

兴银鼎新灵活配置混合型证券投资基金 2020 年年度报告

2020 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：兴业银行股份有限公司

送出日期：2021 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

本报告期自 2020 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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
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	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	23
§8 投资组合报告	49
8.1 期末基金资产组合情况	49
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	49
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	91

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	91
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	91
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	91
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	91
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	91
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.....	94
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	94
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的情况	94
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	94
§10 开放式基金份额变动.....	95
§11 重大事件揭示.....	96
11.1 基金份额持有人大会决议	96
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	96
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	96
11.4 基金投资策略的改变	96
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	96
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	96
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	98
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	101
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	101
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	101
§13 备查文件目录.....	102
13.1 备查文件目录	102
13.2 存放地点	102
13.3 查阅方式	102

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴银鼎新灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	兴银鼎新灵活配置
场内简称	—
基金主代码	001339
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 25 日
基金管理人	兴银基金管理有限责任公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	32,791,116.41 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	—
上市日期	—

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金是混合型基金，根据宏观经济发展趋势、政策面因素、金融市场的利率变动和市场情绪，综合运用定性和定量的方法，对股票、债券和现金类资产的预期收益风险及相对投资价值进行评估，确定基金资产在股票、债券及现金类资产等资产类别的分配比例。在有效控制投资风险的前提下，形成大类资产的配置方案。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金，通常预期风险与预期收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	余富材	龚小武
	联系电话	021-20296222	021-52629999-212056
	电子邮箱	yfc@hffunds.cn	gongxiaowu@cib.com.cn
客户服务电话		40000-96326	95561
传真		021-68630069	021-62159217

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	福州市湖东路 154 号
办公地址	上海市浦东新区陆家嘴环路 1088 号上海招商银行大厦 16 楼	上海市银城路 167 号兴业大厦 4 楼
邮政编码	200120	200120
法定代表人	张贵云	陶以平（代为履行法定代表人职权）

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	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼
注册登记机构	兴银基金管理有限责任公司	上海市浦东新区陆家嘴环路 1088 号招商银行上海大厦 16 楼

§ 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	2020 年	2019 年	2018 年
本期已实现收益	10,198,787.94	594,378.28	-31,662,881.97
本期利润	13,196,550.32	1,566,041.14	-43,006,249.74
加权平均基金份额本期利润	0.5835	0.0382	-0.2321
本期加权平均净值利润率	43.45%	4.52%	-24.16%
本期基金份额净值增长率	60.88%	22.20%	-22.05%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	16,470,947.09	-268,561.18	-38,441,280.30
期末可供分配基金份额利润	0.5023	-0.0194	-0.2077
期末基金资产净值	52,854,217.85	13,884,959.95	151,747,594.53
期末基金份额净值	1.612	1.002	0.820
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率	69.90%	5.61%	-13.57%

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

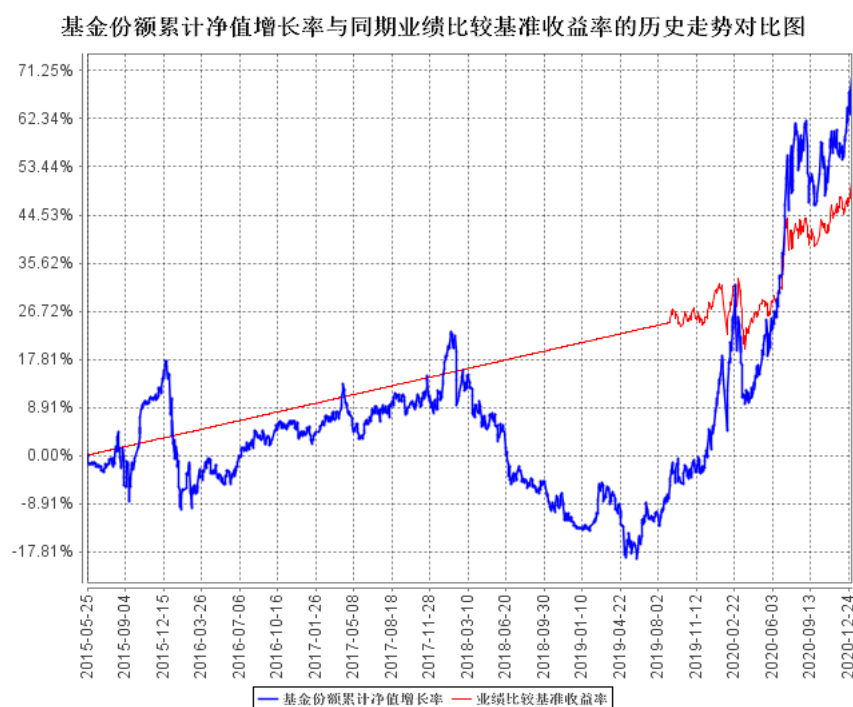
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	14.98%	1.36%	8.30%	0.59%	6.68%	0.77%
过去六个月	24.29%	1.55%	14.35%	0.80%	9.94%	0.75%
过去一年	60.88%	1.72%	16.24%	0.85%	44.64%	0.87%
过去三年	53.23%	1.30%	31.01%	0.51%	22.22%	0.79%
过去五年	48.16%	1.18%	45.59%	0.39%	2.57%	0.79%

自基金合同 生效起至今	69.90%	1.17%	50.66%	0.37%	19.24%	0.80%
----------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

注：1、本基金成立于 2015 年 5 月 25 日。

2、业绩比较基准为：①自基金成立之日起至 2019 年 9 月 3 日：五年银行定期存款利率（税后）+1%；②自 2019 年 9 月 4 日起：沪深 300 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%

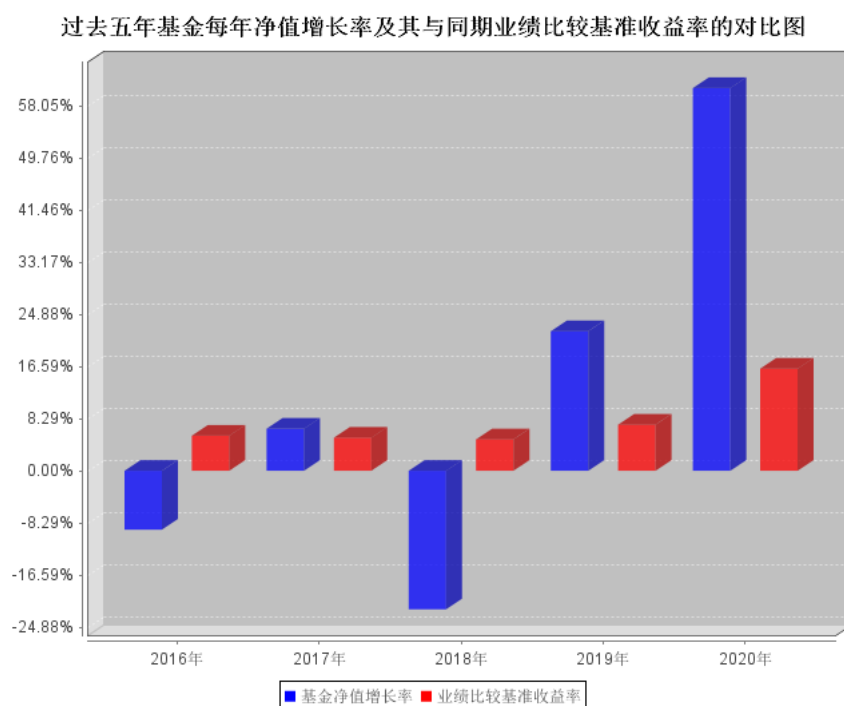
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、本基金成立于 2015 年 5 月 25 日。

2、业绩比较基准为：①自基金成立之日起至 2019 年 9 月 3 日：五年银行定期存款利率（税后）+1%；②自 2019 年 9 月 4 日起：沪深 300 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%

3.2.3 过去五年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 2015 年 5 月 25 日。

2、业绩比较基准为：①自基金成立之日起至 2019 年 9 月 3 日：五年银行定期存款利率（税后）+1%；②自 2019 年 9 月 4 日起：沪深 300 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 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。公司经营范围包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。公司股东为华福证券有限责任公司与国脉科技股份有限公司。本公司经证监会证监许可（2013）1289 号文批准，于 2013 年 10 月 25 日成立。2016 年 9 月 23 日，公司股东同比比例增资，公司注册资本由 10,000 万元变更为 14,300 万元。增资后股东出资比例维持不变，华福证券有限责任公司出资比例为 76%，国脉科技股份有限公司出资比例为 24%。2016 年 10 月 24 日，公司法定名称由“华福基金管理有限责任公司”变更为“兴银基金管理有限责任公司”。

截至报告期末，本公司管理 35 只开放式基金（兴银货币市场基金、兴银鼎新灵活配置混合型证券投资基金、兴银长乐半年定期开放债券型证券投资基金、兴银丰盈灵活配置混合型证券投资基金、兴银大健康灵活配置混合型证券投资基金、兴银现金增利货币市场基金、兴银瑞益纯债债券型证券投资基金、兴银朝阳债券型证券投资基金、兴银稳健债券型证券投资基金、兴银现金收益货币市场基金、兴银收益增强债券型证券投资基金、兴银现金添利货币市场基金、兴银长益三个月定期开放债券型证券投资基金、兴银长盈三个月定期开放债券型证券投资基金、兴银消费新趋势灵活配置混合型证券投资基金、兴银丰润灵活配置混合型证券投资基金、兴银中短债债券型证券投资基金、兴银汇福定期开放债券型发起式证券投资基金、兴银合盈债券型证券投资基金、兴银上海清算所 3-5 年中等等级优选信用债指数证券投资基金、兴银合丰政策性金融债债券型证券投资基金、兴银汇逸三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、兴银鑫日享短债债券型证券投资基金、兴银先锋成长混合型证券投资基金、兴银汇裕一年定期开放债券型发起式证券投资基金、兴银聚丰债券型证券投资基金、兴银合盛三年定期开放债券型证券投资基金、兴银汇悦一年定期开放债券型发起式证券投资基金、兴银汇智一年定期开放债券型发起式证券投资基金、兴银丰运稳益回报混合型证券投资基金、兴银研究精选股票型证券投资基金、兴银合富债券型证券投资基金、兴银景气优选混合型证券投资基金、兴银策略智选混合型证券投资基金、兴银汇泽 87 个月定期开放债券型证券投资基金），净值总规模超 500 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨坤	权益投资	2020 年 6 月	-	14	曾任职于光大保德信

	总监	22 日			基金管理、中欧基金研究部副总监、专户事业部助理、海富通基金投资经理，2015 年中加入富国基金任投资经理。2017 年 9 月至 2018 年 12 月担任财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金基金经理。2017 年 12 月起至 2018 年 12 月担任财通资管鑫锐回报混合型证券投资基金基金经理。2018 年 4 月起至 2018 年 12 月担任财通资管消费精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018 年 5 月起至 2018 年 12 月担任财通资管鑫盛 6 个月定期开放混合型证券投资基金基金经理。2020 年 6 月起担任兴银鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2020 年 7 月起担任兴银研究精选股票型证券投资基金基金经理。2020 年 11 月起任兴银策略智选混合型证券投资基金基金经理。2020 年 11 月起担任兴银景气优选混合型证券投资基金基金经理。
--	----	------	--	--	---

1、此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告载明日期。洪木妹女士为本基金的首任基金经理，任职日期为 2015-05-25 至 2016-06-29。陈博亮先生曾任本基金基金经理，任职日期为 2015-11-19 至 2017-07-04。方军平先生曾任本基金基金经理，任职日期为 2016-8-31 至 2019-3-22。王磊先生曾任本基金基金经理，任职日期为 2018-8-11 至 2021-1-13。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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

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

2020 年中国率先从新冠疫情中恢复，A 股市场沿着疫情影响下的经济修复主线运行，叠加较为宽松的货币政策和“宽信用”预期，全年市场震荡上行。随着 A 股制度的变革和外资持续流入，机构投资的思路逐渐成熟，选股标准日渐清晰，即行业景气度高、成长路径明确、或是具有稳定良好的业绩。公司的业绩增长才是推动股价持续上涨的核心因素。我们坚持“深度研究、价值投

资”的理念，主要配置方向有消费、医药、新能源、科技和部分周期，采取“核心+卫星”配置模式，个股既有行业龙头，也有二线白马，力争通过分享优质公司从小到大、从优秀变卓越的过程，实现组合净值的稳健增长。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.612 元；本报告期基金份额净值增长率为 60.88%，业绩比较基准收益率为 16.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年以来，市场呈现比较极致的结构性行情，龙头、白马、核心资产的表现非常亮眼。经过 2 年多的上涨，部分投资赛道已经比较拥挤。展望 2021 年，一方面我们所处的内外部宏观经济环境可能较为负责、政策可能更体现为“相机抉择”，投资过程中面临的不确定性可能更多；另一方面，在进行行业配置和个股选择时，可能需要更多逆向投资的思维，逆向投资的内核是均值回归，通过对一个公司的基本面进行比较深入的研究分析，在估值洼地筛选标的胜率可能更大。我们认为今年市场可能出现宽幅震荡，需要关注两大风险点：一是美国国债利率上行；二是国内的信用收缩。信用下行周期，更需要关注市场风格的切换，从提升估值到重视盈利和行业景气度的关注。所以，后期我们在选股时，会关注几方面因素：行业景气度、细分行业自身所处的产业生命周期，估值因素，绝对和相对股价位置等，希望追求最佳风险收益比，提升选股胜率。

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）进一步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

本基金已连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元，日期范围：2020 年 1 月 1 日-2020 年 11 月 26 日。目前产品净值高于 5000 万元。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，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

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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	德师报(审)字(21)第 P00301 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	兴银鼎新灵活配置混合型证券投资基金全体持有人
审计意见	我们审计了兴银鼎新灵活配置混合型证券投资基金的财务报表,包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表,2020 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,公允反映了兴银鼎新灵活配置混合型证券投资基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则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,我们独立于兴银鼎新灵活配置混合型证券投资基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	兴银基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括兴银鼎新灵活配置混合型证券投资基金 2020 年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表,使其

	实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估兴银鼎新灵活配置混合型证券投资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，除非基金管理人管理层计划清算兴银鼎新灵活配置混合型证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督兴银鼎新灵活配置混合型证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (4) 对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，就可能导致对兴银鼎新灵活配置混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在

