00	0.12
212	000785	居然之家	30,200	99,660.00	0.12
213	601577	长沙银行	14,600	99,572.00	0.12
214	600909	华安证券	20,400	99,552.00	0.12
215	600511	国药股份	3,400	97,308.00	0.12
216	600380	健康元	7,800	96,954.00	0.12
217	603026	胜华新材	2,100	96,306.00	0.12
218	600329	达仁堂	2,800	94,220.00	0.11
219	601997	贵阳银行	18,300	94,062.00	0.11
220	601928	凤凰传媒	10,501	92,513.81	0.11
221	002966	苏州银行	14,300	92,378.00	0.11
222	002517	恺英网络	8,200	91,594.00	0.11
223	600928	西安银行	27,500	91,575.00	0.11
224	600985	淮北矿业	5,500	91,465.00	0.11
225	600167	联美控股	16,100	91,287.00	0.11
226	002468	申通快递	11,600	90,364.00	0.11
227	000027	深圳能源	13,900	89,655.00	0.11
228	000987	越秀资本	14,700	88,494.00	0.11
229	000537	中绿电	9,100	87,633.00	0.11
230	002266	浙富控股	25,700	87,380.00	0.11
231	002936	郑州银行	43,200	86,832.00	0.10
232	600339	中油工程	28,300	85,749.00	0.10
233	000709	河钢股份	40,000	85,200.00	0.10
234	603355	莱克电气	3,817	85,119.10	0.10
235	000932	华菱钢铁	16,500	84,975.00	0.10
236	002673	西部证券	13,300	84,721.00	0.10
237	000401	冀东水泥	13,100	83,709.00	0.10
238	002608	江苏国信	12,700	83,439.00	0.10

239	601216	君正集团	21,300	79,662.00	0.10
240	601665	齐鲁银行	20,200	78,982.00	0.10
241	600170	上海建工	33,500	78,390.00	0.09
242	001227	兰州银行	30,000	78,000.00	0.09
243	000402	金融街	21,000	76,230.00	0.09
244	000031	大悦城	24,900	73,953.00	0.09
245	001203	大中矿业	6,900	70,173.00	0.08
246	600008	首创环保	23,800	64,022.00	0.08
247	603883	老百姓	1,500	44,835.00	0.05
248	600109	国金证券	4,300	39,044.00	0.05
249	601198	东兴证券	4,000	32,920.00	0.04
250	003035	南网能源	6,200	32,612.00	0.04
251	600528	中铁工业	3,800	28,272.00	0.03
252	688516	奥特维	300	27,150.00	0.03
253	688281	华秦科技	200	27,132.00	0.03
254	600516	方大炭素	4,800	25,152.00	0.03
255	688348	昱能科技	200	24,476.00	0.03
256	688200	华峰测控	197	24,191.60	0.03
257	003022	联泓新科	1,300	23,803.00	0.03
258	600655	豫园股份	3,800	23,598.00	0.03
259	601077	渝农商行	5,400	22,032.00	0.03
260	688248	南网科技	874	21,823.78	0.03
261	002507	涪陵榨菜	1,500	21,435.00	0.03
262	300474	景嘉微	300	21,213.00	0.03
263	688063	派能科技	200	21,200.00	0.03
264	688082	盛美上海	200	20,882.00	0.03
265	601162	天风证券	6,600	20,394.00	0.02
266	300595	欧普康视	900	20,322.00	0.02
267	600597	光明乳业	2,300	20,079.00	0.02
268	300012	华测检测	1,400	19,880.00	0.02
269	000519	中兵红箭	1,400	19,656.00	0.02
270	603317	天味食品	1,432	19,031.28	0.02
271	688536	思瑞浦	128	18,726.40	0.02
272	300699	光威复材	700	18,669.00	0.02
273	002690	美亚光电	950	18,658.00	0.02
274	600801	华新水泥	1,500	18,645.00	0.02
275	601555	东吴证券	2,500	18,275.00	0.02
276	688567	孚能科技	1,100	17,941.00	0.02
277	600499	科达制造	1,700	17,935.00	0.02
278	601128	常熟银行	2,800	17,892.00	0.02
279	000988	华工科技	600	17,856.00	0.02
280	600418	江淮汽车	1,100	17,765.00	0.02
281	600143	金发科技	2,200	17,578.00	0.02

282	002430	杭氧股份	600	17,526.00	0.02
283	600546	山煤国际	1,000	17,510.00	0.02
284	002340	格林美	3,200	17,472.00	0.02
285	603233	大参林	700	17,430.00	0.02
286	688114	华大智造	200	17,204.00	0.02
287	601158	重庆水务	3,000	17,010.00	0.02
288	002409	雅克科技	300	16,719.00	0.02
289	600399	抚顺特钢	1,700	16,524.00	0.02
290	002831	裕同科技	600	16,506.00	0.02
291	601016	节能风电	5,500	16,500.00	0.02
292	605358	立昂微	600	16,434.00	0.02
293	002384	东山精密	900	16,362.00	0.02
294	600392	盛和资源	1,600	16,288.00	0.02
295	688690	纳微科技	594	16,287.48	0.02
296	600925	苏能股份	2,900	15,979.00	0.02
297	688375	国博电子	200	15,906.00	0.02
298	688521	芯原股份	312	15,587.52	0.02
299	601108	财通证券	2,000	15,520.00	0.02
300	002463	沪电股份	700	15,484.00	0.02
301	600161	天坛生物	500	15,470.00	0.02
302	688385	复旦微电	400	15,452.00	0.02
303	300073	当升科技	400	15,280.00	0.02
304	600378	昊华科技	500	15,240.00	0.02
305	688072	拓荆科技	65	15,034.50	0.02
306	300418	昆仑万维	400	14,960.00	0.02
307	600315	上海家化	700	14,826.00	0.02
308	600316	洪都航空	700	14,819.00	0.02
309	300724	捷佳伟创	200	14,802.00	0.02
310	000630	铜陵有色	4,500	14,760.00	0.02
311	300244	迪安诊断	600	14,286.00	0.02
312	603737	三棵树	300	14,283.00	0.02
313	600827	百联股份	1,500	14,235.00	0.02
314	603127	昭衍新药	600	14,226.00	0.02
315	002624	完美世界	1,200	14,208.00	0.02
316	300438	鹏辉能源	500	14,145.00	0.02
317	600298	安琪酵母	400	14,072.00	0.02
318	600988	赤峰黄金	1,000	14,010.00	0.02
319	002156	通富微电	600	13,872.00	0.02
320	600885	宏发股份	500	13,820.00	0.02
321	600004	白云机场	1,400	13,692.00	0.02
322	002185	华天科技	1,600	13,632.00	0.02
323	603517	绝味食品	500	13,430.00	0.02
324	002487	大金重工	500	13,310.00	0.02

325	600160	巨化股份	800	13,192.00	0.02
326	002385	大北农	2,200	13,112.00	0.02
327	688390	固德威	100	13,058.00	0.02
328	603056	德邦股份	900	13,023.00	0.02
329	300003	乐普医疗	800	12,928.00	0.02
330	000783	长江证券	2,400	12,912.00	0.02
331	600859	王府井	800	12,776.00	0.02
332	600839	四川长虹	2,400	12,696.00	0.02
333	300383	光环新网	1,300	12,636.00	0.02
334	300363	博腾股份	500	12,575.00	0.02
335	688099	晶晨股份	200	12,526.00	0.02
336	603529	爱玛科技	500	12,520.00	0.02
337	603882	金域医学	200	12,514.00	0.02
338	600096	云天化	800	12,480.00	0.02
339	600764	中国海防	500	12,475.00	0.02
340	688169	石头科技	44	12,449.80	0.02
341	688331	荣昌生物	200	12,412.00	0.01
342	300568	星源材质	800	12,336.00	0.01
343	002797	第一创业	2,100	12,201.00	0.01
344	000066	中国长城	1,200	12,144.00	0.01
345	603939	益丰药房	300	12,012.00	0.01
346	300146	汤臣倍健	700	11,921.00	0.01
347	688778	厦钨新能	300	11,892.00	0.01
348	603826	坤彩科技	200	11,806.00	0.01
349	600271	航天信息	1,100	11,704.00	0.01
350	688779	长远锂科	1,600	11,680.00	0.01
351	002326	永太科技	1,000	11,620.00	0.01
352	002372	伟星新材	800	11,576.00	0.01
353	600765	中航重机	600	11,466.00	0.01
354	300604	长川科技	300	11,397.00	0.01
355	002444	巨星科技	500	11,260.00	0.01
356	600348	华阳股份	1,150	11,224.00	0.01
357	002738	中矿资源	300	11,193.00	0.01
358	603000	人民网	400	11,192.00	0.01
359	601990	南京证券	1,400	11,172.00	0.01
360	002518	科士达	400	11,040.00	0.01
361	300373	扬杰科技	300	11,010.00	0.01
362	300017	网宿科技	1,400	10,990.00	0.01
363	300395	菲利华	300	10,968.00	0.01
364	002505	鹏都农牧	6,800	10,880.00	0.01
365	600808	马钢股份	4,000	10,880.00	0.01
366	600536	中国软件	300	10,878.00	0.01
367	600995	南网储能	1,100	10,846.00	0.01

368	600699	均胜电子	600	10,776.00	0.01
369	002195	岩山科技	3,500	10,745.00	0.01
370	600956	新天绿能	1,300	10,569.00	0.01
371	603816	顾家家居	300	10,500.00	0.01
372	600032	浙江新能	1,300	10,478.00	0.01
373	002120	韵达股份	1,400	10,444.00	0.01
374	601666	平煤股份	900	10,404.00	0.01
375	600118	中国卫星	400	10,328.00	0.01
376	301029	怡合达	400	10,312.00	0.01
377	601696	中银证券	1,000	10,290.00	0.01
378	603338	浙江鼎力	200	10,234.00	0.01
379	603868	飞科电器	200	10,100.00	0.01
380	300058	蓝色光标	1,400	10,052.00	0.01
381	688772	珠海冠宇	449	9,882.49	0.01
382	688122	西部超导	185	9,847.55	0.01
383	000021	深科技	600	9,726.00	0.01
384	600895	张江高科	500	9,650.00	0.01
385	601966	玲珑轮胎	500	9,615.00	0.01
386	300850	新强联	300	9,549.00	0.01
387	000629	钒钛股份	2,900	9,512.00	0.01
388	300024	机器人	800	9,496.00	0.01
389	603712	七一二	300	9,453.00	0.01
390	600563	法拉电子	100	9,260.00	0.01
391	301236	软通动力	200	9,240.00	0.01
392	002497	雅化集团	700	9,163.00	0.01
393	300394	天孚通信	100	9,152.00	0.01
394	002407	多氟多	600	9,132.00	0.01
395	002240	盛新锂能	400	9,100.00	0.01
396	603589	口子窖	200	9,060.00	0.01
397	002268	电科网安	400	8,984.00	0.01
398	002368	太极股份	300	8,859.00	0.01
399	003031	中瓷电子	100	8,823.00	0.01
400	000683	远兴能源	1,500	8,805.00	0.01
401	600521	华海药业	600	8,802.00	0.01
402	600299	安迪苏	1,100	8,800.00	0.01
403	601456	国联证券	800	8,672.00	0.01
404	600153	建发股份	900	8,667.00	0.01
405	002299	圣农发展	500	8,590.00	0.01
406	603606	东方电缆	200	8,550.00	0.01
407	688105	诺唯赞	264	8,453.28	0.01
408	002850	科达利	100	8,446.00	0.01
409	688180	君实生物	200	8,366.00	0.01
410	000553	安道麦 A	1,200	8,328.00	0.01

