

# 兴银科技增长 1 个月滚动持有期混合型证 券投资基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：兴银基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b>                       | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b>                          | <b>6</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 6         |
| 2.2 基金产品说明                              | 6         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式                              | 7         |
| 2.5 其他相关资料                              | 7         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>                 | <b>8</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 8         |
| 3.2 基金净值表现                              | 8         |
| 3.3 其他指标                                | 10        |
| <b>§4 管理人报告</b>                         | <b>11</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 11        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 13        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 13        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 13        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 14        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 14        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 15        |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 15        |
| <b>§5 托管人报告</b>                         | <b>16</b> |
| 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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 16        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>               | <b>17</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 17        |
| 6.2 利润表                                 | 18        |

|                                             |           |
|---------------------------------------------|-----------|
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....                    | 19        |
| 6.4 报表附注 .....                              | 20        |
| <b>§7 投资组合报告 .....</b>                      | <b>48</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况 .....                        | 48        |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....                    | 48        |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....     | 49        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                   | 51        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                  | 53        |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....    | 53        |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 ..... | 53        |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 ..... | 53        |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....    | 54        |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....             | 54        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 54        |
| 7.12 投资组合报告附注 .....                         | 54        |
| <b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>                   | <b>56</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 56        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 56        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....     | 56        |
| <b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>                   | <b>58</b> |
| <b>§10 重大事件揭示 .....</b>                     | <b>59</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 59        |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....      | 59        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 59        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 59        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 59        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....         | 59        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 59        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 60        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>             | <b>61</b> |

|                                          |           |
|------------------------------------------|-----------|
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 ..... | 61        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                | 61        |
| <b>§12 备查文件目录.....</b>                   | <b>62</b> |
| 12.1 备查文件目录.....                         | 62        |
| 12.2 存放地点.....                           | 62        |
| 12.3 查阅方式.....                           | 62        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                           |                     |
|-----------------|---------------------------|---------------------|
| 基金名称            | 兴银科技增长 1 个月滚动持有期混合型证券投资基金 |                     |
| 基金简称            | 兴银科技增长 1 个月滚动持有混合         |                     |
| 场内简称            | -                         |                     |
| 基金主代码           | 010925                    |                     |
| 基金运作方式          | 契约型开放式                    |                     |
| 基金合同生效日         | 2021 年 2 月 18 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      | 734,696,315.98 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            | -                         |                     |
| 下属分级基金的基金简称:    | 兴银科技增长 1 个月滚动持有混合 A       | 兴银科技增长 1 个月滚动持有混合 C |
| 下属分级基金场内简称:     | -                         | -                   |
| 下属分级基金的交易代码:    | 010925                    | 010926              |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 651,319,963.73 份          | 83,376,352.25 份     |

### 2.2 基金产品说明

|               |                                                                                                                        |                     |
|---------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------|
| 投资目标          | 本基金通过研究挖掘科技增长主题的上市公司，把握相关领域科技发展与创新所带来的投资机会，分享其在中国经济创新驱动发展的大背景下的可持续性增长，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产超越业绩比较标准的长期稳定增值。             |                     |
| 投资策略          | 本基金在资产配置上采取相对稳健的策略，采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，根据各类资产不同的预期风险收益比来确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。 |                     |
| 业绩比较基准        | 中国战略新兴产业成份指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%                                                                                     |                     |
| 风险收益特征        | 本基金为混合型证券投资基金，其预期风险与预期收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。                                                                      |                     |
|               | 兴银科技增长 1 个月滚动持有混合 A                                                                                                    | 兴银科技增长 1 个月滚动持有混合 C |
| 下属分级基金的风险收益特征 | 风险收益特征同上。                                                                                                              | 风险收益特征同上。           |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | 基金管理人 | 基金托管人 |
|----|-------|-------|
|----|-------|-------|

|         |      |                                     |                       |
|---------|------|-------------------------------------|-----------------------|
| 名称      |      | 兴银基金管理有限责任公司                        | 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    |      | 上海市浦东新区滨江大道 5129 号陆家嘴滨江中心 N1 幢三层、五层 | 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                                 | 吕家进                   |

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

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

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 基金级别          | 兴银科技增长 1 个月滚动持有混合 A                    | 兴银科技增长 1 个月滚动持有混合 C                    |
|---------------|----------------------------------------|----------------------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2021 年 2 月 18 日 - 2021 年 6 月 30 日) | 报告期(2021 年 2 月 18 日 - 2021 年 6 月 30 日) |
| 本期已实现收益       | -37,861,193.54                         | -6,689,336.92                          |
| 本期利润          | 132,969,448.45                         | 16,646,693.17                          |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.1713                                 | 0.1366                                 |
| 本期加权平均净值利润率   | 17.48%                                 | 13.97%                                 |
| 本期基金份额净值增长率   | 20.27%                                 | 20.06%                                 |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2021 年 6 月 30 日)                  |                                        |
| 期末可供分配利润      | -28,899,982.99                         | -3,842,704.95                          |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.0444                                | -0.0461                                |
| 期末基金资产净值      | 783,324,380.69                         | 100,098,525.41                         |
| 期末基金份额净值      | 1.2027                                 | 1.2006                                 |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2021 年 6 月 30 日)                  |                                        |
| 基金份额累计净值增长率   | 20.27%                                 | 20.06%                                 |