	重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致兴银鼎新灵活配置混合型证券投资基金不能持续经营。 (5)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	汪润松	刘典昆
会计师事务所的地址	上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼	
审计报告日期	2021 年 3 月 30 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：兴银鼎新灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	2,025,219.96	117,318.10
结算备付金		988,629.13	178,409.16
存出保证金		54,175.66	84,137.49
交易性金融资产	7.4.7.2	51,755,903.56	13,899,455.60
其中：股票投资		49,159,163.26	13,187,852.10
基金投资		-	-
债券投资		2,596,740.30	711,603.50
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	16,616.66
应收利息	7.4.7.5	57,730.18	19,616.47
应收股利		-	-
应收申购款		69,584.65	52,249.57
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		54,951,243.14	14,367,803.05
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 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		-	-
应付证券清算款		1,248,766.69	56,608.62
应付赎回款		268,513.07	51,400.64
应付管理人报酬		42,639.20	12,483.38
应付托管费		4,263.93	1,248.34
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	386,147.97	89,050.28
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	146,694.43	272,051.84
负债合计		2,097,025.29	482,843.10
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	32,791,116.41	13,857,442.92
未分配利润	7.4.7.10	20,063,101.44	27,517.03
所有者权益合计		52,854,217.85	13,884,959.95
负债和所有者权益总计		54,951,243.14	14,367,803.05

报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.612 元，基金份额总额 32,791,116.41 份。

7.2 利润表

会计主体：兴银鼎新灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		15,685,886.98	3,043,541.73
1. 利息收入		60,282.43	267,253.08
其中：存款利息收入	7.4.7.11	16,795.58	142,794.49
债券利息收入		42,931.71	74,385.10
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		555.14	50,073.49
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		12,471,427.57	1,509,880.45
其中：股票投资收益	7.4.7.12	12,278,652.19	1,804,713.36
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-18,529.87	-652,793.33
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	211,305.25	357,960.42
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	2,997,762.38	971,662.86
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	156,414.60	294,745.34
减：二、费用		2,489,336.66	1,477,500.59
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	299,903.36	343,385.59
2. 托管费	7.4.10.2.2	29,990.29	34,338.54
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-

4. 交易费用	7.4.7.19	2,085,187.71	899,669.20
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	7.26
7. 其他费用	7.4.7.20	74,255.30	200,100.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		13,196,550.32	1,566,041.14
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		13,196,550.32	1,566,041.14

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴银鼎新灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	13,857,442.92	27,517.03	13,884,959.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	13,196,550.32	13,196,550.32
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	18,933,673.49	6,839,034.09	25,772,707.58
其中：1. 基金申购款	50,573,837.53	17,739,204.50	68,313,042.03
2. 基金赎回款	-31,640,164.04	-10,900,170.41	-42,540,334.45
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	32,791,116.41	20,063,101.44	52,854,217.85
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益（基金净值）	185,097,566.55	-33,349,972.02	151,747,594.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,566,041.14	1,566,041.14
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-171,240,123.63	31,811,447.91	-139,428,675.72
其中：1. 基金申购款	93,373,415.18	-12,025,633.41	81,347,781.77
2. 基金赎回款	-264,613,538.81	43,837,081.32	-220,776,457.49
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	13,857,442.92	27,517.03	13,884,959.95

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：

张贵云	刘建新	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

华福鼎新灵活配置混合型证券投资基金（以下简称本基金）经中国证监会证监许可〔2015〕878号文准予注册，本基金首次募集资金总额为人民币 996,360,866.50 元。《华福鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 5 月 25 日正式生效。根据 2017 年 3 月 30 日《兴银基金管理有限责任公司关于旗下基金更名事宜的公告》，华福鼎新灵活配置混合型证券投资基金自 2017 年 4 月 5 日起更名为兴银鼎新灵活配置混合型证券投资基金。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为兴银基金管理有限责任公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、股指期货等权益类金融工具、债券等固定收益类金融工具（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中

国证监会的相关规定)。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。

本基金为混合型基金,基金的投资组合比例为股票、权证占基金资产的 0%-95%;债券、资产支持证券、债券逆回购、银行存款占基金资产的比例不低于 5%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中,现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本基金以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度,即每年 1 月 1 日起至 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。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求,本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项,暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或

可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

2、金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂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。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。贷款及应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，贷款及应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是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；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

(1) 对于银行间市场交易的固定收益品种，以及交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照第三方估值机构提供的估值确

定公允价值。

(2) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值；对于发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行时股票公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按照监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

(3) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

(4) 投资品种不再存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

(2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

资产支持证券投资收益为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

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

(3) 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产/负债的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产/负债卖出或到期时转出计入投资收益。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬、基金托管费和销售服务费按基金合同及相关公告约定的费率和计算方法逐日计提。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金收益分配方式为现金分红；基金份额持有人可以事先选择将所获分配的现金收益，按照基金合同有关基金份额申购的约定转为基金份额；基金份额持有人事先未做出选择的，基金管理人应当支付现金；

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

(3) 本基金每一基金份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

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

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《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》（中基协发[2017]6 号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

(2) 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，根据《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》（中国证监会公告[2017]13 号）及《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》（中基协发[2013]13 号）相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(3) 根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》（中基协发[2014]24 号），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场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

本基金本报告期内无需说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]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《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]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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税;2018 年 1 月 1 日起,公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务,以基金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。

(2) 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,暂不计缴企业所得税。

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入,由上市公司代扣代缴个人所得税;从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳

税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

(5) 基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	2,025,219.96	117,318.10
定期存款	—	—
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	—	—
合计：	2,025,219.96	117,318.10

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2020 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		45,050,133.03	49,159,163.26	4,109,030.23
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	2,601,429.80	2,596,740.30	-4,689.50
	银行间市场	—	—	—
	合计	2,601,429.80	2,596,740.30	-4,689.50
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		47,651,562.83	51,755,903.56	4,104,340.73
项目		上年度末 2019 年 12 月 31 日		

		成本	公允价值	公允价值变动
股票		12,074,518.69	13,187,852.10	1,113,333.41
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	718,358.56	711,603.50	-6,755.06
	银行间市场	-	-	-
	合计	718,358.56	711,603.50	-6,755.06
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		12,792,877.25	13,899,455.60	1,106,578.35

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

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

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	52.49	32.83
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	489.39	88.33
应收债券利息	57,151.79	19,453.73
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	9.67	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	26.84	41.58
合计	57,730.18	19,616.47

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	386,132.97	89,050.28
银行间市场应付交易费用	—	—
银行汇划费	15.00	—
合计	386,147.97	89,050.28

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	—	—
应付赎回费	509.13	1.84
应付证券出借违约金	—	—
预提费用	146,185.30	272,050.00
合计	146,694.43	272,051.84

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	13,857,442.92	13,857,442.92
本期申购	50,573,837.53	50,573,837.53
本期赎回（以“-”号填列）	-31,640,164.04	-31,640,164.04
- 基金拆分/份额折算前	—	—
基金拆分/份额折算变动份额	—	—
本期申购	—	—
本期赎回（以“-”号填列）	—	—
本期末	32,791,116.41	32,791,116.41

注：本期申购含红利再投、转换入份(金)额，本期赎回含转换出份(金)额。

7.4.7.10 未分配利润

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	-268,561.18	296,078.21	27,517.03
本期利润	10,198,787.94	2,997,762.38	13,196,550.32
本期基金份额交易产生的变动数	6,540,720.33	298,313.76	6,839,034.09
其中：基金申购款	15,869,693.42	1,869,511.08	17,739,204.50
基金赎回款	-9,328,973.09	-1,571,197.32	-10,900,170.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	16,470,947.09	3,592,154.35	20,063,101.44

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	7,478.08	130,649.85
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	8,347.69	8,927.56
其他	969.81	3,217.08
合计	16,795.58	142,794.49

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	12,278,652.19	1,804,713.36
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	12,278,652.19	1,804,713.36

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019 年12月31日
卖出股票成交总额	763,898,370.62	337,723,479.49
减：卖出股票成本总额	751,619,718.43	335,918,766.13
买卖股票差价收入	12,278,652.19	1,804,713.36

7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.13 债券投资收益**7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-18,529.87	-652,793.33
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-18,529.87	-652,793.33

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	3,441,551.62	27,624,920.75
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	3,347,569.22	27,877,423.45
减：应收利息总额	112,512.27	400,290.63
买卖债券差价收入	-18,529.87	-652,793.33

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益**7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.15 衍生工具收益**7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	211,305.25	357,960.42
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	211,305.25	357,960.42

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	2,997,762.38	971,662.86
——股票投资	2,995,696.82	1,044,417.92
——债券投资	2,065.56	-72,755.06
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	2,997,762.38	971,662.86

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	156,412.59	294,745.34
其他	2.01	-
合计	156,414.60	294,745.34

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	2,085,187.71	899,669.20
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	2,085,187.71	899,669.20

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
审计费用	36,885.30	42,750.00
信息披露费	-	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	170.00	150.00
上清所查询费	1,200.00	1,200.00
帐户维护费	36,000.00	36,000.00
合计	74,255.30	200,100.00

7.4.7.21 分部报告

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

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

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

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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	70,306,933.96	4.54%	471,282,212.70	68.86%

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例
华福证券	404,188.85	7.04%	2,778,351.08	6.29%

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比 例
华福证券	-	-	437,000,000.00	91.90%

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

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 2020年1月1日至2020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	51,415.49	4.34%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	344,648.55	68.85%	89,050.28	100.00%

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 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	299,903.36	343,385.59
其中：支付销售机构的客户维护费	105,954.49	138,990.01

注：本基金的管理费年费率为 1.0%。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

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 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	29,990.29	34,338.54

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费，E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.2.3 销售服务费

本基金无销售服务费。

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

本基金本报告期内未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**

无。

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

无。

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**

份额单位：份

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2015 年 5 月 25 日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	6,041,181.56	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	6,041,181.56	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	18.42%	0.00%

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

份额单位：份

关联方名	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
------	-------------------------	--------------------------

称	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总 份额的比 例	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总份 额的比例
上 海 兴 瀚 资 产 管 理 有 限 公 司	8,666,933.04	26.43%	0.00	0.00%

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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
兴业银行	2,025,219.96	7,478.08	117,318.10	130,649.85

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2020 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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流 通日	流通受 限类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 （单位： 股）	期末 成本总额	期末估值 总额	备注
605277	新亚 电子	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 6 日	新股未 上市	16.95	16.95	355	6,017.25	6,017.25	-
003030	祖名	2020 年	2021	新股未	15.18	15.18	372	5,646.96	5,646.96	-

	股份	12 月 25 日	年 1 月 6 日	上市						
003031	中瓷电子	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 4 日	新股未上市	15.27	15.27	315	4,810.05	4,810.05	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

本基金本报告期末持有的债券中无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末持有的债券中无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

行的证券，不得超过该证券的 10%。

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末和上年度末未持有除国债、政策性金融债和央行票据以外的需按短期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末和上年度末未持有需按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末和上年度末未持有需按短期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末和上年度末均未持有除国债、政策性金融债和央行票据以外的需按长期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末和上年度末未持有需按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末和上年度末未持有需按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

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

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

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、债券等资产，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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、债券投资、结算备付金及存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 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							
银行存款	2,025,219.96	0.00	0.00	0.00	0.00	-	2,025,219.96
结算备付金	988,629.13	-	-	-	-	-	988,629.13
存出保证金	54,175.66	-	-	-	-	-	54,175.66
交易性金融资产	2,596,740.30	0.00	0.00	0.00	0.00	49,159,163.26	51,755,903.56
应收利息	-	-	-	-	-	57,730.18	57,730.18
应收申购款	-	-	-	-	-	69,584.65	69,584.65
资产总计	5,664,765.05	0.00	0.00	0.00	0.00	49,286,478.09	54,951,243.14

负债							
应付交易费用	-	-	-	-	-	386,147.97	386,147.97
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,248,766.69	1,248,766.69
其他负债	-	-	-	-	-	146,694.43	146,694.43
应付赎回款	-	-	-	-	-	268,513.07	268,513.07
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	42,639.20	42,639.20
应付托管费	-	-	-	-	-	4,263.93	4,263.93
负债总计	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	2,097,025.29	2,097,025.29
利率敏感度缺口	5,664,765.05	0.00	0.00	0.00	0.00	47,189,452.80	52,854,217.85
上年度末 2019 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							
银行存款	117,318.10	0.00	0.00	0.00	0.00	-	117,318.10
结算备付金	178,409.16	-	-	-	-	-	178,409.16
存出保证金	84,137.49	-	-	-	-	-	84,137.49
交易性金融资产	0.00	0.00	711,603.50	0.00	0.00	13,187,852.10	13,899,455.60
应收证券清算款	-	-	-	-	-	16,616.66	16,616.66
应收利息	-	-	-	-	-	19,616.47	19,616.47
应收申购款	-	-	-	-	-	52,249.57	52,249.57
资产总计	379,864.75	0.00	711,603.50	0.00	0.00	13,276,334.80	14,367,803.05
负债							
应付交易费用	-	-	-	-	-	89,050.28	89,050.28
应付证券清算款	-	-	-	-	-	56,608.62	56,608.62
其他负债	-	-	-	-	-	272,051.84	272,051.84
应付赎回款	-	-	-	-	-	51,400.64	51,400.64
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	12,483.38	12,483.38
应付托管费	-	-	-	-	-	1,248.34	1,248.34
负债总计	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	482,843.10	482,843.10
利率敏感度缺口	379,864.75	0.00	711,603.50	0.00	0.00	12,793,491.70	13,884,959.95

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；		
	该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；		
	该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；		
	银行存款、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；买入返售金融资产款的利息和卖出回购金融资产款的利息支出在交易时均已确定，不受利率变化影响。		
	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（2020 年 12 月 31 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 25 个基点	-195.39	-526.20
	市场利率下降 25 个基点	195.42	526.98

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股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

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 2020 年 12 月 31 日		上年度末 2019 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	49,159,163.26	93.01	13,187,852.10	94.98
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	2,596,740.30	4.91	711,603.50	5.12
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	51,755,903.56	97.92	13,899,455.60	100.10

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；		
	以下分析，除市场基准发生变动，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（2020年12月31日）	上年度末（2019年12月31日）
	沪深300指数上涨5%	2,861,826.05	756,088.02
	沪深300指数下跌5%	-2,861,826.05	-756,088.02

注：本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2020年12月31日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 49,142,689.00 元，属于第二层次的余额为人民币 2,613,214.56 元，无属于第三层次的余额(2019年12月31日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 12,930,792.96 元，属于第二层次的余额为人民币 968,662.64 元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

本基金交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债除外)本期采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值，相关固定收益品种的公允价值层次归入第二层次