411	000831	中国稀土	300	8,301.00	0.01
412	300748	金力永磁	400	8,088.00	0.01
413	000738	航发控制	400	7,960.00	0.01
414	688005	容百科技	200	7,960.00	0.01
415	000893	亚钾国际	300	7,872.00	0.01
416	002472	双环传动	300	7,806.00	0.01
417	000729	燕京啤酒	900	7,767.00	0.01
418	002865	钧达股份	100	7,748.00	0.01
419	600038	中直股份	200	7,706.00	0.01
420	600021	上海电力	900	7,614.00	0.01
421	300390	天华新能	300	7,605.00	0.01
422	300207	欣旺达	500	7,380.00	0.01
423	603456	九洲药业	300	7,263.00	0.01
424	600325	华发股份	1,000	7,210.00	0.01
425	603885	吉祥航空	600	7,200.00	0.01
426	600435	北方导航	600	7,044.00	0.01
427	688220	翱捷科技	100	7,044.00	0.01
428	002500	山西证券	1,300	7,007.00	0.01
429	002557	洽洽食品	200	6,964.00	0.01
430	601061	中信金属	900	6,939.00	0.01
431	000539	粤电力 A	1,400	6,846.00	0.01
432	688052	纳芯微	41	6,840.85	0.01
433	001286	陕西能源	800	6,840.00	0.01
434	600884	杉杉股份	500	6,810.00	0.01
435	688276	百克生物	124	6,796.44	0.01
436	300529	健帆生物	300	6,669.00	0.01
437	000723	美锦能源	1,000	6,660.00	0.01
438	600498	烽火通信	400	6,656.00	0.01
439	688234	天岳先进	100	6,607.00	0.01
440	688153	唯捷创芯	100	6,550.00	0.01
441	002508	老板电器	300	6,534.00	0.01
442	002670	国盛金控	700	6,524.00	0.01
443	601933	永辉超市	2,300	6,486.00	0.01
444	688538	和辉光电	2,644	6,424.92	0.01
445	603893	瑞芯微	100	6,340.00	0.01
446	300212	易华录	200	6,290.00	0.01
447	000739	普洛药业	400	6,156.00	0.01
448	002607	中公教育	1,500	6,120.00	0.01
449	600906	财达证券	800	6,000.00	0.01
450	600208	新湖中宝	2,700	5,859.00	0.01
451	002244	滨江集团	800	5,816.00	0.01
452	300357	我武生物	200	5,800.00	0.01
453	688349	三一重能	200	5,724.00	0.01

454	603658	安图生物	100	5,701.00	0.01
455	002281	光迅科技	200	5,700.00	0.01
456	600056	中国医药	500	5,585.00	0.01
457	688819	天能股份	200	5,584.00	0.01
458	002155	湖南黄金	500	5,570.00	0.01
459	300026	红日药业	1,300	5,512.00	0.01
460	300601	康泰生物	200	5,430.00	0.01
461	002192	融捷股份	100	5,421.00	0.01
462	688520	神州细胞	100	5,387.00	0.01
463	601866	中远海发	2,300	5,382.00	0.01
464	000155	川能动力	400	5,316.00	0.01
465	300487	蓝晓科技	100	5,306.00	0.01
466	601598	中国外运	1,000	5,240.00	0.01
467	002756	永兴材料	100	5,221.00	0.01
468	603858	步长制药	300	5,103.00	0.01
469	000883	湖北能源	1,200	5,076.00	0.01
470	300502	新易盛	100	4,932.00	0.01
471	002153	石基信息	480	4,675.20	0.01
472	300677	英科医疗	200	4,672.00	0.01
473	601118	海南橡胶	1,100	4,664.00	0.01
474	600129	太极集团	100	4,646.00	0.01
475	600022	山东钢铁	3,300	4,521.00	0.01
476	601156	东航物流	300	4,434.00	0.01
477	300114	中航电测	100	4,375.00	0.01
478	689009	九号公司	146	4,330.36	0.01
479	601778	晶科科技	1,100	3,850.00	0.00
480	600095	湘财股份	500	3,755.00	0.00
481	600968	海油发展	1,300	3,705.00	0.00
482	688107	安路科技	100	3,678.00	0.00
483	001914	招商积余	300	3,588.00	0.00
484	603379	三美股份	100	3,400.00	0.00
485	002761	浙江建投	300	3,078.00	0.00
486	002945	华林证券	200	3,020.00	0.00
487	601139	深圳燃气	300	2,067.00	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	603068	博通集成	3,500	102,025.00	0.12
2	002996	顺博合金	9,300	101,556.00	0.12
3	002249	大洋电机	18,300	90,951.00	0.11

4	600623	华谊集团	13,900	89,516.00	0.11
5	600195	中牧股份	7,500	88,950.00	0.11
6	000415	渤海租赁	41,400	88,596.00	0.11
7	300439	美康生物	6,900	80,109.00	0.10
8	601609	金田股份	11,800	79,886.00	0.10
9	688590	新致软件	3,500	79,170.00	0.10
10	002863	今飞凯达	12,600	78,246.00	0.09
11	688289	圣湘生物	4,000	78,200.00	0.09
12	300084	海默科技	10,200	77,928.00	0.09
13	002841	视源股份	1,700	77,792.00	0.09
14	000725	京东方 A	19,900	77,610.00	0.09
15	601628	中国人寿	2,700	76,545.00	0.09
16	000333	美的集团	1,400	76,482.00	0.09
17	002415	海康威视	2,200	76,384.00	0.09
18	601728	中国电信	14,100	76,281.00	0.09
19	603992	松霖科技	4,200	76,188.00	0.09
20	002498	汉缆股份	19,000	76,000.00	0.09
21	002027	分众传媒	12,000	75,840.00	0.09
22	601618	中国中冶	24,700	75,582.00	0.09
23	600061	国投资本	11,200	75,488.00	0.09
24	300482	万孚生物	2,500	75,425.00	0.09
25	601816	京沪高铁	15,200	74,784.00	0.09
26	603138	海量数据	4,200	74,760.00	0.09
27	601857	中国石油	10,500	74,130.00	0.09
28	600094	大名城	24,700	74,100.00	0.09
29	000338	潍柴动力	5,400	73,710.00	0.09
30	003816	中国广核	23,600	73,396.00	0.09
31	601988	中国银行	18,300	73,017.00	0.09
32	600900	长江电力	3,100	72,354.00	0.09
33	600025	华能水电	8,300	71,629.00	0.09
34	601985	中国核电	8,500	63,750.00	0.08
35	002493	荣盛石化	5,900	61,065.00	0.07
36	002666	德联集团	10,500	56,700.00	0.07
37	002452	长高电新	7,300	51,830.00	0.06
38	600480	凌云股份	5,500	50,105.00	0.06
39	601288	农业银行	13,700	49,868.00	0.06
40	002540	亚太科技	7,200	47,592.00	0.06
41	300224	正海磁材	3,800	44,536.00	0.05
42	002877	智能自控	4,200	43,974.00	0.05
43	300605	恒锋信息	2,900	43,413.00	0.05
44	000159	国际实业	6,600	42,834.00	0.05
45	002073	软控股份	6,500	42,705.00	0.05
46	300846	首都在线	2,900	41,441.00	0.05

47	002322	理工能科	3,200	40,960.00	0.05
48	688228	开普云	625	40,893.75	0.05
49	002803	吉宏股份	1,900	39,064.00	0.05
50	002909	集泰股份	5,100	38,913.00	0.05
51	301285	鸿日达	2,400	38,352.00	0.05
52	002392	北京利尔	10,100	38,178.00	0.05
53	300317	珈伟新能	7,500	38,175.00	0.05
54	000012	南玻 A	6,700	37,319.00	0.04
55	002170	芭田股份	6,700	37,185.00	0.04
56	000949	新乡化纤	11,500	37,145.00	0.04
57	603668	天马科技	2,000	36,680.00	0.04
58	300988	津荣天宇	1,700	36,176.00	0.04
59	603766	隆鑫通用	6,900	35,604.00	0.04
60	300305	裕兴股份	3,500	34,580.00	0.04
61	000597	东北制药	6,400	34,240.00	0.04
62	000782	美达股份	6,200	34,038.00	0.04
63	301456	盘古智能	1,100	33,880.00	0.04
64	300066	三川智慧	6,700	33,835.00	0.04
65	603717	天域生态	4,300	33,067.00	0.04
66	600169	太原重工	14,000	33,040.00	0.04
67	301283	聚胶股份	1,000	32,880.00	0.04
68	002360	同德化工	4,500	32,850.00	0.04
69	601918	新集能源	6,200	32,674.00	0.04
70	002130	沃尔核材	4,300	32,465.00	0.04
71	688368	晶丰明源	300	32,382.00	0.04
72	300243	瑞丰高材	3,300	32,241.00	0.04
73	600854	春兰股份	6,100	32,147.00	0.04
74	600590	泰豪科技	4,800	32,064.00	0.04
75	300996	普联软件	1,400	32,060.00	0.04
76	301057	汇隆新材	1,900	31,920.00	0.04
77	603818	曲美家居	5,900	31,860.00	0.04
78	301118	恒光股份	1,300	31,759.00	0.04
79	300566	激智科技	1,700	31,756.00	0.04
80	601163	三角轮胎	2,200	31,702.00	0.04
81	002283	天润工业	5,400	31,590.00	0.04
82	002475	立讯精密	900	31,005.00	0.04
83	300303	聚飞光电	5,200	30,836.00	0.04
84	000901	航天科技	3,300	30,756.00	0.04
85	603897	长城科技	1,500	30,720.00	0.04
86	300051	臻升科技	2,700	30,537.00	0.04
87	688391	钜泉科技	612	30,355.20	0.04
88	300629	新劲刚	1,400	30,282.00	0.04
89	300565	科信技术	2,000	30,240.00	0.04

90	300585	奥联电子	1,800	30,168.00	0.04
91	600693	东百集团	7,500	30,075.00	0.04
92	300972	万辰集团	800	30,032.00	0.04
93	301157	华塑科技	700	29,960.00	0.04
94	301045	天禄科技	1,100	29,920.00	0.04
95	603978	深圳新星	1,800	29,844.00	0.04
96	605399	晨光新材	2,200	29,832.00	0.04
97	301135	瑞德智能	1,200	29,784.00	0.04
98	300583	赛托生物	1,500	29,670.00	0.04
99	001217	华尔泰	2,100	29,652.00	0.04
100	002270	华明装备	2,100	29,652.00	0.04
101	300816	艾可蓝	1,200	29,604.00	0.04
102	603192	汇得科技	1,500	29,475.00	0.04
103	605155	西大门	1,900	29,412.00	0.04
104	000589	贵州轮胎	4,800	29,376.00	0.04
105	688317	之江生物	1,400	29,372.00	0.04
106	300932	三友联众	1,800	29,304.00	0.04
107	301388	欣灵电气	1,200	29,268.00	0.04
108	002461	珠江啤酒	3,700	29,230.00	0.04
109	300164	通源石油	6,100	29,097.00	0.04
110	300079	数码视讯	5,100	29,019.00	0.03
111	300949	奥雅股份	500	28,995.00	0.03
112	688613	奥精医疗	1,300	28,938.00	0.03
113	300501	海顺新材	2,000	28,860.00	0.03
114	301027	华蓝集团	2,300	28,773.00	0.03
115	688121	卓然股份	1,422	28,767.06	0.03
116	002731	萃华珠宝	2,600	28,756.00	0.03
117	603165	荣晟环保	2,400	28,752.00	0.03
118	300384	三联虹普	1,800	28,728.00	0.03
119	600897	厦门空港	2,300	28,727.00	0.03
120	300800	力合科技	2,100	28,707.00	0.03
121	002438	江苏神通	2,400	28,680.00	0.03
122	300499	高澜股份	2,000	28,680.00	0.03
123	301148	嘉戎技术	1,300	28,665.00	0.03
124	300839	博汇股份	2,800	28,644.00	0.03
125	301115	建科股份	1,600	28,640.00	0.03
126	300046	台基股份	1,800	28,638.00	0.03
127	688077	大地熊	1,200	28,620.00	0.03
128	002661	克明食品	3,000	28,590.00	0.03
129	000921	海信家电	1,400	28,560.00	0.03
130	603458	勘设股份	3,300	28,479.00	0.03
131	688026	洁特生物	1,651	28,463.24	0.03
132	300615	欣天科技	1,800	28,458.00	0.03