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴银科技增长 1 个月滚动持有混合 A

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月      | 19.65%   | 2.14%       | 3.77%      | 1.12%         | 15.88% | 1.02%  |
| 过去三个月      | 24.79%   | 1.48%       | 15.97%     | 1.21%         | 8.82%  | 0.27%  |
| 自基金合同生效起至今 | 20.27%   | 1.26%       | -4.45%     | 1.58%         | 24.72% | -0.32% |

兴银科技增长 1 个月滚动持有混合 C

| 阶段    | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④   |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | 19.59%   | 2.14%       | 3.77%      | 1.12%         | 15.82% | 1.02% |
| 过去三个月 | 24.61%   | 1.48%       | 15.97%     | 1.21%         | 8.64%  | 0.27% |

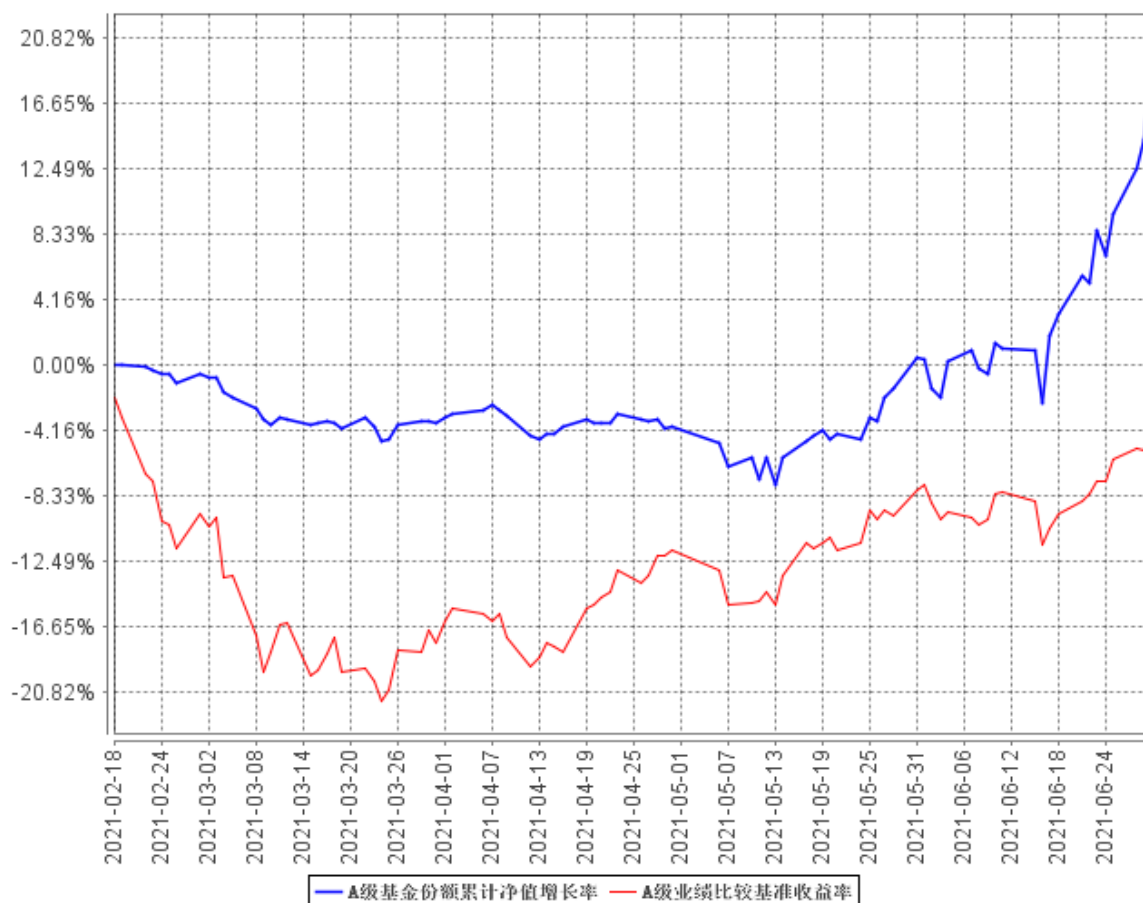
|                |        |       |        |       |        |        |
|----------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 自基金合同<br>生效起至今 | 20.06% | 1.26% | -4.45% | 1.58% | 24.51% | -0.32% |
|----------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|