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	49,159,163.26	89.46
	其中：股票	49,159,163.26	89.46
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,596,740.30	4.73
	其中：债券	2,596,740.30	4.73
	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	3,013,849.09	5.48
8	其他各项资产	181,490.49	0.33
9	合计	54,951,243.14	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,445,515.00	2.73
C	制造业	38,268,157.66	72.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,552,444.00	2.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,874,395.60	9.22
J	金融业	534,417.00	1.01
K	房地产业	260,193.00	0.49
L	租赁和商务服务业	706,125.00	1.34
M	科学研究和技术服务业	1,001,175.00	1.89
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	516,741.00	0.98
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	49,159,163.26	93.01

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	700	1,398,600.00	2.65
2	300750	宁德时代	3,200	1,123,552.00	2.13
3	601633	长城汽车	28,500	1,077,585.00	2.04
4	002594	比亚迪	5,500	1,068,650.00	2.02
5	000858	五粮液	3,600	1,050,660.00	1.99
6	688111	金山办公	2,543	1,045,173.00	1.98
7	600436	片仔癀	3,900	1,043,289.00	1.97
8	600031	三一重工	29,600	1,035,408.00	1.96
9	300014	亿纬锂能	12,000	978,000.00	1.85
10	000333	美的集团	9,700	954,868.00	1.81
11	300124	汇川技术	9,900	923,670.00	1.75
12	601012	隆基股份	9,900	912,780.00	1.73
13	300408	三环集团	23,600	879,100.00	1.66
14	002415	海康威视	16,800	814,968.00	1.54
15	300999	金龙鱼	7,500	812,400.00	1.54
16	600570	恒生电子	7,700	807,730.00	1.53
17	600893	航发动力	13,500	801,225.00	1.52
18	600809	山西汾酒	2,134	800,868.86	1.52
19	688561	奇安信	6,214	783,585.40	1.48
20	002352	顺丰控股	8,800	776,424.00	1.47
21	601021	春秋航空	14,000	776,020.00	1.47
22	600276	恒瑞医药	6,800	757,928.00	1.43
23	601899	紫金矿业	80,700	749,703.00	1.42
24	603259	药明康德	5,500	740,960.00	1.40
25	300896	爱美客	1,100	720,522.00	1.36

26	601888	中国中免	2,500	706,125.00	1.34
27	300450	先导智能	6,900	579,531.00	1.10
28	002179	中航光电	7,200	563,688.00	1.07
29	600660	福耀玻璃	11,600	557,380.00	1.05
30	603288	海天味业	2,700	541,458.00	1.02
31	000661	长春高新	1,200	538,692.00	1.02
32	300274	阳光电源	7,400	534,872.00	1.01
33	601995	中金公司	7,100	534,417.00	1.01
34	603899	晨光文具	6,000	531,360.00	1.01
35	002466	天齐锂业	13,300	522,291.00	0.99
36	300357	我武生物	6,800	521,560.00	0.99
37	000568	泸州老窖	2,300	520,168.00	0.98
38	002410	广联达	6,600	519,684.00	0.98
39	600309	万华化学	5,700	518,928.00	0.98
40	300015	爱尔眼科	6,900	516,741.00	0.98
41	600418	江淮汽车	41,900	512,437.00	0.97
42	300677	英科医疗	3,000	504,450.00	0.95
43	300207	欣旺达	16,400	503,644.00	0.95
44	002475	立讯精密	8,900	499,468.00	0.94
45	688200	华峰测控	1,316	491,565.48	0.93
46	300496	中科创达	4,000	468,000.00	0.89
47	002389	航天彩虹	14,000	465,500.00	0.88
48	300618	寒锐钴业	4,900	465,059.00	0.88
49	603678	火炬电子	6,300	455,490.00	0.86
50	000049	德赛电池	6,500	439,400.00	0.83
51	603993	洛阳钼业	70,000	437,500.00	0.83
52	300073	当升科技	6,400	415,040.00	0.79
53	002049	紫光国微	3,100	414,811.00	0.78
54	000066	中国长城	21,700	412,083.00	0.78
55	300083	创世纪	34,600	407,588.00	0.77
56	603799	华友钴业	5,000	396,500.00	0.75
57	002706	良信股份	12,400	379,936.00	0.72
58	688122	西部超导	4,712	374,651.12	0.71
59	300379	东方通	8,000	365,600.00	0.69
60	601238	广汽集团	26,900	357,501.00	0.68
61	300454	深信服	1,400	347,214.00	0.66
62	002025	航天电器	5,300	345,454.00	0.65
63	000768	中航西飞	9,200	337,456.00	0.64
64	603068	博通集成	3,800	324,064.00	0.61

65	003009	中天火箭	4,400	320,760.00	0.61
66	688006	杭可科技	3,847	319,416.41	0.60
67	688333	铂力特	2,084	316,726.32	0.60
68	002318	久立特材	28,000	305,200.00	0.58
69	002821	凯莱英	1,000	299,140.00	0.57
70	002985	北摩高科	1,500	289,950.00	0.55
71	603906	龙蟠科技	8,100	272,565.00	0.52
72	300747	锐科激光	3,100	272,366.00	0.52
73	300776	帝尔激光	1,800	270,360.00	0.51
74	600563	法拉电子	2,500	268,875.00	0.51
75	000799	酒鬼酒	1,700	266,050.00	0.50
76	002876	三利谱	5,400	264,546.00	0.50
77	688311	盟升电子	2,197	263,420.30	0.50
78	300034	钢研高纳	7,300	262,435.00	0.50
79	600845	宝信软件	3,800	262,124.00	0.50
80	002967	广电计量	7,100	260,215.00	0.49
81	600641	万业企业	12,900	260,193.00	0.49
82	300659	中孚信息	5,300	260,124.00	0.49
83	300855	图南股份	5,400	258,606.00	0.49
84	600711	盛屯矿业	28,200	258,312.00	0.49
85	002444	巨星科技	8,300	258,213.00	0.49
86	600456	宝钛股份	4,900	255,241.00	0.48
87	600885	宏发股份	4,700	254,834.00	0.48
88	300726	宏达电子	3,500	253,225.00	0.48
89	688567	孚能科技	5,527	252,860.25	0.48
90	300001	特锐德	8,600	252,496.00	0.48
91	688559	海目星	7,634	251,845.66	0.48
92	605358	立昂微	1,800	216,720.00	0.41
93	002812	恩捷股份	1,500	212,670.00	0.40
94	600176	中国巨石	9,300	185,628.00	0.35
95	003029	吉大正元	580	15,161.20	0.03
96	688002	睿创微纳	97	10,767.00	0.02
97	605155	西大门	350	10,668.00	0.02
98	605277	新亚电子	355	6,017.25	0.01
99	003030	祖名股份	372	5,646.96	0.01
100	003031	中瓷电子	315	4,810.05	0.01

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	002142	宁波银行	4,936,639.00	35.55
2	000333	美的集团	4,838,053.00	34.84
3	600809	山西汾酒	4,424,751.69	31.87
4	601888	中国中免	4,290,071.00	30.90
5	000568	泸州老窖	4,193,134.00	30.20
6	300014	亿纬锂能	4,181,022.88	30.11
7	600031	三一重工	3,967,854.48	28.58
8	601318	中国平安	3,944,762.00	28.41
9	300750	宁德时代	3,777,099.50	27.20
10	600276	恒瑞医药	3,717,225.73	26.77
11	002594	比亚迪	3,526,881.00	25.40
12	300207	欣旺达	3,526,072.00	25.39
13	600036	招商银行	3,491,394.00	25.15
14	000001	平安银行	3,482,508.00	25.08
15	000661	长春高新	3,467,568.00	24.97
16	600009	上海机场	3,466,549.00	24.97
17	603737	三棵树	3,428,281.00	24.69
18	002475	立讯精密	3,326,486.70	23.96
19	000596	古井贡酒	3,312,877.00	23.86
20	600436	片仔癀	3,254,149.00	23.44
21	300347	泰格医药	3,242,180.00	23.35
22	600570	恒生电子	3,238,651.00	23.32
23	000799	酒鬼酒	3,225,060.00	23.23
24	300122	智飞生物	3,194,080.00	23.00
25	002271	东方雨虹	3,185,104.00	22.94
26	002241	歌尔股份	3,177,003.00	22.88
27	600703	三安光电	3,142,802.00	22.63
28	000860	顺鑫农业	3,091,279.67	22.26
29	603288	海天味业	3,080,223.60	22.18
30	300454	深信服	3,035,810.00	21.86
31	601012	隆基股份	2,986,739.00	21.51

32	600132	重庆啤酒	2,975,088.61	21.43
33	603259	药明康德	2,898,763.37	20.88
34	002568	百润股份	2,872,952.00	20.69
35	300760	迈瑞医疗	2,850,666.00	20.53
36	600845	宝信软件	2,800,861.76	20.17
37	603899	晨光文具	2,764,739.00	19.91
38	300136	信维通信	2,744,515.33	19.77
39	600763	通策医疗	2,741,613.00	19.75
40	002511	中顺洁柔	2,725,853.00	19.63
41	600309	万华化学	2,712,670.00	19.54
42	000002	万科 A	2,706,321.00	19.49
43	002352	顺丰控股	2,706,069.00	19.49
44	600519	贵州茅台	2,703,954.00	19.47
45	300782	卓胜微	2,676,909.40	19.28
46	000538	云南白药	2,669,164.06	19.22
47	600872	中炬高新	2,655,118.00	19.12
48	300124	汇川技术	2,630,477.02	18.94
49	300285	国瓷材料	2,588,832.00	18.64
50	600486	扬农化工	2,574,126.00	18.54
51	603187	海容冷链	2,565,531.00	18.48
52	300751	迈为股份	2,545,608.00	18.33
53	601899	紫金矿业	2,496,758.00	17.98
54	000858	五粮液	2,490,176.00	17.93
55	300725	药石科技	2,482,071.00	17.88
56	603290	斯达半导	2,469,588.00	17.79
57	601633	长城汽车	2,454,200.00	17.68
58	600048	保利地产	2,447,783.00	17.63
59	002507	涪陵榨菜	2,443,736.00	17.60
60	600438	通威股份	2,415,090.00	17.39
61	002706	良信股份	2,412,116.00	17.37
62	002959	小熊电器	2,393,328.10	17.24
63	002714	牧原股份	2,387,638.60	17.20
64	300298	三诺生物	2,375,686.52	17.11
65	688111	金山办公	2,360,504.53	17.00
66	603882	金域医学	2,346,337.00	16.90
67	300015	爱尔眼科	2,319,480.00	16.70

68	688208	道通科技	2,264,594.69	16.31
69	300759	康龙化成	2,259,774.00	16.27
70	300661	圣邦股份	2,225,744.00	16.03
71	600521	华海药业	2,214,438.00	15.95
72	600161	天坛生物	2,183,794.00	15.73
73	000100	TCL 科技	2,163,126.00	15.58
74	002821	凯莱英	2,156,484.00	15.53
75	603345	安井食品	2,144,087.00	15.44
76	300408	三环集团	2,092,508.12	15.07
77	603939	益丰药房	2,088,696.60	15.04
78	002812	恩捷股份	2,083,371.72	15.00
79	300601	康泰生物	2,079,186.00	14.97
80	300529	健帆生物	2,077,793.70	14.96
81	601788	光大证券	2,040,743.00	14.70
82	002541	鸿路钢构	2,026,128.00	14.59
83	600660	福耀玻璃	2,023,734.00	14.58
84	300433	蓝思科技	2,012,921.00	14.50
85	002049	紫光国微	2,006,437.00	14.45
86	300450	先导智能	1,989,884.80	14.33
87	002409	雅克科技	1,979,901.00	14.26
88	601818	光大银行	1,978,832.00	14.25
89	600176	中国巨石	1,969,831.80	14.19
90	603501	韦尔股份	1,961,067.36	14.12
91	300763	锦浪科技	1,957,720.80	14.10
92	002601	龙蟠佰利	1,954,219.00	14.07
93	603486	科沃斯	1,931,219.00	13.91
94	000895	双汇发展	1,908,584.11	13.75
95	603317	天味食品	1,893,852.00	13.64
96	603129	春风动力	1,885,436.00	13.58
97	300168	万达信息	1,864,673.00	13.43
98	300724	捷佳伟创	1,849,634.00	13.32
99	688169	石头科技	1,849,082.50	13.32
100	002335	科华恒盛	1,821,185.00	13.12
101	601336	新华保险	1,814,183.00	13.07
102	688122	西部超导	1,814,003.99	13.06
103	300699	光威复材	1,799,341.80	12.96

104	600079	人福医药	1,782,474.00	12.84
105	603198	迎驾贡酒	1,770,706.00	12.75
106	300659	中孚信息	1,764,151.00	12.71
107	600196	复星医药	1,731,075.00	12.47
108	600887	伊利股份	1,730,383.00	12.46
109	603185	上机数控	1,713,332.00	12.34
110	600529	山东药玻	1,701,809.82	12.26
111	002041	登海种业	1,681,813.00	12.11
112	601838	成都银行	1,678,778.00	12.09
113	000636	风华高科	1,675,870.48	12.07
114	002371	北方华创	1,673,411.00	12.05
115	002078	太阳纸业	1,669,626.00	12.02
116	603517	绝味食品	1,667,548.00	12.01
117	002415	海康威视	1,663,234.00	11.98
118	000423	东阿阿胶	1,655,579.00	11.92
119	601995	中金公司	1,640,371.00	11.81
120	300348	长亮科技	1,636,244.00	11.78
121	603298	杭叉集团	1,624,785.60	11.70
122	002129	中环股份	1,621,326.00	11.68
123	002027	分众传媒	1,606,122.00	11.57
124	300496	中科创达	1,601,812.00	11.54
125	600690	海尔智家	1,576,843.00	11.36
126	002727	一心堂	1,565,416.00	11.27
127	000651	格力电器	1,556,791.00	11.21
128	300274	阳光电源	1,556,591.06	11.21
129	300146	汤臣倍健	1,554,441.00	11.20
130	002332	仙琚制药	1,550,571.00	11.17
131	300677	英科医疗	1,539,367.00	11.09
132	002773	康弘药业	1,532,512.00	11.04
133	600741	华域汽车	1,529,297.15	11.01
134	300188	美亚柏科	1,526,256.00	10.99
135	603993	洛阳钼业	1,524,390.00	10.98
136	603195	公牛集团	1,521,400.00	10.96
137	300674	宇信科技	1,504,622.00	10.84
138	600720	祁连山	1,500,992.00	10.81
139	300769	德方纳米	1,499,316.80	10.80