133	002950	奥美医疗	3,000	28,440.00	0.03
134	688330	宏力达	1,000	28,410.00	0.03
135	688519	南亚新材	1,100	28,336.00	0.03
136	300732	设研院	3,200	28,256.00	0.03
137	002394	联发股份	3,400	28,254.00	0.03
138	300610	晨化股份	2,500	28,175.00	0.03
139	002798	帝欧家居	4,300	28,165.00	0.03
140	600051	宁波联合	3,900	28,158.00	0.03
141	603577	汇金通	2,700	28,080.00	0.03
142	603567	珍宝岛	2,300	27,968.00	0.03
143	000990	诚志股份	3,400	27,914.00	0.03
144	600033	福建高速	9,000	27,900.00	0.03
145	300906	日月明	1,100	27,819.00	0.03
146	300877	金春股份	1,600	27,696.00	0.03
147	603976	正川股份	1,400	27,594.00	0.03
148	301290	东星医疗	1,000	27,590.00	0.03
149	688395	正弦电气	1,200	27,588.00	0.03
150	300471	厚普股份	2,000	27,580.00	0.03
151	688618	三旺通信	469	27,483.40	0.03
152	003038	鑫铂股份	800	27,480.00	0.03
153	600488	津药药业	5,600	27,440.00	0.03
154	300708	聚灿光电	2,400	27,072.00	0.03
155	002662	京威股份	7,700	27,027.00	0.03
156	603050	科林电气	1,500	26,925.00	0.03
157	688209	英集芯	1,500	26,790.00	0.03
158	688367	工大高科	1,500	26,760.00	0.03
159	300406	九强生物	1,400	26,740.00	0.03
160	000680	山推股份	5,400	26,676.00	0.03
161	300638	广和通	1,400	26,642.00	0.03
162	603755	日辰股份	1,000	26,580.00	0.03
163	002449	国星光电	2,800	26,516.00	0.03
164	688299	长阳科技	1,900	26,505.00	0.03
165	300695	兆丰股份	500	26,480.00	0.03
166	688681	科汇股份	1,713	26,465.85	0.03
167	300102	乾照光电	3,600	26,460.00	0.03
168	300328	宜安科技	3,800	26,448.00	0.03
169	688237	超卓航科	700	26,446.00	0.03
170	003028	振邦智能	600	26,436.00	0.03
171	603859	能科科技	700	26,411.00	0.03
172	002212	天融信	2,700	26,406.00	0.03
173	688370	丛麟科技	1,069	26,404.30	0.03
174	001367	海森药业	600	26,376.00	0.03
175	603618	杭电股份	4,100	26,240.00	0.03

176	002491	通鼎互联	5,000	26,200.00	0.03
177	300687	赛意信息	1,200	26,136.00	0.03
178	600577	精达股份	6,300	26,082.00	0.03
179	600888	新疆众和	3,600	26,064.00	0.03
180	300319	麦捷科技	2,700	26,028.00	0.03
181	300286	安科瑞	1,000	25,930.00	0.03
182	603739	蔚蓝生物	1,700	25,874.00	0.03
183	300129	泰胜风能	2,400	25,848.00	0.03
184	002919	名臣健康	1,000	25,640.00	0.03
185	600664	哈药股份	7,600	25,460.00	0.03
186	603928	兴业股份	1,900	25,403.00	0.03
187	300442	润泽科技	1,000	25,370.00	0.03
188	688109	品茗科技	900	25,353.00	0.03
189	603937	丽岛新材	2,000	25,340.00	0.03
190	301300	远翔新材	800	25,304.00	0.03
191	300636	同和药业	2,400	25,296.00	0.03
192	603055	台华新材	2,100	25,284.00	0.03
193	300683	海特生物	700	25,277.00	0.03
194	603045	福达合金	1,600	25,264.00	0.03
195	300219	鸿利智汇	3,000	25,260.00	0.03
196	300632	光莆股份	2,000	25,240.00	0.03
197	002134	天津普林	2,300	25,231.00	0.03
198	002911	佛燃能源	2,200	25,212.00	0.03
199	605058	澳弘电子	1,100	25,201.00	0.03
200	300321	同大股份	1,300	25,155.00	0.03
201	300543	朗科智能	2,300	25,116.00	0.03
202	301226	祥明智能	1,100	25,113.00	0.03
203	600059	古越龙山	2,700	25,110.00	0.03
204	301063	海锅股份	1,100	25,080.00	0.03
205	003026	中晶科技	700	25,060.00	0.03
206	688089	嘉必优	1,400	25,060.00	0.03
207	688217	睿昂基因	700	25,046.00	0.03
208	300876	蒙泰高新	1,000	25,020.00	0.03
209	603926	铁流股份	2,000	25,020.00	0.03
210	002474	榕基软件	3,800	25,004.00	0.03
211	605258	协和电子	900	24,993.00	0.03
212	688053	思科瑞	500	24,970.00	0.03
213	002732	燕塘乳业	1,300	24,960.00	0.03
214	300626	华瑞股份	2,300	24,955.00	0.03
215	002090	金智科技	2,500	24,950.00	0.03
216	002636	金安国纪	2,800	24,948.00	0.03
217	603699	纽威股份	1,800	24,948.00	0.03
218	300808	久量股份	1,600	24,928.00	0.03

219	001322	箭牌家居	2,100	24,906.00	0.03
220	301002	崧盛股份	1,200	24,888.00	0.03
221	301273	瑞晨环保	900	24,831.00	0.03
222	688350	富淼科技	1,500	24,795.00	0.03
223	301047	义翘神州	300	24,720.00	0.03
224	300214	日科化学	3,800	24,700.00	0.03
225	002114	罗平锌电	3,300	24,684.00	0.03
226	300120	经纬辉开	3,400	24,684.00	0.03
227	002860	星帅尔	1,900	24,605.00	0.03
228	301429	森泰股份	1,200	24,528.00	0.03
229	300831	派瑞股份	2,000	24,520.00	0.03
230	002743	富煌钢构	4,100	24,518.00	0.03
231	603500	祥和实业	2,000	24,500.00	0.03
232	002626	金达威	1,500	24,495.00	0.03
233	688655	迅捷兴	1,622	24,492.20	0.03
234	688607	康众医疗	1,200	24,456.00	0.03
235	688255	凯尔达	1,000	24,450.00	0.03
236	002488	金固股份	3,400	24,412.00	0.03
237	600691	阳煤化工	7,600	24,396.00	0.03
238	300218	安利股份	1,800	24,390.00	0.03
239	301237	和顺科技	800	24,376.00	0.03
240	603551	奥普家居	2,300	24,357.00	0.03
241	603949	雪龙集团	1,300	24,349.00	0.03
242	688080	映翰通	600	24,348.00	0.03
243	600727	鲁北化工	3,700	24,346.00	0.03
244	603585	苏利股份	1,700	24,327.00	0.03
245	601801	皖新传媒	3,500	24,325.00	0.03
246	300955	嘉亨家化	1,100	24,321.00	0.03
247	300710	万隆光电	1,000	24,320.00	0.03
248	300227	光韵达	3,100	24,304.00	0.03
249	000776	广发证券	1,700	24,293.00	0.03
250	002135	东南网架	4,200	24,276.00	0.03
251	002091	江苏国泰	3,100	24,273.00	0.03
252	300670	大烨智能	3,100	24,273.00	0.03
253	301161	唯万密封	1,200	24,264.00	0.03
254	300891	惠云钛业	2,500	24,250.00	0.03
255	002588	史丹利	3,800	24,244.00	0.03
256	688600	皖仪科技	1,200	24,240.00	0.03
257	002004	华邦健康	5,200	24,232.00	0.03
258	688597	煜邦电力	2,662	24,224.20	0.03
259	300275	梅安森	2,100	24,213.00	0.03
260	300986	志特新材	1,900	24,187.00	0.03
261	603166	福达股份	3,500	24,185.00	0.03

262	601318	中国平安	600	24,180.00	0.03
263	688075	安旭生物	600	24,168.00	0.03
264	002148	北纬科技	4,000	24,160.00	0.03
265	002462	嘉事堂	1,700	24,157.00	0.03
266	000612	焦作万方	4,200	24,150.00	0.03
267	600351	亚宝药业	3,500	24,150.00	0.03
268	603151	邦基科技	1,600	24,144.00	0.03
269	000686	东北证券	3,400	24,140.00	0.03
270	300611	美力科技	2,100	24,129.00	0.03
271	688151	华强科技	1,300	24,128.00	0.03
272	600379	宝光股份	2,400	24,120.00	0.03
273	603887	城地香江	3,000	24,120.00	0.03
274	300701	森霸传感	2,100	24,108.00	0.03
275	002063	远光软件	3,900	24,102.00	0.03
276	002910	庄园牧场	2,200	24,068.00	0.03
277	603810	丰山集团	1,800	24,066.00	0.03
278	000751	锌业股份	7,400	24,050.00	0.03
279	002879	长缆科技	1,500	24,030.00	0.03
280	688171	纬德信息	1,068	24,030.00	0.03
281	603936	博敏电子	2,300	24,012.00	0.03
282	002228	合兴包装	7,000	24,010.00	0.03
283	600184	光电股份	2,100	24,003.00	0.03
284	603093	南华期货	2,000	24,000.00	0.03
285	600552	凯盛科技	1,800	23,994.00	0.03
286	688163	赛伦生物	1,200	23,988.00	0.03
287	605366	宏柏新材	2,900	23,983.00	0.03
288	300092	科新机电	1,800	23,976.00	0.03
289	002296	辉煌科技	2,900	23,925.00	0.03
290	600475	华光环能	2,300	23,920.00	0.03
291	300922	天秦装备	1,400	23,898.00	0.03
292	603788	宁波高发	1,600	23,888.00	0.03
293	688455	科捷智能	1,879	23,882.09	0.03
294	603261	立航科技	700	23,877.00	0.03
295	603320	迪贝电气	1,500	23,865.00	0.03
296	605177	东亚药业	900	23,832.00	0.03
297	603790	雅运股份	1,700	23,817.00	0.03
298	688067	爱威科技	1,000	23,810.00	0.03
299	300021	大禹节水	5,000	23,800.00	0.03
300	300113	顺网科技	1,700	23,800.00	0.03
301	000790	华神科技	4,700	23,782.00	0.03
302	688485	九州一轨	1,700	23,766.00	0.03
303	003030	祖名股份	1,100	23,760.00	0.03
304	300513	恒实科技	2,000	23,760.00	0.03

305	003027	同兴环保	1,300	23,738.00	0.03
306	688230	芯导科技	567	23,723.28	0.03
307	601688	华泰证券	1,700	23,715.00	0.03
308	300348	长亮科技	2,300	23,713.00	0.03
309	603886	元祖股份	1,300	23,699.00	0.03
310	600479	千金药业	2,200	23,694.00	0.03
311	000429	粤高速 A	2,800	23,688.00	0.03
312	688287	观典防务	2,400	23,688.00	0.03
313	600137	浪莎股份	1,300	23,686.00	0.03
314	301379	天山电子	800	23,672.00	0.03
315	301139	元道通信	700	23,667.00	0.03
316	600774	汉商集团	2,400	23,664.00	0.03
317	600694	大商股份	1,400	23,646.00	0.03
318	002811	郑中设计	2,400	23,640.00	0.03
319	603182	嘉华股份	1,600	23,632.00	0.03
320	605398	新炬网络	800	23,632.00	0.03
321	601579	会稽山	2,200	23,628.00	0.03
322	002836	新宏泽	2,700	23,625.00	0.03
323	300355	蒙草生态	6,300	23,625.00	0.03
324	603680	今创集团	2,500	23,625.00	0.03
325	603823	百合花	2,400	23,616.00	0.03
326	600216	浙江医药	2,200	23,606.00	0.03
327	000008	神州高铁	10,000	23,600.00	0.03
328	000544	中原环保	3,400	23,596.00	0.03
329	300381	溢多利	3,200	23,584.00	0.03
330	603602	纵横通信	1,600	23,584.00	0.03
331	300424	航新科技	1,800	23,580.00	0.03
332	603331	百达精工	1,800	23,580.00	0.03
333	301265	华新环保	2,300	23,575.00	0.03
334	000631	顺发恒业	7,100	23,572.00	0.03
335	002688	金河生物	4,900	23,569.00	0.03
336	000761	本钢板材	6,600	23,562.00	0.03
337	600880	博瑞传播	4,700	23,547.00	0.03
338	301335	天元宠物	1,100	23,540.00	0.03
339	300947	德必集团	1,500	23,535.00	0.03
340	000561	烽火电子	2,800	23,520.00	0.03
341	301042	安联锐视	600	23,520.00	0.03
342	000819	岳阳兴长	1,300	23,504.00	0.03
343	688196	卓越新能	700	23,499.00	0.03
344	301123	奕东电子	1,000	23,460.00	0.03
345	688056	莱伯泰科	700	23,457.00	0.03
346	301126	达嘉维康	1,800	23,454.00	0.03
347	688060	云涌科技	500	23,445.00	0.03