注：1、本基金成立于 2021 年 2 月 18 日。

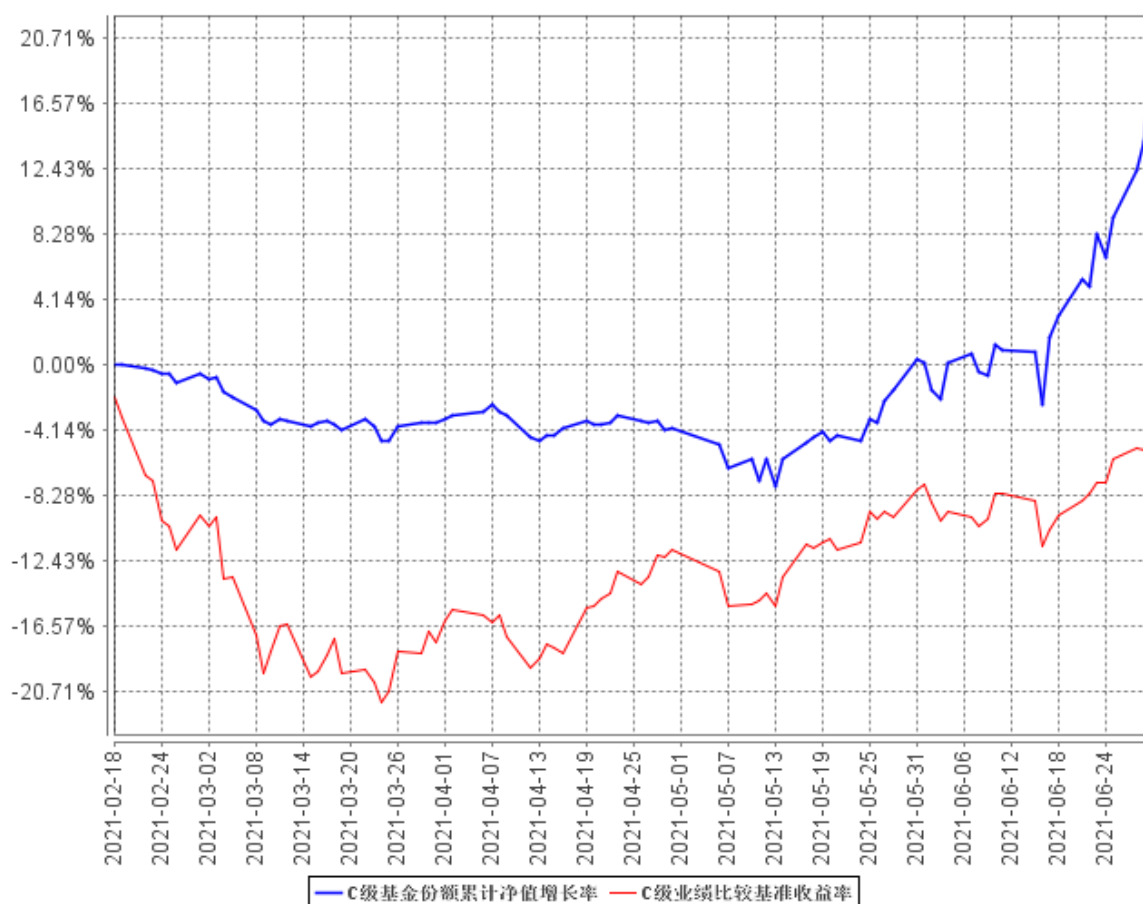
2、比较基准为：中国战略新兴产业成份指数收益率\*80%+中证综合债指数收益率\*20%

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金成立于 2021 年 2 月 18 日。

2、比较基准为：中国战略新兴产业成份指数收益率\*80%+中证综合债指数收益率\*20%

### 3.3 其他指标

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至报告期末，本公司管理 38 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 年中高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、兴银科技增长 1 个月滚动持有期混合型证券投资基金、兴银中证 500 指数增强型证券投资基金、兴银高端制造混合型证券投资基金、兴银稳安 60 天滚动持有债券型发起式证券投资基金），净值总规模超 550 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  | 权益投资总监 | 2021 年 2 月 18 日 | -    | 14     | 曾任职于光大保德信基金管理、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。2021 年 2 月起任兴银科技增长 1 个月滚动持有期混合型证券投资基金基金经理。 |
| 张世略 | 基金经理   | 2021 年 2 月 18 日 | -    | 5      | 硕士研究生，拥有 4 年基金行业工作经验。历任兴银基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理。现任兴银基金管理有限责任公司研究发展部基金经                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |

|  |  |  |  |  |                                                                               |
|--|--|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 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。2021 年 2 月起任兴银科技增长 1 个月滚动持有期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。