140	002851	麦格米特	1,497,538.50	10.79
141	000786	北新建材	1,490,993.91	10.74
142	002493	荣盛石化	1,466,158.00	10.56
143	603866	桃李面包	1,464,504.70	10.55
144	600197	伊力特	1,461,685.00	10.53
145	603520	司太立	1,454,429.00	10.47
146	600754	锦江酒店	1,448,405.00	10.43
147	688333	铂力特	1,435,871.33	10.34
148	603816	顾家家居	1,433,221.60	10.32
149	601021	春秋航空	1,427,232.00	10.28
150	300316	晶盛机电	1,415,603.00	10.20
151	603444	吉比特	1,411,777.00	10.17
152	601966	玲珑轮胎	1,408,112.72	10.14
153	688200	华峰测控	1,404,581.63	10.12
154	603712	七一二	1,403,271.80	10.11
155	000878	云南铜业	1,396,681.00	10.06
156	000831	五矿稀土	1,390,425.59	10.01
157	300595	欧普康视	1,385,655.00	9.98
158	300623	捷捷微电	1,378,163.40	9.93
159	603260	合盛硅业	1,369,798.00	9.87
160	000877	天山股份	1,368,411.43	9.86
161	688188	柏楚电子	1,355,080.86	9.76
162	600588	用友网络	1,352,795.00	9.74
163	600600	青岛啤酒	1,344,146.00	9.68
164	002466	天齐锂业	1,344,057.00	9.68
165	603267	鸿远电子	1,333,336.00	9.60
166	600711	盛屯矿业	1,330,182.00	9.58
167	002847	盐津铺子	1,328,743.00	9.57
168	002032	苏泊尔	1,328,338.00	9.57
169	603799	华友钴业	1,322,605.00	9.53
170	000625	长安汽车	1,322,460.00	9.52
171	002557	洽洽食品	1,321,689.55	9.52
172	002738	中矿资源	1,311,443.00	9.45
173	300244	迪安诊断	1,310,394.00	9.44
174	601066	中信建投	1,310,264.00	9.44
175	002600	领益智造	1,309,039.00	9.43

176	002920	德赛西威	1,304,039.00	9.39
177	603986	兆易创新	1,303,099.00	9.38
178	300630	普利制药	1,303,097.00	9.38
179	300502	新易盛	1,302,556.24	9.38
180	300775	三角防务	1,284,954.98	9.25
181	688388	嘉元科技	1,282,859.22	9.24
182	300866	安克创新	1,280,620.00	9.22
183	600584	长电科技	1,280,121.00	9.22
184	300618	寒锐钴业	1,278,952.00	9.21
185	600559	老白干酒	1,273,961.10	9.18
186	603806	福斯特	1,259,455.00	9.07
187	688561	奇安信	1,255,700.55	9.04
188	300476	胜宏科技	1,254,808.60	9.04
189	002258	利尔化学	1,244,876.95	8.97
190	300224	正海磁材	1,229,336.00	8.85
191	300357	我武生物	1,228,610.00	8.85
192	300896	爱美客	1,228,305.00	8.85
193	603678	火炬电子	1,225,929.00	8.83
194	002572	索菲亚	1,224,952.00	8.82
195	603883	老百姓	1,223,706.00	8.81
196	300671	富满电子	1,220,971.00	8.79
197	603833	欧派家居	1,218,275.24	8.77
198	002643	万润股份	1,210,935.00	8.72
199	601628	中国人寿	1,209,781.78	8.71
200	600383	金地集团	1,208,652.00	8.70
201	002236	大华股份	1,206,500.00	8.69
202	300572	安车检测	1,203,217.00	8.67
203	603369	今世缘	1,201,891.50	8.66
204	002675	东诚药业	1,199,459.00	8.64
205	603127	昭衍新药	1,197,626.00	8.63
206	300059	东方财富	1,192,697.00	8.59
207	300482	万孚生物	1,185,662.00	8.54
208	601168	西部矿业	1,183,314.00	8.52
209	600183	生益科技	1,182,842.00	8.52
210	000725	京东方 A	1,178,416.00	8.49
211	600885	宏发股份	1,177,891.00	8.48

212	600549	厦门钨业	1,176,840.24	8.48
213	688002	睿创微纳	1,167,151.17	8.41
214	603035	常熟汽饰	1,165,709.55	8.40
215	300999	金龙鱼	1,146,704.00	8.26
216	000951	中国重汽	1,146,560.00	8.26
217	002460	赣锋锂业	1,144,951.92	8.25
218	603658	安图生物	1,143,142.00	8.23
219	000733	振华科技	1,140,724.00	8.22
220	300054	鼎龙股份	1,133,837.00	8.17
221	600779	水井坊	1,132,426.00	8.16
222	300037	新宙邦	1,126,355.00	8.11
223	600893	航发动力	1,125,632.00	8.11
224	600739	辽宁成大	1,124,822.00	8.10
225	603319	湘油泵	1,119,377.00	8.06
226	600258	首旅酒店	1,118,011.00	8.05
227	688196	卓越新能	1,114,960.05	8.03
228	603906	龙蟠科技	1,110,041.00	7.99
229	300747	锐科激光	1,109,694.00	7.99
230	600837	海通证券	1,109,438.00	7.99
231	600988	赤峰黄金	1,104,102.00	7.95
232	688363	华熙生物	1,100,117.06	7.92
233	605111	新洁能	1,099,434.51	7.92
234	603378	亚士创能	1,098,414.00	7.91
235	601933	永辉超市	1,089,138.00	7.84
236	300511	雪榕生物	1,081,715.50	7.79
237	000612	焦作万方	1,075,997.00	7.75
238	601225	陕西煤业	1,072,285.00	7.72
239	300685	艾德生物	1,068,455.50	7.70
240	300624	万兴科技	1,063,513.60	7.66
241	002304	洋河股份	1,061,757.00	7.65
242	603043	广州酒家	1,035,266.00	7.46
243	002918	蒙娜丽莎	1,033,334.00	7.44
244	688399	硕世生物	1,027,050.85	7.40
245	300395	菲利华	1,027,022.13	7.40
246	002555	三七互娱	1,025,569.00	7.39
247	002075	沙钢股份	1,025,514.57	7.39

248	688185	康希诺	1,024,041.81	7.38
249	300653	正海生物	1,023,180.00	7.37
250	600563	法拉电子	1,021,922.00	7.36
251	002876	三利谱	1,021,668.00	7.36
252	300702	天宇股份	1,020,027.00	7.35
253	600060	海信视像	1,019,412.00	7.34
254	603236	移远通信	1,015,425.00	7.31
255	603489	八方股份	1,001,122.00	7.21
256	002428	云南锗业	999,654.00	7.20
257	002985	北摩高科	999,336.00	7.20
258	300676	华大基因	993,720.00	7.16
259	002050	三花智控	984,508.72	7.09
260	688095	福昕软件	980,988.40	7.07
261	300776	帝尔激光	974,121.00	7.02
262	002791	坚朗五金	973,993.50	7.01
263	000938	紫光股份	972,730.00	7.01
264	600511	国药股份	971,202.00	6.99
265	002007	华兰生物	966,458.50	6.96
266	300850	新强联	966,006.00	6.96
267	601100	恒立液压	960,784.00	6.92
268	002240	盛新锂能	957,020.16	6.89
269	300613	富瀚微	956,064.00	6.89
270	601088	中国神华	955,327.00	6.88
271	300373	扬杰科技	954,338.00	6.87
272	300258	精锻科技	951,746.11	6.85
273	688019	安集科技	951,186.85	6.85
274	600362	江西铜业	947,873.00	6.83
275	000998	隆平高科	945,964.00	6.81
276	000830	鲁西化工	943,456.00	6.79
277	600305	恒顺醋业	943,241.00	6.79
278	603308	应流股份	943,097.00	6.79
279	688005	容百科技	941,702.80	6.78
280	601238	广汽集团	935,837.00	6.74
281	600585	海螺水泥	935,395.00	6.74
282	000768	中航西飞	929,305.00	6.69
283	300386	飞天诚信	925,109.00	6.66

284	300413	芒果超媒	924,240.00	6.66
285	002705	新宝股份	923,348.00	6.65
286	688179	阿拉丁	920,942.03	6.63
287	300394	天孚通信	920,363.00	6.63
288	002001	新和成	919,888.00	6.63
289	002648	卫星石化	912,790.00	6.57
290	300369	绿盟科技	904,863.00	6.52
291	688202	美迪西	896,014.04	6.45
292	603233	大参林	895,033.00	6.45
293	300339	润和软件	893,132.00	6.43
294	000671	阳光城	890,925.00	6.42
295	688229	博睿数据	879,589.73	6.33
296	300792	壹网壹创	876,975.00	6.32
297	002607	中公教育	876,892.00	6.32
298	300575	中旗股份	871,897.00	6.28
299	688157	松井股份	869,844.49	6.26
300	300383	光环新网	868,414.00	6.25
301	002410	广联达	865,206.00	6.23
302	600380	健康元	864,781.00	6.23
303	002311	海大集团	863,529.00	6.22
304	000425	徐工机械	862,797.00	6.21
305	300009	安科生物	861,690.00	6.21
306	600115	东方航空	859,864.00	6.19
307	603583	捷昌驱动	858,945.00	6.19
308	002833	弘亚数控	858,837.40	6.19
309	002709	天赐材料	858,514.00	6.18
310	000975	银泰黄金	858,475.00	6.18
311	603599	广信股份	857,361.00	6.17
312	002508	老板电器	856,363.00	6.17
313	300815	玉禾田	855,983.00	6.16
314	002074	国轩高科	855,757.00	6.16
315	002281	光迅科技	854,625.72	6.16
316	600456	宝钛股份	853,616.00	6.15
317	000807	云铝股份	853,387.00	6.15
318	300003	乐普医疗	849,345.00	6.12
319	000063	中兴通讯	847,684.00	6.11

320	300648	星云股份	843,558.00	6.08
321	600760	中航沈飞	837,155.00	6.03
322	002179	中航光电	836,441.00	6.02
323	300378	鼎捷软件	835,200.00	6.02
324	601965	中国汽研	830,460.00	5.98
325	002250	联化科技	829,981.00	5.98
326	600267	海正药业	827,467.00	5.96
327	600729	重庆百货	824,877.00	5.94
328	688012	中微公司	824,635.54	5.94
329	002064	华峰氨纶	821,814.00	5.92
330	002084	海鸥住工	820,712.40	5.91
331	000739	普洛药业	820,034.00	5.91
332	000783	长江证券	817,915.00	5.89
333	002677	浙江美大	814,146.00	5.86
334	600641	万业企业	810,674.80	5.84
335	603987	康德莱	809,825.00	5.83
336	000513	丽珠集团	808,659.00	5.82
337	601636	旗滨集团	803,057.00	5.78
338	688036	传音控股	801,457.29	5.77
339	600547	山东黄金	800,145.00	5.76
340	600606	绿地控股	800,119.00	5.76
341	002798	帝欧家居	797,133.00	5.74
342	603995	甬金股份	791,992.13	5.70
343	601799	星宇股份	790,854.00	5.70
344	600900	长江电力	788,776.00	5.68
345	688390	固德威	783,495.72	5.64
346	300088	长信科技	781,742.00	5.63
347	300573	兴齐眼药	778,954.00	5.61
348	002938	鹏鼎控股	777,181.00	5.60
349	000581	威孚高科	775,924.00	5.59
350	688126	沪硅产业	775,687.99	5.59
351	002023	海特高新	775,016.00	5.58
352	688396	华润微	773,637.75	5.57
353	000338	潍柴动力	770,552.00	5.55
354	603179	新泉股份	770,089.80	5.55
355	603881	数据港	768,762.00	5.54

356	601009	南京银行	767, 586. 00	5. 53
357	002635	安洁科技	766, 414. 00	5. 52
358	002389	航天彩虹	756, 821. 00	5. 45
359	300034	钢研高纳	755, 512. 00	5. 44
360	601108	财通证券	755, 113. 00	5. 44
361	600926	杭州银行	755, 096. 65	5. 44
362	688298	东方生物	752, 939. 39	5. 42
363	300777	中简科技	749, 142. 00	5. 40
364	688567	孚能科技	749, 015. 07	5. 39
365	600089	特变电工	738, 786. 00	5. 32
366	688536	思瑞浦	736, 836. 85	5. 31
367	688006	杭可科技	730, 927. 55	5. 26
368	002967	广电计量	727, 320. 00	5. 24
369	600055	万东医疗	725, 920. 00	5. 23
370	688366	昊海生科	720, 843. 15	5. 19
371	000066	中国长城	720, 574. 00	5. 19
372	000021	深科技	717, 049. 00	5. 16
373	000902	新洋丰	714, 629. 00	5. 15
374	600109	国金证券	713, 800. 00	5. 14
375	300888	稳健医疗	708, 359. 00	5. 10
376	002008	大族激光	705, 414. 00	5. 08
377	600426	华鲁恒升	703, 808. 97	5. 07
378	002905	金逸影视	702, 271. 60	5. 06
379	300438	鹏辉能源	701, 787. 00	5. 05
380	002556	辉隆股份	698, 414. 00	5. 03
381	300806	斯迪克	698, 385. 00	5. 03
382	002317	众生药业	697, 886. 00	5. 03
383	603707	健友股份	697, 151. 00	5. 02
384	300706	阿石创	695, 768. 00	5. 01
385	603718	海利生物	695, 279. 00	5. 01
386	688386	泛亚微透	694, 730. 18	5. 00
387	601233	桐昆股份	693, 461. 00	4. 99
388	002367	康力电梯	693, 243. 00	4. 99
389	603313	梦百合	691, 443. 00	4. 98
390	600460	士兰微	688, 924. 00	4. 96
391	000876	新希望	688, 902. 99	4. 96