348	002346	柘中股份	2,100	23,415.00	0.03
349	603020	爱普股份	2,800	23,408.00	0.03
350	605298	必得科技	1,500	23,385.00	0.03
351	301182	凯旺科技	1,000	23,380.00	0.03
352	603238	诺邦股份	1,700	23,375.00	0.03
353	688184	帕瓦股份	1,200	23,352.00	0.03
354	688479	友车科技	1,000	23,320.00	0.03
355	000590	启迪药业	2,600	23,296.00	0.03
356	301150	中一科技	700	23,282.00	0.03
357	603232	格尔软件	1,700	23,273.00	0.03
358	603385	惠达卫浴	2,900	23,229.00	0.03
359	600735	新华锦	3,600	23,220.00	0.03
360	002900	哈三联	1,700	23,205.00	0.03
361	002516	旷达科技	4,700	23,171.00	0.03
362	688227	品高股份	1,214	23,150.98	0.03
363	301220	亚香股份	700	23,135.00	0.03
364	301189	奥尼电子	800	23,128.00	0.03
365	603917	合力科技	1,300	23,088.00	0.03
366	600292	远达环保	3,800	23,066.00	0.03
367	003009	中天火箭	500	23,055.00	0.03
368	301166	优宁维	600	23,052.00	0.03
369	002133	广宇集团	6,600	23,034.00	0.03
370	603365	水星家纺	1,600	23,008.00	0.03
371	603579	荣泰健康	1,100	22,913.00	0.03
372	688365	光云科技	2,100	22,869.00	0.03
373	600252	中恒集团	9,100	22,841.00	0.03
374	688381	帝奥微	900	22,788.00	0.03
375	301178	天亿马	700	22,701.00	0.03
376	002221	东华能源	2,200	22,660.00	0.03
377	688138	清溢光电	1,000	22,620.00	0.03
378	002206	海利得	4,500	22,590.00	0.03
379	603197	保隆科技	400	22,560.00	0.03
380	000795	英洛华	3,600	22,428.00	0.03
381	002204	大连重工	4,900	22,393.00	0.03
382	000100	TCL 科技	5,200	22,360.00	0.03
383	688175	高凌信息	800	22,344.00	0.03
384	605369	拱东医疗	400	22,328.00	0.03
385	000157	中联重科	3,400	22,202.00	0.03
386	600578	京能电力	7,500	22,200.00	0.03
387	300870	欧陆通	500	22,135.00	0.03
388	002007	华兰生物	1,000	22,130.00	0.03
389	600458	时代新材	2,400	22,104.00	0.03
390	603323	苏农银行	5,300	22,048.00	0.03

391	002023	海特高新	2,400	21,840.00	0.03
392	000403	派林生物	800	21,792.00	0.03
393	301033	迈普医学	500	21,770.00	0.03
394	688676	金盘科技	600	21,498.00	0.03
395	300019	硅宝科技	1,300	21,463.00	0.03
396	002948	青岛银行	7,000	21,350.00	0.03
397	300323	华灿光电	2,900	21,228.00	0.03
398	301097	天益医疗	400	21,052.00	0.03
399	001330	博纳影业	2,900	20,880.00	0.03
400	000016	深康佳 A	5,000	20,850.00	0.03
401	301106	骏成科技	500	20,780.00	0.03
402	301162	国能日新	400	20,752.00	0.03
403	300679	电连技术	500	20,750.00	0.03
404	002011	盾安环境	1,500	20,625.00	0.02
405	000541	佛山照明	3,100	20,615.00	0.02
406	001965	招商公路	2,100	20,517.00	0.02
407	600966	博汇纸业	3,300	20,493.00	0.02
408	300700	岱勒新材	1,200	20,364.00	0.02
409	300536	农尚环境	900	20,340.00	0.02
410	000062	深圳华强	1,800	20,286.00	0.02
411	603377	东方时尚	4,800	20,208.00	0.02
412	002984	森麒麟	700	20,195.00	0.02
413	002675	东诚药业	1,100	20,163.00	0.02
414	301217	铜冠铜箔	1,700	20,162.00	0.02
415	000607	华媒控股	4,400	20,152.00	0.02
416	600851	海欣股份	2,900	19,923.00	0.02
417	002154	报喜鸟	3,500	19,880.00	0.02
418	300115	长盈精密	1,500	19,875.00	0.02
419	000628	高新发展	400	19,872.00	0.02
420	601965	中国汽研	900	19,854.00	0.02
421	300463	迈克生物	1,300	19,591.00	0.02
422	600845	宝信软件	400	19,520.00	0.02
423	001208	华菱线缆	2,100	19,509.00	0.02
424	300168	万达信息	2,300	19,504.00	0.02
425	000078	海王生物	6,200	19,468.00	0.02
426	002252	上海莱士	2,400	19,200.00	0.02
427	002842	翔鹭钨业	2,200	19,184.00	0.02
428	603979	金诚信	500	18,880.00	0.02
429	002623	亚玛顿	700	18,725.00	0.02
430	002480	新筑股份	3,700	18,722.00	0.02
431	300067	安诺其	6,000	18,660.00	0.02
432	600683	京投发展	3,900	18,642.00	0.02
433	000876	新希望	2,000	18,640.00	0.02

434	300918	南山智尚	1,800	18,594.00	0.02
435	002331	皖通科技	2,200	18,568.00	0.02
436	603815	交建股份	2,200	18,392.00	0.02
437	600684	珠江股份	5,300	18,391.00	0.02
438	300542	新晨科技	1,400	18,340.00	0.02
439	002213	大为股份	1,300	18,291.00	0.02
440	000863	三湘印象	4,600	18,170.00	0.02
441	300913	兆龙互连	600	18,018.00	0.02
442	300825	阿尔特	1,300	17,875.00	0.02
443	002443	金洲管道	2,600	17,810.00	0.02
444	600019	宝钢股份	3,000	17,790.00	0.02
445	605003	众望布艺	900	17,766.00	0.02
446	601898	中煤能源	1,800	17,442.00	0.02
447	688608	恒玄科技	100	15,427.00	0.02
448	688271	联影医疗	112	15,345.12	0.02
449	603848	好太太	900	13,932.00	0.02
450	002111	威海广泰	1,500	13,590.00	0.02
451	688256	寒武纪	100	13,496.00	0.02
452	688202	美迪西	196	13,402.48	0.02
453	603351	威尔药业	500	13,185.00	0.02
454	300535	达威股份	700	12,257.00	0.01
455	002231	奥维通信	1,800	11,754.00	0.01
456	300419	浩丰科技	1,800	10,620.00	0.01
457	688798	艾为电子	140	9,664.20	0.01
458	688508	芯朋微	173	8,513.33	0.01
459	603359	东珠生态	1,100	8,448.00	0.01
460	601888	中国中免	100	8,369.00	0.01
461	688161	威高骨科	200	8,290.00	0.01
462	002745	木林森	900	7,794.00	0.01
463	688305	科德数控	100	7,645.00	0.01
464	603071	物产环能	500	7,600.00	0.01
465	002190	成飞集成	400	7,588.00	0.01
466	002932	明德生物	300	6,891.00	0.01
467	002049	紫光国微	100	6,745.00	0.01
468	002083	孚日股份	1,300	6,552.00	0.01
469	002320	海峡股份	1,100	6,413.00	0.01
470	301446	福事特	200	6,294.00	0.01
471	688511	天微电子	200	6,294.00	0.01
472	300627	华测导航	200	6,204.00	0.01
473	301468	博盈特焊	200	6,098.00	0.01
474	301170	锡南科技	200	6,086.00	0.01
475	300617	安靠智电	200	6,072.00	0.01
476	688360	德马科技	300	6,021.00	0.01

477	001298	好上好	200	5,964.00	0.01
478	300875	捷强装备	200	5,838.00	0.01
479	301050	雷电微力	100	5,826.00	0.01
480	301138	华研精机	200	5,800.00	0.01
481	300802	矩子科技	300	5,736.00	0.01
482	301515	港通医疗	200	5,724.00	0.01
483	301197	工大科雅	300	5,637.00	0.01
484	002747	埃斯顿	300	5,577.00	0.01
485	600036	招商银行	200	5,564.00	0.01
486	300476	胜宏科技	300	5,535.00	0.01
487	688668	鼎通科技	100	5,532.00	0.01
488	688569	铁科轨道	200	5,522.00	0.01
489	300755	华致酒行	300	5,487.00	0.01
490	300473	德尔股份	300	5,484.00	0.01
491	300713	英可瑞	300	5,481.00	0.01
492	002846	英联股份	500	5,475.00	0.01
493	300645	正元智慧	300	5,457.00	0.01
494	301082	久盛电气	300	5,445.00	0.01
495	300745	欣锐科技	200	5,434.00	0.01
496	002396	星网锐捷	300	5,421.00	0.01
497	003001	中岩大地	300	5,421.00	0.01
498	301163	宏德股份	200	5,420.00	0.01
499	301305	朗坤环境	300	5,415.00	0.01
500	002829	星网宇达	200	5,408.00	0.01
501	003025	思进智能	400	5,404.00	0.01
502	301212	联盛化学	200	5,400.00	0.01
503	300564	筑博设计	400	5,384.00	0.01
504	002845	同兴达	300	5,325.00	0.01
505	300642	透景生命	300	5,295.00	0.01
506	688277	天智航	400	5,272.00	0.01
507	001202	炬申股份	300	5,271.00	0.01
508	300885	海昌新材	500	5,270.00	0.01
509	601133	柏诚股份	400	5,268.00	0.01
510	605255	天普股份	300	5,265.00	0.01
511	603319	湘油泵	300	5,262.00	0.01
512	300963	中洲特材	400	5,248.00	0.01
513	300481	濮阳惠成	300	5,235.00	0.01
514	001216	华瓷股份	400	5,220.00	0.01
515	300958	建工修复	300	5,217.00	0.01
516	300879	大叶股份	300	5,196.00	0.01
517	301246	宏源药业	200	5,196.00	0.01
518	300127	银河磁体	300	5,193.00	0.01
519	300970	华绿生物	300	5,178.00	0.01

520	301066	万事利	400	5,152.00	0.01
521	002116	中国海诚	500	5,145.00	0.01
522	300774	倍杰特	500	5,145.00	0.01
523	688351	微电生理	200	5,130.00	0.01
524	300518	新迅达	300	5,124.00	0.01
525	300881	盛德鑫泰	200	5,116.00	0.01
526	001207	联科科技	300	5,115.00	0.01
527	002380	科远智慧	300	5,109.00	0.01
528	300206	理邦仪器	500	5,105.00	0.01
529	002718	友邦吊顶	300	5,103.00	0.01
530	300052	中青宝	300	5,091.00	0.01
531	605287	德才股份	300	5,091.00	0.01
532	002201	正威新材	700	5,061.00	0.01
533	002677	浙江美大	500	5,055.00	0.01
534	300758	七彩化学	500	5,055.00	0.01
535	300484	蓝海华腾	400	5,052.00	0.01
536	301072	中捷精工	200	5,050.00	0.01
537	300787	海能实业	300	5,046.00	0.01
538	688186	广大特材	280	5,045.60	0.01
539	603801	志邦家居	300	5,031.00	0.01
540	300903	科翔股份	500	5,030.00	0.01
541	300437	清水源	400	5,028.00	0.01
542	300505	川金诺	300	5,025.00	0.01
543	300649	杭州园林	300	5,025.00	0.01
544	603017	中衡设计	500	5,005.00	0.01
545	002968	新大正	400	5,004.00	0.01
546	300233	金城医药	300	4,998.00	0.01
547	003041	真爱美家	300	4,995.00	0.01
548	000913	钱江摩托	400	4,988.00	0.01
549	002818	富森美	400	4,984.00	0.01
550	002873	新天药业	400	4,984.00	0.01
551	300239	东宝生物	800	4,984.00	0.01
552	002774	快意电梯	600	4,980.00	0.01
553	300971	博亚精工	200	4,980.00	0.01
554	301228	实朴检测	300	4,974.00	0.01
555	300349	金卡智能	400	4,968.00	0.01
556	300382	斯莱克	500	4,965.00	0.01
557	002617	露笑科技	800	4,960.00	0.01
558	301507	民生健康	300	4,950.00	0.01
559	301149	隆华新材	400	4,948.00	0.01
560	300095	华伍股份	600	4,938.00	0.01
561	300532	今天国际	300	4,926.00	0.01
562	600233	圆通速递	400	4,916.00	0.01