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。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人按照法律法规关于公平交易的相关规定，严格执行公司公平交易管理制度，加强了对所管理的不同投资组合向交易价差的分析，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 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 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

本产品主要投资策略为选择中长期趋势性产业机会作为主赛道，重点关注优势行业与核心资产，通过“高胜率”与“性价比”来实现净值下行低波动性，以“产业趋势”与“竞争优势”寻求净值上行弹性，同时规避盲目追逐市场主题炒作、长期逻辑容易证伪的公司。希望通过组合内部风险控制、不断优化模型的风险收益比平衡，通过风格相对均衡的方式获得组合稳健的业绩表现。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末兴银科技增长 1 个月滚动持有混合 A 基金份额净值为 1.2027 元，本报告期基金份额净值增长率为 20.27%；截至本报告期末兴银科技增长 1 个月滚动持有混合 C 基金份额净值

为 1.2006 元，本报告期基金份额净值增长率为 20.06%；同期业绩比较基准收益率为-4.45%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

站在当下时间点展望长期，我们能够看到未来中国将会继续呈现出颇具韧性的经济增长，但是相比于 21 世纪最初十年的高速增长，中国的经济增长也将进入一个“常态化”的增速区间，相较于过去有所回落。但是未来中国的发展将是轻增速重质量的发展，传统行业为中国提供扎实的经济基础，而新兴产业会在未来十年中快速发展，引领中国经济转型，推动中国经济发展。

展望下半年，美国新一轮的财政刺激仍在推进过程中，同时伴随疫苗接种的进展顺利，欧美经济有望步入强劲的疫后复苏期，这仍将支撑国内的出口一段时间；短期来看，通胀上行压力暂未对货币政策和流动性形成影响。国内，政策基调仍是以稳为主，“不急转弯”，预计国内经济仍处于扩张窗口期；后续需要关注地产终端需求走弱迹象，整体信用扩张周期是否出现明显拐点。权益市场方面，我们认为阶段性的流动性宽松窗口期不意味着全年政策回收的方向变化；但考虑到国内外整体货币政策基调并未进一步收紧，且全球经济复苏前景良好，市场仍存在结构性的做多机会。

我们认为，从中长期来看，A 股市场向上的动力仍然是存在的。在需求层面，我们观察到流动性总量充裕，市场增量资金不断流入。在供给层面，优质公司不断呈现，在中长期提供了特别好的投资机会。在全球成长最快的经济体，在居民资产重新配置的新形势下，我们预计权益资产仍然是未来的最优配置资产。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

根据证监会的相关规定，本公司为建立健全有效的估值政策和程序，成立估值小组，明确参与估值流程各方的人员分工和职责。估值小组组长由分管基金事务部的公司领导担任，成员由基金事务部、合规与风险管理部、研究发展部、权益投资部/固定收益部（视会议议题内容选择相关投资方向部门）部门负责人组成。估值小组成员具备应有的经验、专业胜任能力和独立性，分工明确，在上市公司研究和估值、基金投资、投资品种所属行业的专业研究、估值政策、估值流程和程序、基金的风险控制与绩效评估、会计政策与基金核算以及相关事项的合法合规性审核和监督等各个方面具备专业能力。估值小组严格按照工作流程诚实守信、勤勉尽责地讨论和决策估值事项。日常估值项目由基金事务部严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定执行。当经济环境和证券市场发生重大变化时，针对特殊估值工作，按照以下工作流程进行：由公司估值小组依据行业协会提供的估值模型和行业做法选定与当时市场经济环境相适应的估值方法并征求托管行、会计师事务所的相关意见，由基金事务部做出提示，对其潜在估值调整对前

一估值日的基金资产净值的影响是否在 0.25% 以上进行测算，并对确认产生影响的品种根据前述估值模型、估值流程计算，提供相关投资品种的公允价值以进行估值处理，待清算人员复核后，将估值结果反馈基金经理，并提交公司估值小组。其他特殊情形，可由基金经理主动做出提示，并由研究员提供研究报告，交估值小组审议，同时按流程对外公布。

#### 2、基金经理参与或决定估值的程度

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

#### 3、本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

#### 4、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息。

### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金合同》，基金收益分配原则为：1、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。2、基金收益分配后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、A 类基金份额和 C 类基金份额之间由于收取费用的不同，将导致在可供分配利润上有所不同；同一类别每一基金份额享有同等分配权；4、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