392	300642	透景生命	687,888.00	4.95
393	601952	苏垦农发	684,482.50	4.93
394	600801	华新水泥	684,473.00	4.93
395	000710	贝瑞基因	683,829.00	4.92
396	002444	巨星科技	682,832.00	4.92
397	300073	当升科技	682,277.00	4.91
398	002384	东山精密	675,271.00	4.86
399	002194	武汉凡谷	674,518.00	4.86
400	600598	北大荒	666,797.00	4.80
401	300010	豆神教育	666,562.00	4.80
402	688017	绿的谐波	666,477.46	4.80
403	603920	世运电路	663,875.00	4.78
404	300680	隆盛科技	658,841.00	4.74
405	002180	纳思达	657,739.00	4.74
406	002245	蔚蓝锂芯	657,001.00	4.73
407	600933	爱柯迪	655,224.00	4.72
408	300236	上海新阳	654,214.00	4.71
409	300726	宏达电子	652,470.00	4.70
410	000933	神火股份	651,983.00	4.70
411	000887	中鼎股份	650,933.00	4.69
412	002216	三全食品	650,911.00	4.69
413	002745	木林森	647,670.00	4.66
414	600886	国投电力	646,868.00	4.66
415	300604	长川科技	645,960.00	4.65
416	300825	阿尔特	645,897.00	4.65
417	600745	闻泰科技	645,870.00	4.65
418	688088	虹软科技	640,705.87	4.61
419	300633	开立医疗	640,109.00	4.61
420	601865	福莱特	639,250.00	4.60
421	002810	山东赫达	637,084.00	4.59
422	603018	华设集团	636,642.00	4.59
423	002796	世嘉科技	633,236.00	4.56
424	688008	澜起科技	633,146.47	4.56
425	688099	晶晨股份	631,923.83	4.55
426	002318	久立特材	626,852.00	4.51
427	002756	永兴材料	626,670.00	4.51

428	600699	均胜电子	625,781.00	4.51
429	300816	艾可蓝	624,628.00	4.50
430	600346	恒力石化	623,906.00	4.49
431	688016	心脉医疗	621,040.67	4.47
432	002044	美年健康	620,109.00	4.47
433	603533	掌阅科技	616,655.00	4.44
434	002982	湘佳股份	614,844.00	4.43
435	002993	奥海科技	613,969.48	4.42
436	300418	昆仑万维	607,591.00	4.38
437	002262	恩华药业	607,193.00	4.37
438	603429	集友股份	605,370.00	4.36
439	002831	裕同科技	605,082.00	4.36
440	605358	立昂微	603,905.84	4.35
441	300783	三只松鼠	599,889.00	4.32
442	603605	珀莱雅	595,420.00	4.29
443	688311	盟升电子	588,262.05	4.24
444	300666	江丰电子	587,548.00	4.23
445	000869	张裕 A	586,436.00	4.22
446	300001	特锐德	584,356.00	4.21
447	300869	康泰医学	582,978.00	4.20
448	300638	广和通	582,283.00	4.19
449	600201	生物股份	581,406.00	4.19
450	300451	创业慧康	580,461.00	4.18
451	300829	金丹科技	579,720.00	4.18
452	688981	中芯国际	579,711.37	4.18
453	601919	中远海控	578,756.00	4.17
454	688023	安恒信息	573,282.65	4.13
455	601668	中国建筑	572,598.00	4.12
456	300326	凯利泰	572,180.00	4.12
457	300033	同花顺	570,479.00	4.11
458	002152	广电运通	568,706.00	4.10
459	603019	中科曙光	567,964.07	4.09
460	603068	博通集成	566,874.00	4.08
461	300568	星源材质	565,974.00	4.08
462	603697	有友食品	565,915.24	4.08
463	603337	杰克股份	565,583.36	4.07

464	300558	贝达药业	565,330.00	4.07
465	603826	坤彩科技	565,327.30	4.07
466	002230	科大讯飞	565,038.00	4.07
467	002518	科士达	564,670.00	4.07
468	300115	长盈精密	564,474.00	4.07
469	300223	北京君正	563,852.00	4.06
470	002273	水晶光电	562,388.00	4.05
471	688029	南微医学	562,182.54	4.05
472	603708	家家悦	558,903.00	4.03
473	603186	华正新材	558,260.00	4.02
474	603612	索通发展	557,763.00	4.02
475	300639	凯普生物	556,337.00	4.01
476	688559	海目星	556,198.56	4.01
477	002777	久远银海	553,045.00	3.98
478	002970	锐明技术	551,699.00	3.97
479	300151	昌红科技	549,612.00	3.96
480	603156	养元饮品	549,141.00	3.95
481	600415	小商品城	548,290.00	3.95
482	688268	华特气体	545,325.34	3.93
483	600418	江淮汽车	544,276.00	3.92
484	603208	江山欧派	541,775.00	3.90
485	603801	志邦家居	541,365.00	3.90
486	601111	中国国航	539,070.00	3.88
487	002223	鱼跃医疗	538,824.00	3.88
488	603113	金能科技	538,179.00	3.88
489	002233	塔牌集团	536,173.00	3.86
490	600195	中牧股份	536,136.00	3.86
491	603466	风语筑	535,943.00	3.86
492	300447	全信股份	534,749.00	3.85
493	603868	飞科电器	534,172.16	3.85
494	688180	君实生物	533,476.77	3.84
495	603225	新凤鸣	531,360.00	3.83
496	300142	沃森生物	530,842.00	3.82
497	600030	中信证券	530,334.00	3.82
498	600989	宝丰能源	528,449.00	3.81
499	002043	兔宝宝	525,895.00	3.79

500	300755	华致酒行	524, 534. 20	3. 78
501	605009	豪悦护理	523, 496. 00	3. 77
502	002597	金禾实业	521, 630. 60	3. 76
503	300481	濮阳惠成	521, 449. 00	3. 76
504	603596	伯特利	519, 487. 00	3. 74
505	600206	有研新材	519, 476. 00	3. 74
506	603393	新天然气	516, 120. 23	3. 72
507	601717	郑煤机	515, 871. 00	3. 72
508	601658	邮储银行	512, 601. 00	3. 69
509	688288	鸿泉物联	511, 012. 06	3. 68
510	300390	天华超净	507, 787. 00	3. 66
511	300733	西菱动力	507, 267. 00	3. 65
512	002949	华阳国际	506, 674. 00	3. 65
513	300855	图南股份	506, 294. 00	3. 65
514	002912	中新赛克	504, 538. 00	3. 63
515	603650	彤程新材	502, 250. 50	3. 62
516	600392	盛和资源	502, 175. 00	3. 62
517	002739	万达电影	497, 397. 00	3. 58
518	002019	亿帆医药	496, 755. 00	3. 58
519	002990	盛视科技	496, 365. 00	3. 57
520	300788	中信出版	494, 453. 00	3. 56
521	300673	佩蒂股份	492, 929. 00	3. 55
522	000039	中集集团	492, 849. 00	3. 55
523	601601	中国太保	491, 663. 00	3. 54
524	688222	成都先导	487, 468. 74	3. 51
525	300617	安靠智电	487, 198. 00	3. 51
526	688598	金博股份	485, 885. 00	3. 50
527	002653	海思科	485, 170. 33	3. 49
528	300738	奥飞数据	483, 555. 84	3. 48
529	601698	中国卫通	482, 216. 00	3. 47
530	688116	天奈科技	481, 416. 36	3. 47
531	300082	奥克股份	480, 065. 00	3. 46
532	603005	晶方科技	477, 570. 00	3. 44
533	300811	铂科新材	476, 501. 00	3. 43
534	603083	剑桥科技	475, 751. 00	3. 43
535	002385	大北农	470, 809. 00	3. 39

536	688189	南新制药	467,007.40	3.36
537	600050	中国联通	466,316.00	3.36
538	002081	金螳螂	466,224.00	3.36
539	300598	诚迈科技	465,704.00	3.35
540	002407	多氟多	465,551.00	3.35
541	002916	深南电路	462,657.00	3.33
542	300226	上海钢联	462,483.00	3.33
543	603626	科森科技	461,049.00	3.32
544	003011	海象新材	460,015.00	3.31
545	600562	国睿科技	459,399.40	3.31
546	300458	全志科技	459,393.00	3.31
547	002891	中宠股份	459,108.00	3.31
548	002481	双塔食品	459,070.00	3.31
549	002732	燕塘乳业	457,386.00	3.29
550	600861	北京城乡	456,713.00	3.29
551	300525	博思软件	455,807.00	3.28
552	688139	海尔生物	455,585.02	3.28
553	603087	甘李药业	455,103.00	3.28
554	688339	亿华通	454,938.94	3.28
555	300323	华灿光电	454,131.00	3.27
556	002013	中航机电	453,108.00	3.26
557	688301	奕瑞科技	451,732.10	3.25
558	002461	珠江啤酒	451,650.00	3.25
559	000997	新大陆	450,513.00	3.24
560	600315	上海家化	450,176.00	3.24
561	002497	雅化集团	446,914.00	3.22
562	000703	恒逸石化	444,512.00	3.20
563	002353	杰瑞股份	444,307.00	3.20
564	688368	晶丰明源	442,832.90	3.19
565	300596	利安隆	442,635.00	3.19
566	688516	奥特维	440,709.35	3.17
567	300315	掌趣科技	440,332.00	3.17
568	600507	方大特钢	439,624.00	3.17
569	000049	德赛电池	438,755.00	3.16
570	300773	拉卡拉	438,702.00	3.16
571	600118	中国卫星	438,676.00	3.16

572	002707	众信旅游	437,709.00	3.15
573	603515	欧普照明	436,050.00	3.14
574	603348	文灿股份	435,386.08	3.14
575	600449	宁夏建材	434,980.00	3.13
576	300893	松原股份	434,748.80	3.13
577	600352	浙江龙盛	434,098.00	3.13
578	002981	朝阳科技	433,090.00	3.12
579	603027	千禾味业	428,946.00	3.09
580	000932	华菱钢铁	427,957.00	3.08
581	603686	龙马环卫	427,356.00	3.08
582	002897	意华股份	426,604.00	3.07
583	603888	新华网	422,995.00	3.05
584	603078	江化微	417,908.00	3.01
585	002624	完美世界	415,714.00	2.99
586	000977	浪潮信息	414,734.84	2.99
587	000921	海信家电	413,755.00	2.98
588	002025	航天电器	413,306.00	2.98
589	601689	拓普集团	412,676.00	2.97
590	300253	卫宁健康	412,496.00	2.97
591	603733	仙鹤股份	412,351.00	2.97
592	300212	易华录	408,485.00	2.94
593	002956	西麦食品	408,438.00	2.94
594	300083	创世纪	406,570.00	2.93
595	300296	利亚德	406,000.00	2.92
596	300138	晨光生物	405,620.37	2.92
597	603039	泛微网络	402,280.00	2.90
598	002405	四维图新	400,814.00	2.89
599	600674	川投能源	398,437.00	2.87
600	300552	万集科技	397,841.00	2.87
601	000910	大亚圣象	395,138.00	2.85
602	603218	日月股份	394,958.00	2.84
603	300610	晨化股份	393,915.00	2.84
604	002429	兆驰股份	393,033.00	2.83
605	000708	中信特钢	391,833.00	2.82
606	002063	远光软件	391,567.00	2.82
607	601128	常熟银行	388,961.00	2.80

608	000776	广发证券	387,175.00	2.79
609	300567	精测电子	386,271.00	2.78
610	002459	晶澳科技	385,584.00	2.78
611	605338	巴比食品	383,856.00	2.76
612	600850	华东电脑	381,029.00	2.74
613	600395	盘江股份	378,902.00	2.73
614	603566	普莱柯	376,059.00	2.71
615	603713	密尔克卫	375,670.00	2.71
616	605123	派克新材	375,040.57	2.70
617	601872	招商轮船	373,480.00	2.69
618	600731	湖南海利	372,851.00	2.69
619	600740	山西焦化	368,976.00	2.66
620	600166	福田汽车	368,841.00	2.66
621	000717	韶钢松山	368,813.00	2.66
622	600037	歌华有线	367,358.00	2.65
623	688357	建龙微纳	363,700.33	2.62
624	300379	东方通	362,835.00	2.61
625	603777	来伊份	362,292.00	2.61
626	003017	大洋生物	361,868.00	2.61
627	603916	苏博特	360,880.00	2.60
628	000426	兴业矿业	358,914.00	2.58
629	000988	华工科技	358,207.00	2.58
630	002373	千方科技	358,028.00	2.58
631	300233	金城医药	357,714.00	2.58
632	688266	泽璟制药	354,791.00	2.56
633	002690	美亚光电	354,480.00	2.55
634	002850	科达利	353,958.00	2.55
635	600323	瀚蓝环境	352,202.00	2.54
636	300012	华测检测	352,074.00	2.54
637	300824	北鼎股份	350,360.00	2.52
638	603730	岱美股份	350,027.00	2.52
639	605099	共创草坪	349,817.40	2.52
640	002859	洁美科技	346,058.00	2.49
641	603180	金牌厨柜	341,560.00	2.46
642	603338	浙江鼎力	340,756.00	2.45
643	002372	伟星新材	340,430.00	2.45

644	002396	星网锐捷	337,446.00	2.43
645	300182	捷成股份	336,990.00	2.43
646	300452	山河药辅	336,976.00	2.43
647	600363	联创光电	334,032.00	2.41
648	601808	中海油服	333,651.00	2.40
649	300463	迈克生物	333,278.00	2.40
650	002368	太极股份	332,804.00	2.40
651	600223	鲁商发展	332,596.00	2.40
652	300427	红相股份	332,421.00	2.39
653	300616	尚品宅配	332,085.00	2.39
654	003009	中天火箭	329,931.88	2.38
655	603063	禾望电气	328,903.00	2.37
656	300832	新产业	328,338.00	2.36
657	600019	宝钢股份	328,145.00	2.36
658	300791	仙乐健康	327,666.00	2.36
659	000401	冀东水泥	327,128.00	2.36
660	300770	新媒股份	321,194.00	2.31
661	600066	宇通客车	320,775.00	2.31
662	603086	先达股份	319,033.00	2.30
663	603131	上海沪工	318,437.00	2.29
664	600068	葛洲坝	317,563.00	2.29
665	300327	中颖电子	316,968.00	2.28
666	688118	普元信息	315,536.74	2.27
667	688356	键凯科技	314,657.95	2.27
668	688089	嘉必优	312,766.66	2.25
669	688158	优刻得	312,640.13	2.25
670	603392	万泰生物	310,096.00	2.23
671	600298	安琪酵母	309,769.00	2.23
672	603100	川仪股份	309,629.00	2.23
673	688051	佳华科技	306,134.00	2.20
674	002293	罗莱生活	303,177.30	2.18
675	000400	许继电气	302,007.00	2.18
676	601139	深圳燃气	301,752.00	2.17
677	300607	拓斯达	301,714.00	2.17
678	300121	阳谷华泰	301,489.00	2.17
679	300365	恒华科技	300,530.00	2.16