563	002286	保龄宝	600	4,872.00	0.01
564	300894	火星人	300	4,872.00	0.01
565	002585	双星新材	600	4,866.00	0.01
566	301310	鑫宏业	100	4,865.00	0.01
567	603112	华翔股份	400	4,860.00	0.01
568	605189	富春染织	300	4,860.00	0.01
569	301198	喜悦智行	400	4,856.00	0.01
570	603798	康普顿	500	4,835.00	0.01
571	002404	嘉欣丝绸	800	4,832.00	0.01
572	300306	远方信息	400	4,832.00	0.01
573	001338	永顺泰	400	4,824.00	0.01
574	002057	中钢天源	600	4,824.00	0.01
575	300414	中光防雷	500	4,815.00	0.01
576	300773	拉卡拉	300	4,812.00	0.01
577	300582	英飞特	400	4,804.00	0.01
578	002815	崇达技术	500	4,790.00	0.01
579	300867	圣元环保	300	4,785.00	0.01
580	000829	天音控股	500	4,770.00	0.01
581	300623	捷捷微电	300	4,761.00	0.01
582	002441	众业达	500	4,735.00	0.01
583	300887	谱尼测试	400	4,724.00	0.01
584	300472	新元科技	500	4,720.00	0.01
585	300561	汇金科技	400	4,720.00	0.01
586	300747	锐科激光	200	4,706.00	0.01
587	000001	平安银行	500	4,695.00	0.01
588	300942	易瑞生物	400	4,676.00	0.01
589	300320	海达股份	600	4,668.00	0.01
590	000928	中钢国际	800	4,664.00	0.01
591	300193	佳士科技	600	4,662.00	0.01
592	000576	甘化科工	500	4,650.00	0.01
593	002963	豪尔赛	300	4,650.00	0.01
594	605138	盛泰集团	600	4,650.00	0.01
595	603511	爱慕股份	300	4,644.00	0.01
596	001696	宗申动力	700	4,641.00	0.01
597	600381	青海春天	600	4,638.00	0.01
598	301120	新特电气	400	4,636.00	0.01
599	300749	顶固集创	500	4,635.00	0.01
600	301086	鸿富瀚	100	4,622.00	0.01
601	300299	富春股份	800	4,616.00	0.01
602	300515	三德科技	400	4,616.00	0.01
603	300575	中旗股份	600	4,584.00	0.01
604	300182	捷成股份	900	4,572.00	0.01
605	301065	本立科技	200	4,550.00	0.01

606	600969	郴电国际	700	4,550.00	0.01
607	301355	南王科技	300	4,545.00	0.01
608	300458	全志科技	200	4,538.00	0.01
609	301365	矩阵股份	300	4,536.00	0.01
610	002796	世嘉科技	400	4,524.00	0.01
611	000948	南天信息	300	4,521.00	0.01
612	002733	雄韬股份	300	4,512.00	0.01
613	002454	松芝股份	600	4,506.00	0.01
614	601838	成都银行	400	4,504.00	0.01
615	688389	普门科技	200	4,502.00	0.01
616	000969	安泰科技	500	4,495.00	0.01
617	300647	超频三	700	4,494.00	0.01
618	601222	林洋能源	700	4,473.00	0.01
619	002961	瑞达期货	300	4,470.00	0.01
620	300990	同飞股份	100	4,451.00	0.01
621	301233	盛帮股份	100	4,442.00	0.01
622	300907	康平科技	200	4,438.00	0.01
623	301036	双乐股份	200	4,434.00	0.01
624	300326	凯利泰	700	4,431.00	0.01
625	000011	深物业 A	500	4,430.00	0.01
626	301016	雷尔伟	200	4,412.00	0.01
627	001222	源飞宠物	300	4,410.00	0.01
628	300994	久祺股份	300	4,410.00	0.01
629	002016	世荣兆业	700	4,403.00	0.01
630	603613	国联股份	200	4,402.00	0.01
631	688231	隆达股份	200	4,402.00	0.01
632	300577	开润股份	300	4,401.00	0.01
633	000715	中兴商业	600	4,386.00	0.01
634	301439	泓淋电力	300	4,386.00	0.01
635	000026	飞亚达	400	4,384.00	0.01
636	600773	西藏城投	400	4,384.00	0.01
637	002478	常宝股份	800	4,360.00	0.01
638	603506	南都物业	400	4,348.00	0.01
639	300871	回盛生物	300	4,338.00	0.01
640	301500	飞南资源	200	4,334.00	0.01
641	002852	道道全	400	4,328.00	0.01
642	300948	冠中生态	300	4,323.00	0.01
643	300665	飞鹿股份	500	4,320.00	0.01
644	300435	中泰股份	300	4,314.00	0.01
645	000058	深赛格	600	4,302.00	0.01
646	002088	鲁阳节能	300	4,275.00	0.01
647	600171	上海贝岭	300	4,266.00	0.01
648	603968	醋化股份	300	4,263.00	0.01

649	003011	海象新材	200	4,246.00	0.01
650	300945	曼卡龙	300	4,239.00	0.01
651	605080	浙江自然	200	4,234.00	0.01
652	301160	翔楼新材	100	4,223.00	0.01
653	301048	金鹰重工	400	4,216.00	0.01
654	002949	华阳国际	300	4,191.00	0.01
655	301121	紫建电子	100	4,156.00	0.01
656	002960	青鸟消防	300	4,152.00	0.01
657	603486	科沃斯	100	4,144.00	0.00
658	300869	康泰医学	200	4,126.00	0.00
659	688088	虹软科技	100	4,104.00	0.00
660	002901	大博医疗	100	4,059.00	0.00
661	300489	光智科技	200	4,048.00	0.00
662	001258	立新能源	500	4,040.00	0.00
663	002352	顺丰控股	100	4,040.00	0.00
664	002142	宁波银行	200	4,022.00	0.00
665	300622	博士眼镜	200	3,966.00	0.00
666	603881	数据港	200	3,964.00	0.00
667	301303	真兰仪表	200	3,938.00	0.00
668	301219	腾远钴业	100	3,937.00	0.00
669	603137	恒尚节能	200	3,924.00	0.00
670	688625	呈和科技	100	3,922.00	0.00
671	300989	蕾奥规划	200	3,876.00	0.00
672	300689	澄天伟业	200	3,874.00	0.00
673	300681	英搏尔	200	3,854.00	0.00
674	002612	朗姿股份	200	3,846.00	0.00
675	603995	甬金股份	200	3,846.00	0.00
676	688179	阿拉丁	200	3,832.00	0.00
677	301288	清研环境	200	3,796.00	0.00
678	002555	三七互娱	200	3,762.00	0.00
679	688768	容知日新	100	3,681.00	0.00
680	001316	润贝航科	100	3,481.00	0.00
681	603013	亚普股份	200	3,456.00	0.00
682	301196	唯科科技	100	3,438.00	0.00
683	603609	禾丰股份	400	3,424.00	0.00
684	600285	羚锐制药	200	3,422.00	0.00
685	600363	联创光电	100	3,400.00	0.00
686	000923	河钢资源	200	3,360.00	0.00
687	300999	金龙鱼	100	3,338.00	0.00
688	301229	纽泰格	100	3,325.00	0.00
689	603163	圣晖集成	100	3,313.00	0.00
690	600717	天津港	800	3,288.00	0.00
691	600780	通宝能源	400	3,280.00	0.00

692	600009	上海机场	100	3,278.00	0.00
693	301043	绿岛风	100	3,273.00	0.00
694	000061	农产品	500	3,235.00	0.00
695	002237	恒邦股份	300	3,234.00	0.00
696	300671	富满微	100	3,233.00	0.00
697	301258	富士莱	100	3,228.00	0.00
698	300946	恒而达	100	3,227.00	0.00
699	301113	雅艺科技	100	3,227.00	0.00
700	603896	寿仙谷	100	3,224.00	0.00
701	301267	华夏眼科	100	3,209.00	0.00
702	002978	安宁股份	100	3,166.00	0.00
703	000848	承德露露	400	3,140.00	0.00
704	000818	航锦科技	100	3,138.00	0.00
705	601952	苏垦农发	300	3,072.00	0.00
706	600787	中储股份	600	3,060.00	0.00
707	603393	新天然气	100	3,057.00	0.00
708	002489	浙江永强	1,000	3,040.00	0.00
709	600531	豫光金铅	500	3,025.00	0.00
710	600720	中交设计	300	3,024.00	0.00
711	601211	国泰君安	200	2,976.00	0.00
712	002741	光华科技	200	2,974.00	0.00
713	600916	中国黄金	300	2,961.00	0.00
714	688303	大全能源	100	2,957.00	0.00
715	000517	荣安地产	1,200	2,940.00	0.00
716	002267	陕天然气	400	2,932.00	0.00
717	000088	盐田港	600	2,928.00	0.00
718	000028	国药一致	100	2,899.00	0.00
719	000915	华特达因	100	2,896.00	0.00
720	000735	罗牛山	500	2,885.00	0.00
721	600710	苏美达	400	2,836.00	0.00
722	002416	爱施德	300	2,787.00	0.00
723	600811	东方集团	1,400	2,786.00	0.00
724	301207	华兰疫苗	100	2,780.00	0.00
725	600874	创业环保	500	2,775.00	0.00
726	688216	气派科技	100	2,767.00	0.00
727	600507	方大特钢	600	2,766.00	0.00
728	300662	科锐国际	100	2,762.00	0.00
729	002646	天佑德酒	200	2,722.00	0.00
730	688238	和元生物	300	2,697.00	0.00
731	600057	厦门象屿	400	2,684.00	0.00
732	002216	三全食品	200	2,680.00	0.00
733	002041	登海种业	200	2,646.00	0.00
734	002737	葵花药业	100	2,598.00	0.00

735	600587	新华医疗	100	2,579.00	0.00
736	603299	苏盐井神	300	2,556.00	0.00
737	002242	九阳股份	200	2,542.00	0.00
738	601101	昊华能源	400	2,528.00	0.00
739	603983	丸美股份	100	2,527.00	0.00
740	600908	无锡银行	500	2,525.00	0.00
741	600740	山西焦化	500	2,520.00	0.00
742	300087	荃银高科	300	2,514.00	0.00
743	000543	皖能电力	400	2,504.00	0.00
744	002215	诺普信	300	2,478.00	0.00
745	600017	日照港	900	2,475.00	0.00
746	600395	盘江股份	400	2,468.00	0.00
747	600125	铁龙物流	400	2,420.00	0.00
748	600993	马应龙	100	2,418.00	0.00
749	000869	张裕 A	100	2,414.00	0.00
750	601069	西部黄金	200	2,412.00	0.00
751	600575	淮河能源	1,000	2,410.00	0.00
752	600662	外服控股	500	2,400.00	0.00
753	688011	新光光电	100	2,365.00	0.00
754	002727	一心堂	100	2,316.00	0.00
755	000019	深粮控股	300	2,262.00	0.00
756	000582	北部湾港	300	2,253.00	0.00
757	002287	奇正藏药	100	2,249.00	0.00
758	002171	楚江新材	300	2,244.00	0.00
759	600810	神马股份	300	2,232.00	0.00
760	300180	华峰超纤	500	2,210.00	0.00
761	600123	兰花科创	200	2,208.00	0.00
762	600012	皖通高速	200	2,204.00	0.00
763	002061	浙江交科	600	2,190.00	0.00
764	300702	天宇股份	100	2,171.00	0.00
765	603057	紫燕食品	100	2,158.00	0.00
766	600098	广州发展	400	2,148.00	0.00
767	605338	巴比食品	100	2,148.00	0.00
768	002545	东方铁塔	300	2,145.00	0.00
769	002928	华夏航空	300	2,142.00	0.00
770	300741	华宝股份	100	2,141.00	0.00
771	000860	顺鑫农业	100	2,129.00	0.00
772	000567	海德股份	200	2,126.00	0.00
773	002307	北新路桥	500	2,120.00	0.00
774	002746	仙坛股份	300	2,112.00	0.00
775	000767	晋控电力	700	2,107.00	0.00
776	300761	立华股份	100	2,097.00	0.00
777	600750	江中药业	100	2,088.00	0.00