本基金本报告期内未进行利润分配。

### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：兴银科技增长 1 个月滚动持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产             | 附注号        | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>     |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 1,862,730.46                   | -                                |
| 结算备付金           |            | 49,190,957.60                  | -                                |
| 存出保证金           |            | -                              | -                                |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 833,268,081.53                 | -                                |
| 其中：股票投资         |            | 833,268,081.53                 | -                                |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | -                              | -                                |
| 资产支持证券投资        |            | -                              | -                                |
| 贵金属投资           |            | -                              | -                                |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | -                              | -                                |
| 应收证券清算款         |            | -                              | -                                |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 6,092.17                       | -                                |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | 414,315.57                     | -                                |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 884,742,177.33                 | -                                |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2020 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债：</b>     |            |                                |                                  |
| 短期借款            |            | -                              | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                              | -                                |
| 衍生金融负债          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                              | -                                |
| 应付证券清算款         |            | -                              | -                                |
| 应付赎回款           |            | 4,748.33                       | -                                |
| 应付管理人报酬         |            | 1,050,414.62                   | -                                |
| 应付托管费           |            | 140,055.29                     | -                                |
| 应付销售服务费         |            | 43,916.50                      | -                                |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | -                              | -                                |
| 应交税费            |            | -                              | -                                |

|               |          |                |   |
|---------------|----------|----------------|---|
| 应付利息          |          | -              | - |
| 应付利润          |          | -              | - |
| 递延所得税负债       |          | -              | - |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 80,136.49      | - |
| 负债合计          |          | 1,319,271.23   | - |
| <b>所有者权益：</b> |          |                |   |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 734,696,315.98 | - |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 148,726,590.12 | - |
| 所有者权益合计       |          | 883,422,906.10 | - |
| 负债和所有者权益总计    |          | 884,742,177.33 | - |

报告截止日 2021 年 6 月 30 日，兴银科技增长 1 个月滚动持有混合 A 基金份额净值 1.2027 元，基金份额总额 651,319,963.73 份；兴银科技增长 1 个月滚动持有混合 C 基金份额净值 1.2006 元，基金份额总额 83,376,352.25 份。兴银科技增长 1 个月滚动持有混合份额总额合计为 734,696,315.98 份。

## 6.2 利润表

会计主体：兴银科技增长 1 个月滚动持有期混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 2 月 18 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                   | 附注号        | 本期<br>2021 年 2 月 18 日(基<br>金合同生效日)至 2021<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020<br>年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|--------------------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>           |            | 160,536,492.25                                         | -                                             |
| 1.利息收入                |            | 855,915.14                                             | -                                             |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11   | 322,219.82                                             | -                                             |
| 债券利息收入                |            | 232.82                                                 | -                                             |
| 资产支持证券利息收入            |            | -                                                      | -                                             |
| 买入返售金融资产收入            |            | 533,462.50                                             | -                                             |
| 证券出借利息收入              |            | -                                                      | -                                             |
| 其他利息收入                |            | -                                                      | -                                             |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |            | -35,085,986.49                                         | -                                             |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.12   | -38,646,596.21                                         | -                                             |
| 基金投资收益                |            | -                                                      | -                                             |
| 债券投资收益                | 6.4.7.13   | 268,211.43                                             | -                                             |
| 资产支持证券投资收益            | 6.4.7.13.5 | -                                                      | -                                             |
| 贵金属投资收益               | 6.4.7.14   | -                                                      | -                                             |
| 衍生工具收益                | 6.4.7.15   | -                                                      | -                                             |
| 股利收益                  | 6.4.7.16   | 3,292,398.29                                           | -                                             |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17   | 194,166,672.08                                         | -                                             |

|                            |            |                |   |
|----------------------------|------------|----------------|---|
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |            | -              | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 6.4.7.18   | 599,891.52     | - |
| <b>减：二、费用</b>              |            | 10,920,350.63  | - |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 4,771,980.32   | - |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 636,264.07     | - |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 215,232.45     | - |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.19   | 5,216,737.17   | - |
| 5. 利息支出                    |            | -              | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | -              | - |
| 6. 税金及附加                   |            | 0.13           | - |
| 7. 其他费用                    | 6.4.7.20   | 80,136.49      | - |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 149,616,141.62 | - |
| 减：所得税费用                    |            | -              | - |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 149,616,141.62 | - |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴银科技增长 1 个月滚动持有期混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 2 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                | 本期<br>2021 年 2 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 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）                   | 955,953,284.26                                  | -              | 955,953,284.26  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）          | -                                               | 149,616,141.62 | 149,616,141.62  |
| 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） | -221,256,968.28                                 | -889,551.50    | -222,146,519.78 |
| 其中：1. 基金申购款                       | 5,096,286.20                                    | 23,481.29      | 5,119,767.49    |
| 2. 基金赎回款                          | -226,353,254.48                                 | -913,032.79    | -227,266,287.27 |

|                                        |                                            |                |                |
|----------------------------------------|--------------------------------------------|----------------|----------------|
| 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）                        | 734,696,315.98                             | 148,726,590.12 | 883,422,906.10 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 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）                        | -                                          | -              | -              |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                          | -              | -              |
| 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）      | -                                          | -              | -              |
| 其中：1.基金申购款                             | -                                          | -              | -              |
| 2.基金赎回款                                | -                                          | -              | -              |
| 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）                        | -                                          | -              | -              |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

|            |            |           |
|------------|------------|-----------|
| <u>张贵云</u> | <u>刘建新</u> | <u>崔可</u> |
| 基金管理人负责人   | 主管会计工作负责人  | 会计机构负责人   |