680	601390	中国中铁	300,154.00	2.16
681	002299	圣农发展	298,798.00	2.15
682	300101	振芯科技	298,785.00	2.15
683	603505	金石资源	298,461.00	2.15
684	688027	国盾量子	297,051.20	2.14
685	601618	中国中冶	296,928.00	2.14
686	603728	鸣志电器	295,972.00	2.13
687	600216	浙江医药	295,590.00	2.13
688	600029	南方航空	294,503.00	2.12
689	600702	ST 舍得	293,987.00	2.12
690	300487	蓝晓科技	290,444.00	2.09
691	603989	艾华集团	289,977.00	2.09
692	002465	海格通信	289,677.00	2.09
693	300845	捷安高科	287,283.52	2.07
694	300144	宋城演艺	286,480.00	2.06
695	600765	中航重机	284,214.00	2.05
696	603238	诺邦股份	283,763.00	2.04
697	688300	联瑞新材	282,898.06	2.04
698	300271	华宇软件	282,217.00	2.03
699	002382	蓝帆医疗	282,187.00	2.03
700	300739	明阳电路	279,752.00	2.01
701	603456	九洲药业	278,638.00	2.01
702	002975	博杰股份	278,257.00	2.00
703	600999	招商证券	278,195.00	2.00

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	002142	宁波银行	4,928,488.20	35.50
2	601888	中国中免	4,235,822.59	30.51
3	600809	山西汾酒	4,199,932.83	30.25
4	000333	美的集团	4,049,703.00	29.17
5	601318	中国平安	3,992,497.00	28.75
6	000568	泸州老窖	3,788,956.03	27.29
7	603737	三棵树	3,767,621.16	27.13

8	300014	亿纬锂能	3,616,685.31	26.05
9	000596	古井贡酒	3,566,428.60	25.69
10	600036	招商银行	3,552,627.10	25.59
11	000001	平安银行	3,466,988.22	24.97
12	300122	智飞生物	3,447,575.32	24.83
13	002271	东方雨虹	3,433,812.78	24.73
14	600703	三安光电	3,364,580.74	24.23
15	600009	上海机场	3,354,061.00	24.16
16	600031	三一重工	3,340,599.34	24.06
17	300750	宁德时代	3,339,318.37	24.05
18	300347	泰格医药	3,303,753.71	23.79
19	002241	歌尔股份	3,265,257.83	23.52
20	300207	欣旺达	3,213,965.17	23.15
21	002568	百润股份	3,164,500.32	22.79
22	000661	长春高新	3,113,251.58	22.42
23	000799	酒鬼酒	3,066,701.99	22.09
24	002475	立讯精密	3,060,907.51	22.04
25	600132	重庆啤酒	3,052,934.72	21.99
26	300760	迈瑞医疗	3,036,065.69	21.87
27	000860	顺鑫农业	3,035,756.70	21.86
28	600276	恒瑞医药	2,994,978.72	21.57
29	000002	万科 A	2,926,010.12	21.07
30	600763	通策医疗	2,924,094.00	21.06
31	603288	海天味业	2,901,979.51	20.90
32	300285	国瓷材料	2,858,533.75	20.59
33	300136	信维通信	2,835,692.70	20.42
34	002507	涪陵榨菜	2,784,477.50	20.05
35	002594	比亚迪	2,770,542.37	19.95
36	002511	中顺洁柔	2,760,079.63	19.88
37	300298	三诺生物	2,742,712.16	19.75
38	600872	中炬高新	2,740,227.56	19.74
39	600436	片仔癀	2,739,514.80	19.73
40	300782	卓胜微	2,737,330.00	19.71
41	300454	深信服	2,673,097.30	19.25
42	603290	斯达半导	2,669,715.00	19.23
43	000538	云南白药	2,660,770.00	19.16
44	600570	恒生电子	2,625,119.36	18.91
45	600486	扬农化工	2,620,018.76	18.87

46	603187	海容冷链	2,607,740.00	18.78
47	601012	隆基股份	2,592,980.47	18.67
48	600309	万华化学	2,527,511.10	18.20
49	600845	宝信软件	2,526,819.30	18.20
50	300725	药石科技	2,526,642.40	18.20
51	300751	迈为股份	2,518,162.52	18.14
52	002959	小熊电器	2,438,282.00	17.56
53	002714	牧原股份	2,435,052.15	17.54
54	603899	晨光文具	2,428,800.08	17.49
55	600048	保利地产	2,419,173.80	17.42
56	600438	通威股份	2,387,499.98	17.19
57	300433	蓝思科技	2,386,456.77	17.19
58	603882	金域医学	2,348,393.05	16.91
59	600521	华海药业	2,295,692.05	16.53
60	603259	药明康德	2,294,910.75	16.53
61	603345	安井食品	2,267,928.76	16.33
62	300759	康龙化成	2,260,873.00	16.28
63	601788	光大证券	2,235,064.00	16.10
64	300661	圣邦股份	2,204,879.48	15.88
65	600161	天坛生物	2,198,085.22	15.83
66	300699	光威复材	2,176,527.13	15.68
67	688208	道通科技	2,174,566.26	15.66
68	000100	TCL 科技	2,109,926.88	15.20
69	002812	恩捷股份	2,109,493.52	15.19
70	300529	健帆生物	2,104,826.43	15.16
71	603939	益丰药房	2,100,820.28	15.13
72	002541	鸿路钢构	2,087,250.84	15.03
73	300763	锦浪科技	2,070,605.00	14.91
74	002352	顺丰控股	2,055,275.56	14.80
75	002706	良信股份	2,029,784.00	14.62
76	300724	捷佳伟创	2,028,652.65	14.61
77	000895	双汇发展	2,027,183.90	14.60
78	300124	汇川技术	2,011,294.00	14.49
79	300601	康泰生物	1,999,529.92	14.40
80	002821	凯莱英	1,988,608.00	14.32
81	603129	春风动力	1,981,391.00	14.27
82	603501	韦尔股份	1,980,120.90	14.26
83	603486	科沃斯	1,979,951.00	14.26

84	601818	光大银行	1,975,870.00	14.23
85	601899	紫金矿业	1,974,357.67	14.22
86	002601	龙蟠佰利	1,953,260.00	14.07
87	000651	格力电器	1,950,614.14	14.05
88	002409	雅克科技	1,936,553.00	13.95
89	600887	伊利股份	1,912,315.38	13.77
90	002027	分众传媒	1,897,123.61	13.66
91	603317	天味食品	1,888,259.32	13.60
92	688169	石头科技	1,867,987.31	13.45
93	002078	太阳纸业	1,863,521.51	13.42
94	300015	爱尔眼科	1,858,375.20	13.38
95	603185	上机数控	1,855,315.00	13.36
96	601336	新华保险	1,846,687.80	13.30
97	600690	海尔智家	1,812,944.77	13.06
98	000858	五粮液	1,793,830.00	12.92
99	600079	人福医药	1,791,131.60	12.90
100	600519	贵州茅台	1,785,265.00	12.86
101	601633	长城汽车	1,780,099.00	12.82
102	603198	迎驾贡酒	1,767,152.00	12.73
103	600196	复星医药	1,760,908.80	12.68
104	600529	山东药玻	1,756,505.00	12.65
105	300168	万达信息	1,750,262.24	12.61
106	600720	祁连山	1,747,491.53	12.59
107	002041	登海种业	1,744,789.40	12.57
108	002335	科华恒盛	1,720,184.10	12.39
109	000636	风华高科	1,719,107.00	12.38
110	600176	中国巨石	1,717,656.00	12.37
111	300450	先导智能	1,706,163.75	12.29
112	002371	北方华创	1,694,741.42	12.21
113	603517	绝味食品	1,674,987.00	12.06
114	603444	吉比特	1,657,091.39	11.93
115	601838	成都银行	1,650,609.00	11.89
116	000423	东阿阿胶	1,629,149.81	11.73
117	300769	德方纳米	1,612,594.00	11.61
118	002460	赣锋锂业	1,609,533.38	11.59
119	603298	杭叉集团	1,607,877.60	11.58
120	002332	仙琚制药	1,606,593.22	11.57
121	601966	玲珑轮胎	1,599,258.22	11.52

122	002129	中环股份	1, 590, 085. 00	11. 45
123	000625	长安汽车	1, 585, 570. 98	11. 42
124	603816	顾家家居	1, 574, 938. 30	11. 34
125	600660	福耀玻璃	1, 573, 734. 00	11. 33
126	002049	紫光国微	1, 564, 926. 19	11. 27
127	000951	中国重汽	1, 555, 271. 12	11. 20
128	300348	长亮科技	1, 553, 088. 91	11. 19
129	600741	华域汽车	1, 521, 153. 74	10. 96
130	600754	锦江酒店	1, 515, 804. 00	10. 92
131	002727	一心堂	1, 513, 514. 40	10. 90
132	300674	宇信科技	1, 506, 017. 80	10. 85
133	002773	康弘药业	1, 505, 065. 24	10. 84
134	000878	云南铜业	1, 487, 477. 69	10. 71
135	688111	金山办公	1, 482, 172. 90	10. 67
136	300188	美亚柏科	1, 471, 157. 20	10. 60
137	603195	公牛集团	1, 470, 364. 08	10. 59
138	300146	汤臣倍健	1, 464, 285. 00	10. 55
139	002493	荣盛石化	1, 462, 250. 88	10. 53
140	300595	欧普康视	1, 459, 280. 00	10. 51
141	688122	西部超导	1, 458, 677. 96	10. 51
142	603520	司太立	1, 457, 931. 00	10. 50
143	002851	麦格米特	1, 455, 555. 99	10. 48
144	603866	桃李面包	1, 448, 651. 00	10. 43
145	300623	捷捷微电	1, 438, 036. 00	10. 36
146	603712	七一二	1, 432, 837. 00	10. 32
147	000786	北新建材	1, 430, 750. 00	10. 30
148	300659	中孚信息	1, 430, 315. 40	10. 30
149	600588	用友网络	1, 428, 625. 85	10. 29
150	300316	晶盛机电	1, 418, 706. 28	10. 22
151	002643	万润股份	1, 408, 112. 63	10. 14
152	000877	天山股份	1, 401, 728. 18	10. 10
153	603799	华友钴业	1, 400, 393. 09	10. 09
154	600197	伊力特	1, 393, 827. 76	10. 04
155	002847	盐津铺子	1, 380, 209. 05	9. 94
156	603267	鸿远电子	1, 363, 068. 89	9. 82
157	300274	阳光电源	1, 360, 576. 00	9. 80
158	600600	青岛啤酒	1, 354, 104. 00	9. 75
159	002557	洽洽食品	1, 351, 728. 62	9. 74

160	000831	五矿稀土	1,350,742.00	9.73
161	603986	兆易创新	1,349,701.50	9.72
162	002918	蒙娜丽莎	1,341,983.33	9.67
163	688388	嘉元科技	1,336,585.39	9.63
164	688188	柏楚电子	1,334,066.25	9.61
165	300059	东方财富	1,330,059.63	9.58
166	603260	合盛硅业	1,327,274.00	9.56
167	002738	中矿资源	1,318,746.00	9.50
168	603993	洛阳钼业	1,309,073.48	9.43
169	002920	德赛西威	1,307,106.00	9.41
170	601628	中国人寿	1,302,679.00	9.38
171	002600	领益智造	1,302,058.00	9.38
172	300244	迪安诊断	1,299,776.36	9.36
173	000725	京东方 A	1,295,308.38	9.33
174	600559	老白干酒	1,294,200.00	9.32
175	600584	长电科技	1,281,218.16	9.23
176	300408	三环集团	1,280,345.75	9.22
177	300630	普利制药	1,268,246.35	9.13
178	002032	苏泊尔	1,262,790.00	9.09
179	300476	胜宏科技	1,259,494.99	9.07
180	603833	欧派家居	1,259,352.00	9.07
181	601066	中信建投	1,257,041.00	9.05
182	603369	今世缘	1,254,166.98	9.03
183	300502	新易盛	1,251,795.60	9.02
184	300866	安克创新	1,251,236.00	9.01
185	300496	中科创达	1,233,068.75	8.88
186	688333	铂力特	1,228,751.04	8.85
187	603806	福斯特	1,225,212.06	8.82
188	603319	湘油泵	1,222,858.00	8.81
189	300677	英科医疗	1,220,486.00	8.79
190	002258	利尔化学	1,217,047.41	8.77
191	603883	老百姓	1,216,113.90	8.76
192	000733	振华科技	1,214,402.70	8.75
193	688002	睿创微纳	1,212,639.17	8.73
194	600258	首旅酒店	1,207,353.00	8.70
195	300224	正海磁材	1,206,291.00	8.69
196	300775	三角防务	1,202,585.00	8.66
197	002572	索菲亚	1,199,695.08	8.64

198	600779	水井坊	1,193,243.00	8.59
199	300482	万孚生物	1,192,925.39	8.59
200	002675	东诚药业	1,190,592.91	8.57
201	300037	新宙邦	1,184,773.00	8.53
202	300676	华大基因	1,181,785.40	8.51
203	688012	中微公司	1,177,517.33	8.48
204	603035	常熟汽饰	1,173,720.20	8.45
205	603127	昭衍新药	1,173,580.20	8.45
206	601168	西部矿业	1,171,574.00	8.44
207	300054	鼎龙股份	1,164,853.00	8.39
208	600383	金地集团	1,163,895.75	8.38
209	300671	富满电子	1,162,865.00	8.37
210	600183	生益科技	1,157,699.98	8.34
211	300572	安车检测	1,155,027.00	8.32
212	002304	洋河股份	1,147,269.00	8.26
213	688363	华熙生物	1,143,327.06	8.23
214	605111	新洁能	1,140,347.22	8.21
215	300685	艾德生物	1,140,291.50	8.21
216	002236	大华股份	1,130,997.00	8.15
217	688399	硕世生物	1,129,947.90	8.14
218	300624	万兴科技	1,129,929.00	8.14
219	002648	卫星石化	1,115,909.64	8.04
220	600549	厦门钨业	1,111,476.44	8.00
221	601995	中金公司	1,103,052.00	7.94
222	000425	徐工机械	1,102,022.08	7.94
223	603658	安图生物	1,091,589.00	7.86
224	600739	辽宁成大	1,089,059.00	7.84
225	603378	亚士创能	1,086,476.00	7.82
226	601225	陕西煤业	1,083,984.00	7.81
227	688196	卓越新能	1,078,226.58	7.77
228	688185	康希诺	1,075,716.73	7.75
229	688019	安集科技	1,075,489.71	7.75
230	600711	盛屯矿业	1,075,488.60	7.75
231	601933	永辉超市	1,073,984.80	7.73
232	603236	移远通信	1,060,161.57	7.64
233	600837	海通证券	1,058,545.78	7.62
234	600988	赤峰黄金	1,055,679.28	7.60
235	002508	老板电器	1,051,673.52	7.57