778	601963	重庆银行	300	2,088.00	0.00
779	600422	昆药集团	100	2,086.00	0.00
780	002840	华统股份	100	2,079.00	0.00
781	000789	万年青	300	2,058.00	0.00
782	600361	创新新材	400	2,004.00	0.00
783	002537	海联金汇	300	1,998.00	0.00
784	000650	仁和药业	300	1,989.00	0.00
785	688069	德林海	100	1,988.00	0.00
786	002194	武汉凡谷	200	1,972.00	0.00
787	600648	外高桥	200	1,972.00	0.00
788	600420	国药现代	200	1,958.00	0.00
789	600007	中国国贸	100	1,938.00	0.00
790	600223	福瑞达	200	1,926.00	0.00
791	688556	高测股份	49	1,910.51	0.00
792	002217	合力泰	700	1,904.00	0.00
793	603368	柳药集团	100	1,892.00	0.00
794	600210	紫江企业	400	1,880.00	0.00
795	600267	海正药业	200	1,872.00	0.00
796	300639	凯普生物	200	1,868.00	0.00
797	600502	安徽建工	400	1,860.00	0.00
798	002773	康弘药业	100	1,844.00	0.00
799	600305	恒顺醋业	200	1,842.00	0.00
800	000048	京基智农	100	1,830.00	0.00
801	000552	甘肃能化	600	1,830.00	0.00
802	600618	氯碱化工	200	1,820.00	0.00
803	000426	兴业银锡	200	1,816.00	0.00
804	300783	三只松鼠	100	1,805.00	0.00
805	600449	宁夏建材	100	1,793.00	0.00
806	603103	横店影视	100	1,778.00	0.00
807	002807	江阴银行	500	1,775.00	0.00
808	601860	紫金银行	700	1,771.00	0.00
809	600323	瀚蓝环境	100	1,733.00	0.00
810	000925	众合科技	200	1,732.00	0.00
811	600055	万东医疗	100	1,708.00	0.00
812	603170	宝立食品	100	1,691.00	0.00
813	000791	甘肃能源	300	1,671.00	0.00
814	600483	福能股份	200	1,654.00	0.00
815	002539	云图控股	200	1,650.00	0.00
816	603565	中谷物流	200	1,646.00	0.00
817	300119	瑞普生物	100	1,639.00	0.00
818	601515	东峰集团	400	1,616.00	0.00
819	601212	白银有色	600	1,614.00	0.00
820	000030	富奥股份	300	1,602.00	0.00

821	000025	特力 A	100	1,591.00	0.00
822	603871	嘉友国际	100	1,586.00	0.00
823	688788	科思科技	41	1,585.88	0.00
824	603033	三维股份	100	1,581.00	0.00
825	601333	广深铁路	600	1,554.00	0.00
826	600037	歌华有线	200	1,546.00	0.00
827	600643	爱建集团	300	1,530.00	0.00
828	600997	开滦股份	200	1,526.00	0.00
829	002034	旺能环境	100	1,525.00	0.00
830	600496	精工钢构	500	1,525.00	0.00
831	688025	杰普特	16	1,480.80	0.00
832	600185	格力地产	200	1,446.00	0.00
833	600120	浙江东方	400	1,436.00	0.00
834	002233	塔牌集团	200	1,416.00	0.00
835	601011	宝泰隆	400	1,400.00	0.00
836	688559	海目星	39	1,392.30	0.00
837	600508	上海能源	100	1,386.00	0.00
838	601068	中铝国际	300	1,386.00	0.00
839	000951	中国重汽	100	1,336.00	0.00
840	301060	兰卫医学	100	1,329.00	0.00
841	000503	国新健康	100	1,318.00	0.00
842	601969	海南矿业	200	1,318.00	0.00
843	000813	德展健康	400	1,308.00	0.00
844	000718	苏宁环球	500	1,295.00	0.00
845	603300	华铁应急	200	1,280.00	0.00
846	600206	有研新材	100	1,239.00	0.00
847	601001	晋控煤业	100	1,233.00	0.00
848	600821	金开新能	200	1,224.00	0.00
849	002946	新乳业	100	1,148.00	0.00
850	000902	新洋丰	100	1,139.00	0.00
851	000603	盛达资源	100	1,105.00	0.00
852	600201	生物股份	100	1,077.00	0.00
853	688378	奥来德	17	804.78	0.00
854	688357	建龙微纳	11	568.59	0.00
855	688596	正帆科技	11	435.93	0.00
856	688100	威胜信息	8	231.36	0.00
857	688222	成都先导	15	224.85	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	300308	中际旭创	5,721,549.00	5.84
2	600528	中铁工业	4,662,864.05	4.76
3	600623	华谊集团	4,644,783.00	4.74
4	000060	中金岭南	4,390,214.97	4.48
5	688390	固德威电源	4,218,047.42	4.31
6	601717	郑煤机	4,186,746.00	4.28
7	002249	大洋电机	4,170,494.00	4.26
8	601000	唐山港	4,066,693.00	4.15
9	600901	江苏金租	4,053,745.80	4.14
10	600820	隧道股份	3,989,354.00	4.08
11	600582	天地科技	3,952,623.14	4.04
12	300115	长盈精密	3,876,440.00	3.96
13	000050	深天马 A	3,857,163.00	3.94
14	002273	水晶光电	3,852,037.00	3.93
15	000598	兴蓉环境	3,826,720.00	3.91
16	600060	海信视像	3,696,563.00	3.78
17	300017	网宿科技	3,638,084.69	3.72
18	688208	道通科技	3,636,183.46	3.71
19	002152	广电运通	3,623,353.00	3.70
20	600968	海油发展	3,603,638.00	3.68
21	600879	航天电子	3,589,379.00	3.67
22	603927	中科软	3,522,263.00	3.60
23	600707	彩虹股份	3,514,398.00	3.59
24	300866	安克创新	3,511,745.31	3.59
25	300568	星源材质	3,510,450.00	3.59
26	600867	通化东宝	3,504,262.00	3.58
27	603688	石英股份	3,496,317.80	3.57
28	600566	济川药业	3,489,211.00	3.56
29	601598	中国外运	3,479,293.00	3.55
30	002056	横店东磁	3,478,168.00	3.55
31	688006	浙江杭可科技	3,449,878.78	3.52
32	600259	广晟有色	3,403,284.00	3.48
33	688289	圣湘生物	3,386,375.14	3.46
34	002353	杰瑞股份	3,334,539.00	3.41
35	600598	北大荒	3,293,762.00	3.36
36	600970	中材国际	3,276,181.00	3.35
37	603225	新风鸣	3,258,378.23	3.33
38	002563	森马服饰	3,246,097.00	3.32
39	600597	光明乳业	3,242,152.20	3.31
40	601992	金隅集团	3,194,521.00	3.26
41	600489	中金黄金	3,189,852.00	3.26
42	688690	纳微科技	3,187,364.81	3.26
43	000878	云南铜业	3,176,288.43	3.24

44	600739	辽宁成大	3,169,865.00	3.24
45	000563	陕国投 A	3,164,870.00	3.23
46	000930	中粮科技	3,136,719.00	3.20
47	002690	美亚光电	3,122,200.00	3.19
48	000997	新大陆	3,103,162.00	3.17
49	600390	五矿资本	3,091,476.00	3.16
50	300604	长川科技	3,077,072.00	3.14
51	688063	派能科技	3,071,035.79	3.14
52	600862	中航高科	3,060,694.00	3.13
53	600066	宇通客车	3,058,079.00	3.12
54	600642	申能股份	3,056,773.00	3.12
55	603228	景旺电子	3,043,325.00	3.11
56	001914	招商积余	3,024,805.00	3.09
57	688188	上海柏楚电子科技	3,023,984.91	3.09
58	600131	国网信通	3,022,389.00	3.09
59	600704	物产中大	2,996,501.00	3.06
60	000937	冀中能源	2,983,121.00	3.05
61	601958	金铂股份	2,981,778.00	3.05
62	600271	航天信息	2,980,534.00	3.04
63	002081	金螳螂	2,970,529.00	3.03
64	600718	东软集团	2,967,222.00	3.03
65	600895	张江高科	2,963,980.00	3.03
66	600339	中油工程	2,955,713.00	3.02
67	600959	江苏有线	2,951,566.00	3.01
68	002745	木林森	2,951,349.00	3.01
69	601699	潞安环能	2,931,441.00	2.99
70	600170	上海建工	2,930,754.00	2.99
71	300418	昆仑万维	2,927,452.74	2.99
72	300296	利亚德	2,922,775.00	2.99
73	601168	西部矿业	2,912,893.00	2.98
74	603317	天味食品	2,911,342.80	2.97
75	600909	华安证券	2,903,031.00	2.97
76	601098	中南传媒	2,900,464.00	2.96
77	600563	法拉电子	2,899,879.00	2.96
78	002429	兆驰股份	2,899,155.00	2.96
79	600580	卧龙电驱	2,896,982.00	2.96
80	002625	光启技术	2,882,876.00	2.94
81	002683	广东宏大	2,866,391.00	2.93
82	601928	凤凰传媒	2,854,847.96	2.92
83	601608	中信重工	2,853,389.00	2.91
84	601231	环旭电子	2,841,132.00	2.90
85	000709	河钢股份	2,840,221.00	2.90

86	002019	亿帆医药	2,837,883.00	2.90
87	600507	方大特钢	2,821,142.84	2.88
88	600782	新钢股份	2,794,240.00	2.85
89	000967	盈峰环境	2,794,049.00	2.85
90	000778	新兴铸管	2,775,431.00	2.84
91	300009	安科生物	2,772,114.00	2.83
92	600839	四川长虹	2,763,818.00	2.82
93	000415	渤海租赁	2,759,651.00	2.82
94	600967	内蒙一机	2,750,055.00	2.81
95	000623	吉林敖东	2,745,921.00	2.80
96	601665	齐鲁银行	2,732,868.00	2.79
97	000932	华菱钢铁	2,714,391.00	2.77
98	300136	信维通信	2,712,136.92	2.77
99	300390	天华新能	2,698,757.23	2.76
100	600008	首创环保	2,694,589.00	2.75
101	002511	中顺洁柔	2,693,223.00	2.75
102	002985	北摩高科	2,679,981.00	2.74
103	688779	长远锂科	2,679,369.43	2.74
104	000039	中集集团	2,678,823.50	2.74
105	000513	丽珠集团	2,673,910.00	2.73
106	002939	长城证券	2,668,092.00	2.73
107	002025	航天电器	2,666,218.00	2.72
108	600737	中粮糖业	2,659,013.00	2.72
109	000988	华工科技	2,652,520.00	2.71
110	300682	朗新集团	2,652,395.00	2.71
111	603233	大参林	2,652,077.80	2.71
112	000728	国元证券	2,633,886.00	2.69
113	002925	盈趣科技	2,632,486.86	2.69
114	002368	太极股份	2,630,102.94	2.69
115	600398	海澜之家	2,629,774.00	2.69
116	688521	芯原微电子	2,619,073.94	2.68
117	002399	海普瑞	2,613,844.40	2.67
118	600126	杭钢股份	2,587,361.83	2.64
119	300482	万孚生物	2,586,055.00	2.64
120	300888	稳健医疗	2,572,033.20	2.63
121	600022	山东钢铁	2,570,325.00	2.63
122	603858	步长制药	2,568,940.59	2.62
123	600516	方大炭素	2,565,500.00	2.62
124	601016	节能风电	2,509,433.00	2.56
125	600315	上海家化	2,499,555.00	2.55
126	601568	北元集团	2,496,191.80	2.55
127	000402	金融街	2,492,968.00	2.55
128	600166	福田汽车	2,492,572.00	2.55