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

兴银科技增长 1 个月滚动持有期混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）许可〔2020〕1846 号文准予注册，本基金首次募集资金总额为人民币 955,953,284.26 元。《兴银科技增长 1 个月滚动持有期混合型证券投资基金基金合同》

于 2021 年 2 月 18 日正式生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为兴银基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》相关规定以及《兴银科技增长 1 个月滚动持有期混合型证券投资基金基金合同》等法律文件约定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，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发行或注册并上市的股票）、债券（包括国债、金融债、公司债、企业债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为：中国战略新兴产业成份指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%

#### 6.4.2 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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表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的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 2 月 18 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 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。

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

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。

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按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。

### 6.4.4.5 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、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。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且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。

#### 6.4.4.7 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。

#### 6.4.4.8 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的比例，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)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### 1、 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

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的净额确认。

##### 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，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

#### 6.4.4.10 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。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

基金收益分配原则遵循国家有关法律规定并符合基金合同的有关规定：

1、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。

2、基金收益分配后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、A 类基金份额和 C 类基金份额之间由于收取费用的不同，将导致在可供分配利润上有所不同；同一类别每一基金份额享有同等分配权。

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.4.4.12 分部报告

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

#### 6.4.4.13 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。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期内无需说明的重大会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### **6.4.5.3 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。

#### **6.4.6 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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

| 项目             | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 1,862,730.46           |
| 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:            | 1,862,730.46           |

注:定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

| 项目            | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |                |                |
|---------------|------------------------|----------------|----------------|
|               | 成本                     | 公允价值           | 公允价值变动         |
| 股票            | 639,101,409.45         | 833,268,081.53 | 194,166,672.08 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | —                      | —              | —              |
| 债券            | 交易所市场                  | —              | —              |
|               | 银行间市场                  | —              | —              |
|               | 合计                     | —              | —              |
| 资产支持证券        | —                      | —              | —              |

|    |                |                |                |
|----|----------------|----------------|----------------|
| 基金 | -              | -              | -              |
| 其他 | -              | -              | -              |
| 合计 | 639,101,409.45 | 833,268,081.53 | 194,166,672.08 |

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 146.59                 |
| 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  | 5,945.58               |
| 应收债券利息     | -                      |
| 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    | -                      |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                      |
| 应收出借证券利息   | -                      |
| 其他         | -                      |
| 合计         | 6,092.17               |

### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 6.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末无应付交易费用。

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | —                      |
| 应付赎回费       | —                      |
| 应付证券出借违约金   | —                      |
| 预提费用        | 80,136.49              |
| 合计          | 80,136.49              |

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 兴银科技增长 1 个月滚动持有混合 A |                                                 |                 |
|---------------------|-------------------------------------------------|-----------------|
| 项目                  | 本期<br>2021 年 2 月 18 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日 |                 |
|                     | 基金份额(份)                                         | 账面金额            |
| 基金合同生效日             | 816,687,900.16                                  | 816,687,900.16  |
| 本期申购                | 4,603,086.87                                    | 4,603,086.87    |
| 本期赎回(以“-”号填列)       | -169,971,023.30                                 | -169,971,023.30 |
| — 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                 | 651,319,963.73                                  | 651,319,963.73  |

金额单位：人民币元

| 兴银科技增长 1 个月滚动持有混合 C |                                                 |                |
|---------------------|-------------------------------------------------|----------------|
| 项目                  | 本期<br>2021 年 2 月 18 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日 |                |
|                     | 基金份额(份)                                         | 账面金额           |
| 基金合同生效日             | 139,265,384.10                                  | 139,265,384.10 |
| 本期申购                | 493,199.33                                      | 493,199.33     |
| 本期赎回(以“-”号填列)       | -56,382,231.18                                  | -56,382,231.18 |
| — 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                 | 83,376,352.25                                   | 83,376,352.25  |