236	300618	寒锐钴业	1,049,978.12	7.56
237	002555	三七互娱	1,049,364.00	7.56
238	300395	菲利华	1,047,562.39	7.54
239	600362	江西铜业	1,033,403.33	7.44
240	000612	焦作万方	1,030,057.60	7.42
241	300511	雪榕生物	1,029,590.26	7.42
242	002240	盛新锂能	1,029,577.00	7.42
243	002075	沙钢股份	1,028,589.54	7.41
244	300747	锐科激光	1,026,726.22	7.39
245	002791	坚朗五金	1,018,775.55	7.34
246	300373	扬杰科技	1,009,525.28	7.27
247	002050	三花智控	1,008,787.88	7.27
248	002007	华兰生物	1,005,798.40	7.24
249	603043	广州酒家	1,005,165.00	7.24
250	603489	八方股份	1,001,807.00	7.22
251	601100	恒立液压	1,000,392.62	7.20
252	300653	正海生物	988,541.50	7.12
253	688005	容百科技	982,433.54	7.08
254	300378	鼎捷软件	976,760.00	7.03
255	300702	天宇股份	976,384.00	7.03
256	000063	中兴通讯	972,758.58	7.01
257	688179	阿拉丁	972,691.97	7.01
258	300850	新强联	965,744.00	6.96
259	002074	国轩高科	958,045.00	6.90
260	002428	云南锗业	957,186.00	6.89
261	601088	中国神华	956,721.00	6.89
262	000938	紫光股份	955,160.12	6.88
263	300613	富瀚微	954,479.00	6.87
264	300792	壹网壹创	951,143.67	6.85
265	002311	海大集团	942,245.00	6.79
266	002876	三利谱	937,213.27	6.75
267	300258	精锻科技	937,017.00	6.75
268	002709	天赐材料	935,400.00	6.74
269	603233	大参林	935,076.80	6.73
270	000998	隆平高科	934,775.40	6.73
271	600060	海信视像	934,262.00	6.73
272	600305	恒顺醋业	931,501.00	6.71
273	600585	海螺水泥	930,256.55	6.70

274	688202	美迪西	928,531.18	6.69
275	300413	芒果超媒	924,774.60	6.66
276	688095	福昕软件	920,984.17	6.63
277	688200	华峰测控	912,020.37	6.57
278	002705	新宝股份	909,934.39	6.55
279	600885	宏发股份	909,350.00	6.55
280	002001	新和成	908,310.60	6.54
281	603308	应流股份	899,838.00	6.48
282	600511	国药股份	898,412.00	6.47
283	000830	鲁西化工	897,569.00	6.46
284	300386	飞天诚信	895,197.00	6.45
285	002415	海康威视	895,036.00	6.45
286	002466	天齐锂业	890,938.51	6.42
287	002607	中公教育	886,073.00	6.38
288	603583	捷昌驱动	883,966.00	6.37
289	300394	天孚通信	883,668.69	6.36
290	002384	东山精密	883,130.12	6.36
291	300369	绿盟科技	882,231.68	6.35
292	300815	玉禾田	879,914.00	6.34
293	600729	重庆百货	874,262.00	6.30
294	603678	火炬电子	873,250.00	6.29
295	002084	海鸥住工	869,120.90	6.26
296	300648	星云股份	868,892.00	6.26
297	300009	安科生物	867,783.00	6.25
298	002833	弘亚数控	867,114.00	6.24
299	601636	旗滨集团	864,382.00	6.23
300	603906	龙蟠科技	861,226.00	6.20
301	300575	中旗股份	860,345.00	6.20
302	002064	华峰氨纶	860,083.00	6.19
303	603881	数据港	858,759.00	6.18
304	600115	东方航空	854,425.00	6.15
305	600760	中航沈飞	853,931.00	6.15
306	000975	银泰黄金	851,290.95	6.13
307	300573	兴齐眼药	849,279.00	6.12
308	688390	固德威	847,515.67	6.10
309	603599	广信股份	847,007.00	6.10
310	000671	阳光城	844,696.67	6.08
311	300339	润和软件	840,212.00	6.05

312	600380	健康元	838,539.56	6.04
313	002281	光迅科技	833,158.13	6.00
314	601965	中国汽研	830,093.00	5.98
315	000807	云铝股份	824,556.00	5.94
316	603987	康德莱	824,414.00	5.94
317	688229	博睿数据	823,924.39	5.93
318	688008	澜起科技	818,925.56	5.90
319	002635	安洁科技	816,408.11	5.88
320	603995	甬金股份	815,322.00	5.87
321	002798	帝欧家居	814,701.54	5.87
322	000739	普洛药业	814,100.30	5.86
323	688157	松井股份	810,310.12	5.84
324	300088	长信科技	809,987.00	5.83
325	002250	联化科技	809,051.00	5.83
326	603179	新泉股份	808,818.32	5.83
327	002677	浙江美大	808,500.00	5.82
328	000783	长江证券	807,047.00	5.81
329	688036	传音控股	806,634.35	5.81
330	600547	山东黄金	804,821.25	5.80
331	601799	星宇股份	803,587.00	5.79
332	300383	光环新网	801,455.00	5.77
333	603718	海利生物	800,006.00	5.76
334	300003	乐普医疗	795,611.00	5.73
335	000513	丽珠集团	795,335.24	5.73
336	600563	法拉电子	789,148.00	5.68
337	600267	海正药业	786,470.71	5.66
338	688396	华润微	785,678.38	5.66
339	600606	绿地控股	784,500.00	5.65
340	300666	江丰电子	779,261.29	5.61
341	688536	思瑞浦	778,655.99	5.61
342	688126	沪硅产业	775,245.08	5.58
343	002912	中新赛克	774,621.06	5.58
344	688298	东方生物	772,679.26	5.56
345	600926	杭州银行	769,490.00	5.54
346	002985	北摩高科	769,455.00	5.54
347	300357	我武生物	767,726.00	5.53
348	600426	华鲁恒升	766,173.00	5.52
349	002938	鹏鼎控股	763,014.00	5.50

350	300777	中简科技	762,818.00	5.49
351	000581	威孚高科	759,308.00	5.47
352	601108	财通证券	751,913.00	5.42
353	000710	贝瑞基因	747,937.00	5.39
354	601009	南京银行	746,854.00	5.38
355	000338	潍柴动力	746,182.00	5.37
356	600900	长江电力	746,070.00	5.37
357	688366	昊海生科	743,075.29	5.35
358	600055	万东医疗	741,871.96	5.34
359	000902	新洋丰	739,505.00	5.33
360	300999	金龙鱼	737,971.00	5.31
361	688017	绿的谐波	736,210.50	5.30
362	300115	长盈精密	734,066.16	5.29
363	600030	中信证券	731,744.50	5.27
364	300776	帝尔激光	731,124.00	5.27
365	600745	闻泰科技	727,309.18	5.24
366	002023	海特高新	726,352.00	5.23
367	000021	深科技	720,019.64	5.19
368	002019	亿帆医药	716,677.02	5.16
369	002008	大族激光	716,347.01	5.16
370	300438	鹏辉能源	713,503.00	5.14
371	300010	豆神教育	712,593.95	5.13
372	601021	春秋航空	711,853.71	5.13
373	300888	稳健医疗	710,522.00	5.12
374	600089	特变电工	710,275.00	5.12
375	601233	桐昆股份	709,445.00	5.11
376	002317	众生药业	707,961.96	5.10
377	300706	阿石创	693,313.14	4.99
378	300642	透景生命	693,292.00	4.99
379	600460	士兰微	693,044.00	4.99
380	603313	梦百合	692,014.00	4.98
381	600109	国金证券	687,031.00	4.95
382	000933	神火股份	685,641.00	4.94
383	603707	健友股份	684,856.18	4.93
384	603018	华设集团	684,195.77	4.93
385	600598	北大荒	684,138.00	4.93
386	300806	斯迪克	680,925.56	4.90
387	603533	掌阅科技	679,962.40	4.90

388	300680	隆盛科技	679,033.00	4.89
389	002216	三全食品	676,637.60	4.87
390	002367	康力电梯	674,914.28	4.86
391	000876	新希望	674,879.00	4.86
392	600346	恒力石化	674,406.00	4.86
393	688016	心脉医疗	674,068.87	4.85
394	300481	濮阳惠成	673,720.39	4.85
395	300816	艾可蓝	673,150.00	4.85
396	600801	华新水泥	670,154.00	4.83
397	688088	虹软科技	667,691.35	4.81
398	601111	中国国航	667,656.00	4.81
399	300604	长川科技	666,162.00	4.80
400	300326	凯利泰	664,148.75	4.78
401	603697	有友食品	662,556.00	4.77
402	688099	晶晨股份	657,879.58	4.74
403	688386	泛亚微透	657,654.46	4.74
404	002245	蔚蓝锂芯	654,853.00	4.72
405	002556	辉隆股份	651,322.00	4.69
406	300236	上海新阳	650,545.00	4.69
407	002180	纳思达	647,858.15	4.67
408	300783	三只松鼠	647,370.00	4.66
409	603920	世运电路	647,118.00	4.66
410	601952	苏垦农发	644,840.00	4.64
411	601865	福莱特	644,155.00	4.64
412	600886	国投电力	642,039.00	4.62
413	002756	永兴材料	642,034.00	4.62
414	688981	中芯国际	639,647.16	4.61
415	002982	湘佳股份	638,205.00	4.60
416	002044	美年健康	633,697.72	4.56
417	002905	金逸影视	633,325.00	4.56
418	600456	宝钛股份	632,233.00	4.55
419	000887	中鼎股份	630,083.00	4.54
420	300869	康泰医学	629,920.00	4.54
421	688023	安恒信息	627,567.63	4.52
422	600933	爱柯迪	627,380.00	4.52
423	002831	裕同科技	626,822.30	4.51
424	300825	阿尔特	626,717.00	4.51
425	002850	科达利	624,483.44	4.50

426	002810	山东赫达	623,940.00	4.49
427	002745	木林森	623,556.00	4.49
428	601919	中远海控	622,143.00	4.48
429	002194	武汉凡谷	618,954.00	4.46
430	300633	开立医疗	616,305.00	4.44
431	688268	华特气体	616,020.85	4.44
432	002707	众信旅游	613,480.00	4.42
433	002152	广电运通	611,969.38	4.41
434	300568	星源材质	611,885.30	4.41
435	000768	中航西飞	611,041.00	4.40
436	002993	奥海科技	608,385.40	4.38
437	300451	创业慧康	604,167.76	4.35
438	300142	沃森生物	602,880.00	4.34
439	002262	恩华药业	599,931.00	4.32
440	600201	生物股份	596,884.00	4.30
441	300638	广和通	594,711.00	4.28
442	300558	贝达药业	594,009.66	4.28
443	603208	江山欧派	592,222.00	4.27
444	000039	中集集团	588,588.00	4.24
445	300151	昌红科技	587,878.00	4.23
446	600699	均胜电子	587,277.92	4.23
447	000977	浪潮信息	585,504.06	4.22
448	000869	张裕 A	585,120.00	4.21
449	300418	昆仑万维	583,532.00	4.20
450	603612	索通发展	582,800.00	4.20
451	603708	家家悦	580,199.00	4.18
452	002777	久远银海	579,199.92	4.17
453	002970	锐明技术	578,995.00	4.17
454	002796	世嘉科技	577,477.00	4.16
455	603826	坤彩科技	575,729.60	4.15
456	603605	珀莱雅	572,572.84	4.12
457	300223	北京君正	572,471.00	4.12
458	300896	爱美客	571,155.60	4.11
459	688029	南微医学	571,101.30	4.11
460	300447	全信股份	570,546.00	4.11
461	002230	科大讯飞	567,683.00	4.09
462	300829	金丹科技	564,189.00	4.06
463	603801	志邦家居	563,411.00	4.06

464	603429	集友股份	558,395.80	4.02
465	002233	塔牌集团	556,014.58	4.00
466	002273	水晶光电	555,717.79	4.00
467	601668	中国建筑	554,008.00	3.99
468	603019	中科曙光	553,314.49	3.98
469	300590	移为通信	551,607.68	3.97
470	603337	杰克股份	549,781.95	3.96
471	601238	广汽集团	548,003.00	3.95
472	300033	同花顺	546,773.98	3.94
473	002405	四维图新	545,064.78	3.93
474	603156	养元饮品	544,521.00	3.92
475	605358	立昂微	543,105.70	3.91
476	600989	宝丰能源	542,345.00	3.91
477	688567	孚能科技	541,671.59	3.90
478	300639	凯普生物	537,919.54	3.87
479	300390	天华超净	537,397.00	3.87
480	300755	华致酒行	533,298.00	3.84
481	600195	中牧股份	533,074.00	3.84
482	002318	久立特材	532,145.99	3.83
483	002518	科士达	532,054.70	3.83
484	603466	风语筑	529,845.00	3.82
485	002396	星网锐捷	529,388.24	3.81
486	002223	鱼跃医疗	528,208.32	3.80
487	688116	天奈科技	526,769.23	3.79
488	002385	大北农	525,374.97	3.78
489	600641	万业企业	523,975.00	3.77
490	603186	华正新材	520,501.69	3.75
491	603868	飞科电器	520,173.00	3.75
492	688598	金博股份	519,885.20	3.74
493	603596	伯特利	517,832.00	3.73
494	601717	郑煤机	516,998.00	3.72
495	603005	晶方科技	515,936.70	3.72
496	600415	小商品城	515,193.00	3.71
497	605009	豪悦护理	512,416.00	3.69
498	603113	金能科技	510,824.15	3.68
499	601658	邮储银行	507,319.95	3.65
500	002949	华阳国际	505,918.00	3.64
501	002043	兔宝宝	505,504.19	3.64

502	603393	新天然气	505,358.78	3.64
503	688339	亿华通	505,024.50	3.64
504	603225	新凤鸣	503,516.00	3.63
505	300034	钢研高纳	499,561.00	3.60
506	300733	西菱动力	496,181.00	3.57
507	300525	博思软件	492,564.00	3.55
508	300738	奥飞数据	492,494.00	3.55
509	688288	鸿泉物联	492,259.60	3.55
510	002497	雅化集团	490,438.00	3.53
511	300617	安靠智电	490,051.00	3.53
512	688222	成都先导	488,263.51	3.52
513	002353	杰瑞股份	487,094.00	3.51
514	688368	晶丰明源	486,461.23	3.50
515	002597	金禾实业	483,504.40	3.48
516	600315	上海家化	482,790.00	3.48
517	688561	奇安信	482,617.49	3.48
518	002407	多氟多	481,716.00	3.47
519	600206	有研新材	481,140.99	3.47
520	603650	彤程新材	479,598.00	3.45
521	688180	君实生物	476,195.07	3.43
522	300788	中信出版	475,720.00	3.43
523	300253	卫宁健康	474,960.69	3.42
524	688189	南新制药	474,428.35	3.42
525	003011	海象新材	473,341.00	3.41
526	688301	奕瑞科技	472,066.16	3.40
527	002916	深南电路	468,594.00	3.37
528	300113	顺网科技	466,647.79	3.36
529	002990	盛视科技	466,219.00	3.36
530	601601	中国太保	465,829.00	3.35
531	600050	中国联通	465,287.85	3.35
532	300673	佩蒂股份	465,101.00	3.35
533	002739	万达电影	463,706.00	3.34
534	300226	上海钢联	463,302.14	3.34
535	002891	中宠股份	461,795.00	3.33
536	002481	双塔食品	460,230.00	3.31
537	600392	盛和资源	459,609.00	3.31
538	300082	奥克股份	459,125.00	3.31
539	002956	西麦食品	456,816.00	3.29