129	002409	雅克科技	2,491,153.00	2.54
130	002128	电投能源	2,487,110.00	2.54
131	601969	海南矿业	2,483,659.00	2.54
132	600906	财达证券	2,483,544.00	2.54
133	600377	宁沪高速	2,474,460.00	2.53
134	000683	远兴能源	2,456,287.00	2.51
135	603596	伯特利	2,453,744.00	2.51
136	601872	招商轮船	2,441,094.36	2.49
137	000636	风华高科	2,440,164.00	2.49
138	688088	虹软科技	2,439,145.82	2.49
139	600699	均胜电子	2,438,165.00	2.49
140	688256	寒武纪科技	2,433,764.15	2.49
141	000830	鲁西化工	2,431,850.00	2.48
142	000537	中绿电	2,431,397.00	2.48
143	000089	深圳机场	2,425,737.00	2.48
144	002223	鱼跃医疗	2,411,870.00	2.46
145	002926	华西证券	2,411,049.00	2.46
146	688029	南微医学科技	2,405,114.49	2.46
147	002407	多氟多	2,399,220.00	2.45
148	000021	深科技	2,392,753.00	2.44
149	603883	老百姓	2,391,026.00	2.44
150	000012	南玻A	2,388,867.43	2.44
151	600282	南钢股份	2,380,425.00	2.43
152	002444	巨星科技	2,369,833.00	2.42
153	300383	光环新网	2,368,992.00	2.42
154	000559	万向钱潮	2,353,568.40	2.40
155	603056	德邦股份	2,348,463.00	2.40
156	002595	豪迈科技	2,338,152.00	2.39
157	300073	当升科技	2,337,398.00	2.39
158	600511	国药股份	2,316,767.00	2.37
159	300699	光威复材	2,313,531.00	2.36
160	300257	开山股份	2,311,643.00	2.36
161	600517	国网英大	2,305,617.00	2.36
162	603456	九洲药业	2,300,871.00	2.35
163	601997	贵阳银行	2,290,165.00	2.34
164	300861	美畅股份	2,284,869.00	2.33
165	002434	万里扬	2,273,301.00	2.32
166	300618	寒锐钴业	2,268,858.00	2.32
167	600871	石化油服	2,261,939.00	2.31
168	300182	捷成股份	2,261,836.00	2.31
169	002507	涪陵榨菜	2,254,161.80	2.30
170	600755	厦门国贸	2,251,012.00	2.30
171	001872	招商港口	2,245,112.99	2.29

172	000629	钒钛股份	2,240,228.00	2.29
173	600535	天士力	2,219,134.00	2.27
174	002572	索菲亚	2,215,349.00	2.26
175	002739	万达电影	2,203,570.00	2.25
176	603737	三棵树	2,199,250.00	2.25
177	000400	许继电气	2,198,593.00	2.25
178	002850	科达利	2,194,655.00	2.24
179	600863	内蒙华电	2,194,029.00	2.24
180	002465	海格通信	2,190,724.00	2.24
181	300001	特锐德	2,185,836.00	2.23
182	000630	铜陵有色	2,169,885.00	2.22
183	000959	首钢股份	2,165,850.00	2.21
184	000739	普洛药业	2,159,493.97	2.21
185	688009	中国通号	2,156,569.06	2.20
186	002500	山西证券	2,151,523.00	2.20
187	600998	九州通	2,146,936.00	2.19
188	002867	周大生	2,141,100.00	2.19
189	002738	中矿资源	2,140,717.00	2.19
190	300026	红日药业	2,128,276.00	2.17
191	688116	天奈科技	2,123,913.78	2.17
192	600208	新潮中宝	2,117,662.00	2.16
193	600500	中化国际	2,110,182.00	2.16
194	603568	伟明环保	2,095,678.00	2.14
195	600873	梅花生物	2,088,805.00	2.13
196	002299	圣农发展	2,079,697.00	2.12
197	603160	汇顶科技	2,075,954.26	2.12
198	600409	三友化工	2,072,579.00	2.12
199	603866	桃李面包	2,065,057.40	2.11
200	002192	融捷股份	2,059,612.34	2.10
201	600062	华润双鹤	2,048,539.00	2.09
202	300088	长信科技	2,046,887.00	2.09
203	000970	中科三环	2,046,561.00	2.09
204	002531	天顺风能	2,044,408.00	2.09
205	600435	北方导航	2,043,267.00	2.09
206	002221	东华能源	2,032,271.00	2.08
207	002203	海亮股份	2,030,331.00	2.07
208	002497	雅化集团	2,028,099.00	2.07
209	600486	扬农化工	2,020,988.00	2.06
210	600985	淮北矿业	2,020,221.00	2.06
211	601866	中远海发	2,019,624.00	2.06
212	000547	航天发展	2,009,032.00	2.05
213	000156	华数传媒	2,005,603.00	2.05
214	600350	山东高速	2,005,355.00	2.05

215	601187	厦门银行	1,995,111.00	2.04
216	300677	英科医疗	1,993,178.00	2.04
217	300037	新宙邦	1,981,538.00	2.02
218	600171	上海贝岭	1,979,874.00	2.02
219	603826	坤彩科技	1,976,535.00	2.02
220	603719	良品铺子	1,974,725.00	2.02
221	002110	三钢闽光	1,970,194.00	2.01
222	600373	中文传媒	1,969,057.96	2.01
223	601577	长沙银行	1,968,600.99	2.01
224	601198	东兴证券	1,965,569.00	2.01
225	600160	巨化股份	1,964,603.00	2.01

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	300308	中际旭创	6,654,604.00	6.80
2	600623	华谊集团	4,740,328.00	4.84
3	688390	固德威电源	4,733,460.44	4.84
4	600528	中铁工业	4,694,779.90	4.80
5	600820	隧道股份	4,264,931.74	4.36
6	600060	海信视像	4,226,208.00	4.32
7	600879	航天电子	4,134,066.00	4.22
8	002249	大洋电机	4,128,048.00	4.22
9	000060	中金岭南	4,056,916.50	4.14
10	688063	派能科技	4,009,294.63	4.10
11	601000	唐山港	3,994,364.00	4.08
12	600901	江苏金租	3,973,904.00	4.06
13	300115	长盈精密	3,953,692.80	4.04
14	300017	网宿科技	3,894,604.57	3.98
15	601598	中国外运	3,893,649.18	3.98
16	002273	水晶光电	3,853,474.00	3.94
17	300568	星源材质	3,823,677.00	3.91
18	300866	安克创新	3,749,831.65	3.83
19	600566	济川药业	3,749,539.10	3.83
20	603688	石英股份	3,702,797.00	3.78
21	601717	郑煤机	3,694,904.00	3.77
22	002353	杰瑞股份	3,634,506.00	3.71
23	600968	海油发展	3,613,036.00	3.69
24	000563	陕国投 A	3,503,264.00	3.58
25	002081	金螳螂	3,481,742.00	3.56
26	002625	光启技术	3,462,257.00	3.54
27	600867	通化东宝	3,423,845.54	3.50

28	603927	中科软	3,421,524.40	3.50
29	000878	云南铜业	3,419,664.00	3.49
30	002056	横店东磁	3,394,018.00	3.47
31	300604	长川科技	3,391,088.90	3.46
32	600259	广晟有色	3,384,556.00	3.46
33	600582	天地科技	3,359,749.00	3.43
34	603317	天味食品	3,353,686.00	3.43
35	600489	中金黄金	3,325,217.49	3.40
36	688208	道通科技	3,307,321.61	3.38
37	601699	潞安环能	3,301,820.35	3.37
38	002152	广电运通	3,294,747.00	3.37
39	000050	深天马 A	3,277,186.00	3.35
40	603228	景旺电子	3,255,522.00	3.33
41	000598	兴蓉环境	3,237,117.00	3.31
42	002690	美亚光电	3,232,979.00	3.30
43	688289	圣湘生物	3,228,223.54	3.30
44	600970	中材国际	3,190,448.37	3.26
45	601098	中南传媒	3,189,743.99	3.26
46	600895	张江高科	3,188,917.00	3.26
47	688690	纳微科技	3,159,030.04	3.23
48	600597	光明乳业	3,155,055.00	3.22
49	600598	北大荒	3,151,624.00	3.22
50	002407	多氟多	3,126,155.74	3.19
51	603233	大参林	3,119,190.48	3.19
52	603225	新凤鸣	3,115,078.00	3.18
53	688006	浙江杭可科技	3,112,213.70	3.18
54	601231	环旭电子	3,110,878.00	3.18
55	600707	彩虹股份	3,094,837.00	3.16
56	002563	森马服饰	3,059,559.00	3.13
57	001914	招商积余	3,055,740.74	3.12
58	600699	均胜电子	3,039,651.46	3.10
59	000728	国元证券	3,018,499.47	3.08
60	600563	法拉电子	3,013,151.00	3.08
61	002409	雅克科技	3,000,910.00	3.07
62	600718	东软集团	2,996,741.00	3.06
63	000997	新大陆	2,984,358.00	3.05
64	000988	华工科技	2,980,040.00	3.04
65	300418	昆仑万维	2,969,226.00	3.03
66	300390	天华新能	2,965,527.00	3.03
67	601992	金隅集团	2,963,296.00	3.03
68	002745	木林森	2,957,110.00	3.02
69	600959	江苏有线	2,956,895.00	3.02
70	600782	新钢股份	2,936,228.00	3.00

71	600642	申能股份	2,927,124.43	2.99
72	600704	物产中大	2,923,546.00	2.99
73	600271	航天信息	2,912,823.42	2.98
74	600339	中油工程	2,902,287.00	2.96
75	000930	中粮科技	2,892,644.00	2.95
76	600390	五矿资本	2,877,982.00	2.94
77	600967	内蒙一机	2,871,122.00	2.93
78	688188	上海柏楚电子科技	2,863,469.78	2.92
79	601928	凤凰传媒	2,861,141.00	2.92
80	601608	中信重工	2,857,644.00	2.92
81	600909	华安证券	2,851,560.40	2.91
82	600862	中航高科	2,809,462.00	2.87
83	600739	辽宁成大	2,807,608.00	2.87
84	000012	南玻A	2,789,299.26	2.85
85	600166	福田汽车	2,788,444.00	2.85
86	600131	国网信通	2,782,741.00	2.84
87	600507	方大特钢	2,777,965.00	2.84
88	300699	光威复材	2,775,831.00	2.84
89	600170	上海建工	2,770,042.00	2.83
90	000415	渤海租赁	2,769,222.00	2.83
91	300009	安科生物	2,768,675.00	2.83
92	601168	西部矿业	2,768,370.00	2.83
93	300182	捷成股份	2,765,033.00	2.82
94	601958	金铂股份	2,756,199.00	2.82
95	000937	冀中能源	2,749,605.00	2.81
96	000537	中绿电	2,741,171.00	2.80
97	600839	四川长虹	2,738,946.00	2.80
98	600008	首创环保	2,737,196.00	2.80
99	600580	卧龙电驱	2,735,295.41	2.79
100	601665	齐鲁银行	2,729,339.00	2.79
101	603056	德邦股份	2,724,758.00	2.78
102	000709	河钢股份	2,715,127.00	2.77
103	002738	中矿资源	2,698,944.20	2.76
104	000778	新兴铸管	2,697,618.00	2.76
105	600066	宇通客车	2,681,942.00	2.74
106	000932	华菱钢铁	2,673,345.00	2.73
107	002368	太极股份	2,666,886.00	2.72
108	603737	三棵树	2,666,364.20	2.72
109	000629	钒钛股份	2,655,611.00	2.71
110	688521	芯原微电子	2,651,518.72	2.71
111	002572	索菲亚	2,650,353.00	2.71
112	300073	当升科技	2,650,110.00	2.71

113	688088	虹软科技	2,642,453.84	2.70
114	600160	巨化股份	2,634,346.00	2.69
115	603596	伯特利	2,614,210.00	2.67
116	002985	北摩高科	2,613,728.41	2.67
117	002683	广东宏大	2,608,340.00	2.66
118	000967	盈峰环境	2,582,214.00	2.64
119	600126	杭钢股份	2,561,385.00	2.62
120	600516	方大炭素	2,558,182.00	2.61
121	600315	上海家化	2,554,854.00	2.61
122	600906	财达证券	2,528,866.92	2.58
123	600022	山东钢铁	2,513,884.00	2.57
124	688779	长远锂科	2,506,275.00	2.56
125	300482	万孚生物	2,503,460.00	2.56
126	603858	步长制药	2,495,553.00	2.55
127	002429	兆驰股份	2,490,912.00	2.54
128	300888	稳健医疗	2,466,055.00	2.52
129	601016	节能风电	2,464,365.00	2.52
130	000021	深科技	2,464,096.46	2.52
131	600398	海澜之家	2,462,036.00	2.51
132	002399	海普瑞	2,461,651.00	2.51
133	600377	宁沪高速	2,460,117.00	2.51
134	300296	利亚德	2,451,975.35	2.50
135	002019	亿帆医药	2,447,775.32	2.50
136	000729	燕京啤酒	2,446,286.31	2.50
137	300682	朗新集团	2,434,636.00	2.49
138	600373	中文传媒	2,433,217.84	2.49
139	300383	光环新网	2,426,606.00	2.48
140	002511	中顺洁柔	2,421,063.07	2.47
141	000970	中科三环	2,396,046.50	2.45
142	601872	招商轮船	2,391,324.00	2.44
143	600873	梅花生物	2,386,271.00	2.44
144	002128	电投能源	2,383,800.00	2.43
145	000623	吉林敖东	2,381,554.90	2.43
146	000039	中集集团	2,372,460.16	2.42
147	300373	扬杰科技	2,367,908.00	2.42
148	002444	巨星科技	2,362,382.85	2.41
149	600486	扬农化工	2,360,657.00	2.41
150	600499	科达制造	2,355,420.00	2.41
151	000683	远兴能源	2,354,926.00	2.41
152	600737	中粮糖业	2,353,831.62	2.40
153	002025	航天电器	2,353,751.00	2.40
154	688029	南微医学科技	2,348,725.35	2.40
155	000402	金融街	2,346,579.00	2.40