注：1、申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

2、本基金共募集有效净认购资金人民币 955,416,909.65 元。根据《兴银科技增长 1 个月滚动持有混合型基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 536,374.61 元在本基金成立后，折算为 536,374.61 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 兴银科技增长 1 个月滚动持有混合 A |                |                |                |
|---------------------|----------------|----------------|----------------|
| 项目                  | 已实现部分          | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
| 基金合同生效日             | -              | -              | -              |
| 本期利润                | -37,861,193.54 | 170,830,641.99 | 132,969,448.45 |
| 本期基金份额交易产生的变动数      | 8,961,210.55   | -9,926,242.04  | -965,031.49    |
| 其中：基金申购款            | -224,866.38    | 249,342.00     | 24,475.62      |
| 基金赎回款               | 9,186,076.93   | -10,175,584.04 | -989,507.11    |
| 本期已分配利润             | -              | -              | -              |
| 本期末                 | -28,899,982.99 | 160,904,399.95 | 132,004,416.96 |

单位：人民币元

| 兴银科技增长 1 个月滚动持有混合 C |               |               |               |
|---------------------|---------------|---------------|---------------|
| 项目                  | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
| 基金合同生效日             | -             | -             | -             |
| 本期利润                | -6,689,336.92 | 23,336,030.09 | 16,646,693.17 |
| 本期基金份额交易产生的变动数      | 2,846,631.97  | -2,771,151.98 | 75,479.99     |
| 其中：基金申购款            | -24,898.46    | 23,904.13     | -994.33       |
| 基金赎回款               | 2,871,530.43  | -2,795,056.11 | 76,474.32     |
| 本期已分配利润             | -             | -             | -             |
| 本期末                 | -3,842,704.95 | 20,564,878.11 | 16,722,173.16 |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021 年 2 月 18 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日 |
|-----------|-------------------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 14,865.57                                       |
| 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 | 307,354.25                                      |
| 其他        | -                                               |

|    |            |
|----|------------|
| 合计 | 322,219.82 |
|----|------------|

### 6.4.7.12 股票投资收益

#### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2021 年 2 月 18 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日 |
|------------------|-------------------------------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -38,646,596.21                                  |
| 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               | -38,646,596.21                                  |

#### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2021 年 2 月 18 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日 |
|------------|-------------------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 1,779,682,055.00                                |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,818,328,651.21                                |
| 买卖股票差价收入   | -38,646,596.21                                  |

#### 6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期无证券出借差价收入。

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                            | 本期<br>2021年2月18日(基金合同生效日)至2021年<br>6月30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 | 268,211.43                               |
| 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 | 268,211.43 |
|----|------------|

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2021年2月18日(基金合同生效日)至2021年<br>6月30日 |
|-------------------------|------------------------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 1,967,245.44                             |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,698,800.00                             |
| 减：应收利息总额                | 234.01                                   |
| 买卖债券差价收入                | 268,211.43                               |

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

#### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021 年 2 月 18 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日 |
|---------------|-------------------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 3,292,398.29                                    |
| 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            | 3,292,398.29                                    |

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称                       | 本期<br>2021 年 2 月 18 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日 |
|----------------------------|-------------------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产                 | 194,166,672.08                                  |
| —— 股票投资                    | 194,166,672.08                                  |
| —— 债券投资                    | -                                               |
| —— 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<br>增值税 | -                                               |
| 合计                         | 194,166,672.08                                  |

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

|         | 2021 年 2 月 18 日(基金合同生效日)至 2021 年<br>6 月 30 日 |
|---------|----------------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 599,891.52                                   |
| 合计      | 599,891.52                                   |

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021 年 2 月 18 日(基金合同生效日)至 2021 年<br>6 月 30 日 |
|-----------|----------------------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 5,216,737.17                                       |
| 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        | 5,216,737.17                                       |

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021 年 2 月 18 日(基金合同生效日)至 2021 年<br>6 月 30 日 |
|---------|----------------------------------------------------|
| 审计费用    | 17,202.22                                          |
| 信息披露费   | 62,934.27                                          |
| 证券出借违约金 | -                                                  |
| 合计      | 80,136.49                                          |

#### 6.4.7.21 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。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

无。

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

本报告期末不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

| 关联方名称                    | 与本基金的关系               |
|--------------------------|-----------------------|
| 兴银基金管理有限责任公司(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               | 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。

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**

本基金合同生效日为 2021 年 2 月 18 日，以下仅为本基金本报告期数据，无上年度可比期间数据。

**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2021 年 2 月 18 日(基金合同生效日)至<br>2021 年 6 月 30 日 |                  | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |                  |
|-------|----------------------------------------------------|------------------|--------------------------------------------|------------------|
|       | 成交金额                                               | 占当期股票<br>成交总额的比例 | 成交金额                                       | 占当期股票<br>成交总额的比例 |
| 华福证券  | 4,234,358,981.73                                   | 100.00%          | -                                          | -                |

**6.4.10.1.2 债券交易**

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2021 年 2 月 18 日 (基金合同生效日) 至<br>2021 年 6 月 30 日 |                  | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |                  |
|-------|------------------------------------------------------|------------------|--------------------------------------------|------------------|
|       | 成交金额                                                 | 占当期债券<br>成交总额的比例 | 成交金额                                       | 占当期债券<br>成交总额的比例 |
| 华福证券  | 1,967,245.44                                         | 100.00%          | -                                          | -                |