540	601698	中国卫通	450,579.00	3.25
541	002081	金螳螂	450,238.00	3.24
542	002461	珠江啤酒	448,635.00	3.23
543	688139	海尔生物	448,315.91	3.23
544	300811	铂科新材	447,601.00	3.22
545	688006	杭可科技	447,490.47	3.22
546	300323	华灿光电	447,145.00	3.22
547	603888	新华网	446,858.03	3.22
548	002967	广电计量	446,107.40	3.21
549	002459	晶澳科技	445,042.00	3.21
550	002368	太极股份	443,449.55	3.19
551	603348	文灿股份	443,080.00	3.19
552	002732	燕塘乳业	442,873.00	3.19
553	002013	中航机电	441,498.00	3.18
554	603515	欧普照明	441,487.86	3.18
555	002653	海思科	441,151.24	3.18
556	600562	国睿科技	440,647.00	3.17
557	600507	方大特钢	440,393.00	3.17
558	002981	朝阳科技	439,652.00	3.17
559	000997	新大陆	439,590.00	3.17
560	300212	易华录	437,218.11	3.15
561	000066	中国长城	435,169.39	3.13
562	600352	浙江龙盛	433,081.00	3.12
563	300458	全志科技	428,587.00	3.09
564	603626	科森科技	428,445.00	3.09
565	600449	宁夏建材	427,914.00	3.08
566	000703	恒逸石化	426,840.00	3.07
567	000708	中信特钢	426,591.00	3.07
568	688516	奥特维	426,403.68	3.07
569	603083	剑桥科技	424,252.96	3.06
570	603087	甘李药业	423,194.00	3.05
571	300596	利安隆	422,829.68	3.05
572	603027	千禾味业	421,839.00	3.04
573	600118	中国卫星	419,915.00	3.02
574	603078	江化微	415,579.32	2.99
575	000932	华菱钢铁	413,765.00	2.98
576	002444	巨星科技	411,775.97	2.97
577	600861	北京城乡	411,576.00	2.96

578	603686	龙马环卫	409,750.00	2.95
579	000921	海信家电	409,262.00	2.95
580	300552	万集科技	408,710.50	2.94
581	601689	拓普集团	408,235.00	2.94
582	603218	日月股份	408,204.00	2.94
583	300315	掌趣科技	404,563.45	2.91
584	300610	晨化股份	404,201.00	2.91
585	300598	诚迈科技	403,754.00	2.91
586	300893	松原股份	403,220.84	2.90
587	603733	仙鹤股份	402,741.00	2.90
588	300773	拉卡拉	396,228.79	2.85
589	300726	宏达电子	396,033.00	2.85
590	600674	川投能源	395,013.00	2.84
591	300138	晨光生物	393,223.00	2.83
592	000910	大亚圣象	390,010.00	2.81
593	002063	远光软件	385,447.00	2.78
594	300791	仙乐健康	385,067.00	2.77
595	600037	歌华有线	384,647.00	2.77
596	002429	兆驰股份	384,390.00	2.77
597	002897	意华股份	384,105.00	2.77
598	603039	泛微网络	382,489.00	2.75
599	601128	常熟银行	378,255.00	2.72
600	002410	广联达	377,806.00	2.72
601	002624	完美世界	377,802.00	2.72
602	300327	中颖电子	375,819.83	2.71
603	605099	共创草坪	369,277.80	2.66
604	000776	广发证券	368,245.00	2.65
605	605338	巴比食品	367,838.00	2.65
606	600323	瀚蓝环境	366,909.00	2.64
607	603916	苏博特	365,212.00	2.63
608	605123	派克新材	364,799.95	2.63
609	300832	新产业	364,044.00	2.62
610	300567	精测电子	363,686.03	2.62
611	688357	建龙微纳	360,984.50	2.60
612	603713	密尔克卫	360,605.00	2.60
613	603566	普莱柯	359,809.00	2.59
614	000717	韶钢松山	359,702.00	2.59
615	600395	盘江股份	359,677.00	2.59

616	002179	中航光电	359,634.00	2.59
617	600893	航发动力	359,624.00	2.59
618	600731	湖南海利	359,226.00	2.59
619	600850	华东电脑	358,920.00	2.58
620	603777	来伊份	356,894.00	2.57
621	300296	利亚德	354,090.00	2.55
622	603730	岱美股份	353,970.00	2.55
623	601808	中海油服	353,353.00	2.54
624	601872	招商轮船	349,730.00	2.52
625	300012	华测检测	349,522.00	2.52
626	300233	金城医药	348,294.96	2.51
627	003017	大洋生物	347,250.00	2.50
628	002859	洁美科技	346,898.00	2.50
629	002690	美亚光电	346,418.64	2.49
630	300616	尚品宅配	346,209.00	2.49
631	600740	山西焦化	345,295.00	2.49
632	000988	华工科技	345,080.66	2.49
633	300824	北鼎股份	342,501.00	2.47
634	600223	鲁商发展	342,275.00	2.47
635	000426	兴业矿业	340,295.00	2.45
636	000401	冀东水泥	339,884.87	2.45
637	300182	捷成股份	337,655.00	2.43
638	688266	泽璟制药	337,341.79	2.43
639	002373	千方科技	335,930.28	2.42
640	603305	旭升股份	335,078.07	2.41
641	688051	佳华科技	334,485.68	2.41
642	603180	金牌厨柜	333,594.60	2.40
643	002372	伟星新材	333,492.00	2.40
644	688027	国盾量子	331,257.70	2.39
645	600298	安琪酵母	330,889.75	2.38
646	600702	ST 舍得	330,688.00	2.38
647	300452	山河药辅	328,840.70	2.37
648	600066	宇通客车	328,273.00	2.36
649	603100	川仪股份	326,998.00	2.36
650	603131	上海沪工	326,690.00	2.35
651	603063	禾望电气	326,066.00	2.35
652	600166	福田汽车	325,829.00	2.35
653	300463	迈克生物	322,733.00	2.32

654	688089	嘉必优	321,769.25	2.32
655	600363	联创光电	319,032.00	2.30
656	300770	新媒股份	318,659.00	2.29
657	688356	键凯科技	316,379.66	2.28
658	603086	先达股份	316,265.00	2.28
659	688311	盟升电子	314,752.07	2.27
660	603060	国检集团	312,965.00	2.25
661	300036	超图软件	312,660.67	2.25
662	300607	拓斯达	308,647.00	2.22
663	002293	罗莱生活	308,452.00	2.22
664	600019	宝钢股份	308,313.00	2.22
665	300427	红相股份	306,384.00	2.21
666	300121	阳谷华泰	304,213.00	2.19
667	300001	特锐德	303,958.00	2.19
668	600216	浙江医药	303,943.00	2.19
669	603505	金石资源	302,695.00	2.18
670	603690	至纯科技	302,612.59	2.18
671	603338	浙江鼎力	302,051.00	2.18
672	300484	蓝海华腾	300,247.00	2.16
673	000400	许继电气	299,832.00	2.16
674	688118	普元信息	299,788.34	2.16
675	300073	当升科技	299,431.00	2.16
676	600765	中航重机	297,919.00	2.15
677	002382	蓝帆医疗	296,755.00	2.14
678	002299	圣农发展	296,125.00	2.13
679	601618	中国中冶	296,018.00	2.13
680	601390	中国中铁	295,074.00	2.13
681	600068	葛洲坝	294,815.74	2.12
682	603989	艾华集团	289,783.00	2.09
683	603392	万泰生物	289,373.00	2.08
684	002389	航天彩虹	285,407.00	2.06
685	300101	振芯科技	282,121.00	2.03
686	600029	南方航空	281,424.00	2.03
687	300271	华宇软件	280,855.00	2.02
688	688300	联瑞新材	280,496.98	2.02
689	300144	宋城演艺	279,724.00	2.01
690	603728	鸣志电器	279,450.00	2.01

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	784,629,732.77
卖出股票收入（成交）总额	763,898,370.62

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	2,596,740.30	4.91
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,596,740.30	4.91

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019627	20 国债 01	25,970	2,596,740.30	4.91

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

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
----	----	----------	---------	-----------	------

-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					0.00
股指期货投资本期收益（元）					0.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					0.00

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

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调查以及处罚的情况的说明

无。

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

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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	54,175.66
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	57,730.18
5	应收申购款	69,584.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	181,490.49

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 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

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
2,847	11,517.78	14,708,114.60	44.85%	18,083,001.81	55.15%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	102,445.24	0.31%

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的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

无。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2015 年 5 月 25 日 ）基金份额总额	996,360,866.50
本报告期期初基金份额总额	13,857,442.92
本报告期基金总申购份额	50,573,837.53
减:本报告期基金总赎回份额	31,640,164.04
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	32,791,116.41

§ 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 2021 年 3 月 17 日公告, 张贵云先生担任公司总经理, 张力先生不再担任公司总经理。

(2) 报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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 2018 年 1 月 1 日起聘请德勤华永会计师事务所(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 36885.30 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

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

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位: 人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
长江证券	1	394,763,948.66	25.50%	288,691.59	24.38%	-
东方财富证 券	2	390,347,818.57	25.22%	285,462.37	24.11%	本期新增
东北证券	2	335,701,675.00	21.69%	245,499.11	20.74%	本期新增

广发证券	2	259,957,575.15	16.79%	242,099.45	20.45%	—
海通证券	2	96,796,774.17	6.25%	70,787.85	5.98%	—
华福证券	2	70,306,933.96	4.54%	51,415.49	4.34%	—
中泰证券	2	—	—	—	—	—
平安证券	2	—	—	—	—	—
川财证券	2	—	—	—	—	—
方正证券	2	—	—	—	—	—
中投证券	2	—	—	—	—	—
国泰君安证 券	2	—	—	—	—	—
华安证券	2	—	—	—	—	本期新增

注：基金租用证券公司交易单元的选择标准是：

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

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例
长江证券	4,389,383.00	76.41%	9,500,000.00	100.00%	—	—
东方财富证 券	461,663.46	8.04%	—	—	—	—

东北证券	489,147.49	8.52%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	404,188.85	7.04%	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证 券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	兴银基金管理有限责任公司旗下部分基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报	2020 年 1 月 18 日
2	兴银鼎新灵活配置混合型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	指定网站	2020 年 1 月 18 日
3	兴银基金管理有限责任公司关于推迟披露旗下基金 2019 年年度报告的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、指定网站	2020 年 3 月 25 日
4	关于旗下基金参与盈米基金费率优惠活动并开通定期定额投资的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、指定网站	2020 年 4 月 10 日
5	兴银基金管理有限责任公司旗下部分基金 2020 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	2020 年 4 月 22 日

6	兴银鼎新灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	指定网站	2020 年 4 月 22 日
7	兴银基金管理有限责任公司旗下部分基金 2019 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	2020 年 4 月 29 日
8	兴银鼎新灵活配置混合型证券投资基金 2019 年年度报告	指定网站	2020 年 4 月 29 日
9	关于《兴银鼎新灵活配置混合型证券投资基金 2019 年年度报告》的更正公告	证券时报、指定网站	2020 年 4 月 30 日
10	兴银鼎新灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2020 年第 1 号）	指定网站	2020 年 5 月 23 日
11	兴银鼎新灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2020 年第 1 号）	证券时报、指定网站	2020 年 5 月 23 日
12	关于旗下基金参与申万宏源和申万宏源西部申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、指定网站	2020 年 6 月 19 日
13	兴银鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	证券时报、指定网站	2020 年 6 月 22 日
14	兴银鼎新灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 2 季度报告	指定网站	2020 年 7 月 21 日
15	兴银基金管理有限责任公司旗下部分基金 2020 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	2020 年 7 月 21 日
16	兴银鼎新灵活配置混合型证券投资基金 2020 年中期报告	指定网站	2020 年 8 月 29 日
17	兴银基金管理有限责任公司旗下	上海证券报、证券日报	2020 年 8 月 29 日

	部分基金 2020 半年度报告提示性公告	报、证券时报、中国证券报	
18	兴银鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要	指定网站、中数平台	2020 年 9 月 1 日
19	关于旗下基金参与招赢通平台费率优惠活动的公告	上海证券报、证券时报、证券日报、中国证券报、指定网站	2020 年 9 月 29 日
20	关于旗下基金参与海通证券费率优惠活动并开通定期定额投资的公告	上海证券报、证券时报、证券日报、中国证券报、指定网站	2020 年 10 月 23 日
21	兴银鼎新灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 3 季度报告	指定网站	2020 年 10 月 27 日
22	兴银基金管理有限责任公司旗下部分基金 2020 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	2020 年 10 月 27 日
23	兴银基金管理有限责任公司关于住所变更的公告	上海证券报、证券时报、证券日报、中国证券报、指定网站	2020 年 12 月 9 日

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20200221-20201021;20201106-20201126	0.00	6,041,181.56	0.00	6,041,181.56	18.42%
	2	20201127-20201231	0.00	8,666,933.04	0.00	8,666,933.04	26.43%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
(1) 赎回申请延缓支付的风险 上述高占比投资者大额赎回时易构成本基金巨额赎回，中小投资者可能面临小额赎回申请也需要与该等投资者按同比例延缓支付的风险。 (2) 基金净值大幅波动的风险 上述高占比投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。 (3) 基金规模过小导致的风险 上述高占比投资者赎回后，可能导致基金规模过小。基金可能面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，实现基金投资目标存在一定的不确定性。							

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鼎新灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件
2. 《兴银鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
3. 《兴银鼎新灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
4. 《兴银鼎新灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照
6. 报告期内在指定信息披露媒体上公开披露的各项公告

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

兴银基金管理有限责任公司

2021 年 3 月 31 日