156	001872	招商港口	2,346,476.00	2.40
157	300618	寒锐钴业	2,344,321.52	2.39
158	688256	寒武纪科技	2,343,770.38	2.39
159	000830	鲁西化工	2,336,446.00	2.39
160	300136	信维通信	2,327,455.00	2.38
161	601969	海南矿业	2,321,776.00	2.37
162	300861	美畅股份	2,321,532.00	2.37
163	603883	老百姓	2,312,486.00	2.36
164	600511	国药股份	2,277,224.00	2.33
165	300257	开山股份	2,270,643.00	2.32
166	002507	涪陵榨菜	2,267,601.40	2.32
167	601568	北元集团	2,254,521.60	2.30
168	688009	中国通号	2,253,595.12	2.30
169	002434	万里扬	2,252,194.00	2.30
170	002192	融捷股份	2,246,850.00	2.30
171	000089	深圳机场	2,241,610.00	2.29
172	002468	申通快递	2,216,322.00	2.26
173	300363	博腾股份	2,205,428.00	2.25
174	600728	佳都科技	2,201,808.96	2.25
175	601298	青岛港	2,197,575.00	2.24
176	002595	豪迈科技	2,194,602.00	2.24
177	002926	华西证券	2,191,105.00	2.24
178	002939	长城证券	2,188,344.00	2.24
179	002465	海格通信	2,188,236.00	2.24
180	603127	昭衍新药	2,186,079.00	2.23
181	688301	奕瑞科技股份	2,182,334.13	2.23
182	000999	华润三九	2,180,477.00	2.23
183	601128	常熟银行	2,175,772.00	2.22
184	002500	山西证券	2,171,058.00	2.22
185	000636	风华高科	2,164,138.00	2.21
186	603456	九洲药业	2,160,867.00	2.21
187	002221	东华能源	2,160,596.84	2.21
188	002244	滨江集团	2,158,188.76	2.20
189	002223	鱼跃医疗	2,154,067.00	2.20
190	600282	南钢股份	2,153,464.00	2.20
191	601997	贵阳银行	2,153,101.00	2.20
192	002705	新宝股份	2,151,111.95	2.20
193	002110	三钢闽光	2,139,560.00	2.19
194	603345	安井食品	2,137,577.68	2.18
195	600517	国网英大	2,125,386.00	2.17
196	603605	珀莱雅	2,124,088.20	2.17
197	600409	三友化工	2,122,039.65	2.17
198	600415	小商品城	2,121,344.00	2.17

199	600435	北方导航	2,119,529.00	2.17
200	601866	中远海发	2,113,977.00	2.16
201	000739	普洛药业	2,104,837.00	2.15
202	600755	厦门国贸	2,100,940.00	2.15
203	601187	厦门银行	2,095,581.00	2.14
204	601577	长沙银行	2,092,788.10	2.14
205	300026	红日药业	2,091,001.00	2.14
206	000513	丽珠集团	2,090,010.06	2.13
207	603719	良品铺子	2,089,323.00	2.13
208	600667	太极实业	2,081,419.40	2.13
209	000630	铜陵有色	2,075,784.00	2.12
210	000400	许继电气	2,074,780.30	2.12
211	600871	石化油服	2,064,091.00	2.11
212	002850	科达利	2,063,526.00	2.11
213	688116	天奈科技	2,063,224.46	2.11
214	000559	万向钱潮	2,060,307.00	2.10
215	002867	周大生	2,056,088.00	2.10
216	002497	雅化集团	2,056,082.00	2.10
217	600171	上海贝岭	2,056,071.00	2.10
218	600500	中化国际	2,053,484.00	2.10
219	600208	新潮中宝	2,047,828.00	2.09
220	688385	复旦微电	2,044,898.77	2.09
221	600535	天士力	2,032,380.68	2.08
222	002430	杭氧股份	2,029,520.00	2.07
223	600985	淮北矿业	2,028,440.00	2.07
224	605358	立昂微	2,021,963.00	2.07
225	601198	东兴证券	2,019,516.00	2.06
226	600549	厦门钨业	2,018,443.00	2.06
227	002299	圣农发展	2,015,891.51	2.06
228	600062	华润双鹤	2,011,204.00	2.05
229	300677	英科医疗	2,004,694.00	2.05
230	603156	养元饮品	2,003,312.00	2.05
231	600064	南京高科	2,000,838.40	2.04
232	600863	内蒙华电	1,993,045.00	2.04
233	002739	万达电影	1,991,908.00	2.03
234	600928	西安银行	1,989,872.00	2.03
235	300001	特锐德	1,989,542.00	2.03
236	000156	华数传媒	1,984,646.00	2.03
237	600032	浙江新能	1,963,388.68	2.01
238	002966	苏州银行	1,959,226.99	2.00

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	1,308,030,965.04
卖出股票收入（成交）总额	1,311,159,454.24

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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投资。

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投资。

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	290,276.55
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	58,058.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	348,335.33

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：本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

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未存在流通受限的情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告中因四舍五入原因，投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 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	持有份额	占总份额比

				例		例
兴银中证 500 指数增强 A	1,668	20,315.45	2,649,624.28	7.82%	31,236,541.55	92.18%
兴银中证 500 指数增强 C	15,822	4,013.05	0.00	0.00%	63,494,446.46	100%
合计	17,490	5,567.79	2,649,624.28	2.72%	94,730,988.01	97.28%

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人员持有本基金	兴银中证 500 指数增强 A	35,039.46	0.103403%
	兴银中证 500 指数增强 C	44,960.49	0.070810%
	合计	79,999.95	0.082152%

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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	兴银中证 500 指数增强 A	-
	兴银中证 500 指数增强 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	兴银中证 500 指数增强 A	0~10
	兴银中证 500 指数增强 C	-
	合计	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	兴银中证 500 指数增强 A	兴银中证 500 指数增强 C
基金合同生效日（2021 年 03 月 01 日）基金份额总额	120,603,411.79	143,434,150.49
本报告期期初基金份额总额	34,892,385.20	72,783,095.56
本报告期基金总申购份额	7,113,883.70	20,068,623.17

减：本报告期基金总赎回份额	8,120,103.07	29,357,272.27
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	33,886,165.83	63,494,446.46

§ 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 2023 年 3 月 1 日公告，郑瑞健先生担任公司督察长，总经理赵建兴先生不再代为履行督察长职务。

(2) 基金管理人于 2023 年 5 月 27 日公告，吴若曼女士担任公司董事长、法定代表人，张贵云先生不再担任公司董事长、法定代表人。

(3) 基金管理人于 2023 年 8 月 12 日公告，文杰先生担任公司副总经理。

(4) 基金托管人于 2023 年 5 月 17 日发布公告，自 2023 年 5 月 10 日起丁文忠先生不再担任基金托管部门总经理；自 2023 年 5 月 10 日起聘任赵刚先生为基金托管部门总经理。

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（2021 年 3 月 1 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 36,500.00 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

注：报告期内，基金管理人及其相关高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
东方财富证券	2	687,304,943.90	26.24%	129,743.13	23.41%	-
民生证券	2	615,998,937.27	23.52%	142,482.98	25.70%	-
招商证券	2	565,674,888.64	21.60%	107,875.00	19.46%	-
广发证券	2	421,819,785.49	16.10%	98,283.66	17.73%	-
华福证券	2	328,385,458.74	12.54%	75,953.89	13.70%	-
渤海证券	2	-	-	-	-	-

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。

11.8 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	公司旗下部分产品在众惠基金、泰信财富、博时财富上线同时开通转换、定投、参与费率优惠活动并公告	中国证券报、证券时报、证券日报、上海证券报、指定网站	2023-01-12
2	兴银中证 500 指数增强型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	指定网站	2023-01-20
3	兴银基金管理有限责任公司旗下部分基金 2022 年第 4 季度	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报	2023-01-20

	报告提示性公告		
4	兴银中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、指定网站	2023-02-24
5	兴银中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）（2023 年第 1 号）、兴银中证 500 指数增强型证券投资基金（兴银中证 500 指数增强 A 份额）基金产品资料概要（更新）、兴银中证 500 指数增强型证券投资基金（兴银中证 500 指数增强 C 份额）基金产品资料概要（更新）	指定网站、中数平台	2023-02-28
6	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、指定网站	2023-03-01
7	兴银基金管理有限责任公司旗下部分基金 2022 年年度报告提示性公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报	2023-03-30
8	兴银中证 500 指数增强型证券投资基金 2022 年年度报告	指定网站	2023-03-30
9	关于旗下基金参与江海证券费率优惠活动并开通定期定额投资的公告	中国证券报、证券时报、证券日报、上海证券报、指定网站	2023-04-17
10	兴银基金管理有限责任公司旗下基金 2023 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	2023-04-22
11	兴银中证 500 指数增强型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	指定网站	2023-04-22
12	关于旗下部分基金在华西证券开通定期定额投资的公告	中国证券报、证券时报、证券日报、上海证券报、指定网站	2023-05-27
13	兴银基金管理有限责任公司关于董事长变更的公告	中国证券报、证券时报、证券日报、上海证券报、指定网站	2023-05-27
14	关于旗下部分基金在华福证券开通基金转换业务的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、指定网站	2023-06-21
15	兴银基金管理有限责任公司旗下基金 2023 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	2023-07-20
16	兴银中证 500 指数增强型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	指定网站	2023-07-20
17	关于旗下部分基金在兴业银行开通基金转换业务的公告	中国证券报、证券时报、证券日报、上海证券报、指定网站	2023-07-27
18	兴银基金管理有限责任公司关	证券时报、指定网站	2023-08-05

	于中证 500 持有的“蓝盾退”股票调整估值方法的公告		
19	兴银基金管理有限责任公司关于高级管理人变更的公告	中国证券报、证券时报、证券日报、上海证券报、指定网站	2023-08-12
20	兴银基金管理有限责任公司关于公司自有资金及高级管理人员、基金经理投资公司旗下权益类公募基金的公告	中国证券报、证券时报、证券日报、上海证券报、指定网站	2023-08-24
21	兴银基金管理有限责任公司旗下部分基金 2023 年中期报告提示性公告	中国证券报、证券时报、证券日报、上海证券报	2023-08-30
22	兴银中证 500 指数增强型证券投资基金 2023 年中期报告	指定网站	2023-08-30
23	兴银中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）（2023 年第 2 号）、兴银中证 500 指数增强型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要（更新）、兴银中证 500 指数增强型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要（更新）	指定网站、中数平台	2023-09-15
24	兴银基金管理有限责任公司旗下基金 2023 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	2023-10-25
25	兴银中证 500 指数增强型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	指定网站	2023-10-25
26	关于旗下部分基金在蚂蚁基金开通基金转换业务的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、指定网站	2023-11-30
27	关于旗下基金参与中欧财富费率优惠活动并开通定期定额投资的公告	中国证券报、证券时报、证券日报、上海证券报、指定网站	2023-12-22

§ 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. 中国证监会准予兴银中证 500 指数增强型证券投资基金变更注册的文件
2. 《兴银中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》
3. 《兴银中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》
4. 《兴银中证 500 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. 报告期内在指定信息披露媒体上公开披露的各项公告

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

二〇二四年三月二十八日