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2021 年 2 月 18 日 (基金合同生效日)<br>至 2021 年 6 月 30 日 |                        | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |                        |
|-------|------------------------------------------------------|------------------------|--------------------------------------------|------------------------|
|       | 回购成交金额                                               | 占当期债券回<br>购<br>成交总额的比例 | 回购成交金额                                     | 占当期债券回<br>购<br>成交总额的比例 |
| 华福证券  | 9,711,600,000.00                                     | 100.00%                | -                                          | -                      |

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2021 年 2 月 18 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 6 月 30 日 |                |          |                  |
|-------|---------------------------------------------------|----------------|----------|------------------|
|       | 当期佣金                                              | 占当期佣金总<br>量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例 |
| 华福证券  | 3,485,257.65                                      | 100.00%        | -        | -                |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日        |                |          |                  |
|       | 当期佣金                                              | 占当期佣金<br>总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例 |
| -     | -                                                 | -              | -        | -                |

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2021 年 2 月 18 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|-----------------|-------------------------------------------------|--------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 4,771,980.32                                    | —                                          |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 2,383,073.68                                    | —                                          |

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5%的年费率计提。管理费的计算方法如下:

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目             | 本期<br>2021 年 2 月 18 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|----------------|-------------------------------------------------|--------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 636,264.07                                      | —                                          |

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

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位:人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2021 年 2 月 18 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日 |                     |            |
|----------------|-------------------------------------------------|---------------------|------------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                                |                     |            |
|                | 兴银科技增长 1 个月滚动持有混合 A                             | 兴银科技增长 1 个月滚动持有混合 C | 合计         |
| 兴银基金           | —                                               | 81.58               | 81.58      |
| 华福证券           | —                                               | 145,560.09          | 145,560.09 |
| 兴业银行           | —                                               | 68,210.63           | 68,210.63  |
| 合计             | —                                               | 213,852.30          | 213,852.30 |
| 获得销售服务费的       | 上年度可比期间                                         |                     |            |

| 各关联方名称 | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |                     |    |
|--------|---------------------------------|---------------------|----|
|        | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |                     |    |
|        | 兴银科技增长 1 个月滚动持有混合 A             | 兴银科技增长 1 个月滚动持有混合 C | 合计 |
| 合计     | -                               | -                   | -  |

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.5%，销售服务费计提的计算公式如下：

$$H=E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内与关联方未进行银行间同业市场债券（含回购）的交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2021 年 2 月 18 日(基金合同生效日)至<br>2021 年 6 月 30 日 |           | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 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  | 1,862,730.46                                       | 14,865.57 | -                                          | -      |

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无其他需要说明的关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |      |                 |                |        |       |        |              |           |           |    |
|----------------------|------|-----------------|----------------|--------|-------|--------|--------------|-----------|-----------|----|
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购日           | 可流通日           | 流通受限类型 | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量<br>(单位：股) | 期末成本总额    | 期末估值总额    | 备注 |
| 688499               | 利元亨  | 2021 年 6 月 23 日 | 2021 年 7 月 1 日 | 新股未上市  | 38.85 | 38.85  | 2,149        | 83,488.65 | 83,488.65 | -  |
| 688087               | 英科再生 | 2021 年 6 月 30 日 | 2021 年 7 月 9 日 | 新股未上市  | 21.96 | 21.96  | 2,469        | 54,219.24 | 54,219.24 | -  |
| 301017               | 漱玉平民 | 2021 年 6 月 23 日 | 2021 年 7 月 5 日 | 新股未上市  | 8.86  | 8.86   | 4,995        | 44,255.70 | 44,255.70 | -  |
| 301020               | 密封科技 | 2021 年 6 月 28 日 | 2021 年 7 月 6 日 | 新股未上市  | 10.64 | 10.64  | 3,789        | 40,314.96 | 40,314.96 | -  |
| 301021               | 英诺激光 | 2021 年 6 月 28 日 | 2021 年 7 月 6 日 | 新股未上市  | 9.46  | 9.46   | 2,609        | 24,681.14 | 24,681.14 | -  |
| 688226               | 威腾电气 | 2021 年 6 月 28 日 | 2021 年 7 月 7 日 | 新股未上市  | 6.42  | 6.42   | 2,693        | 17,289.06 | 17,289.06 | -  |

|        |      |                 |                  |        |       |        |       |           |           |   |
|--------|------|-----------------|------------------|--------|-------|--------|-------|-----------|-----------|---|
| 605287 | 德才股份 | 2021 年 6 月 28 日 | 2021 年 7 月 6 日   | 新股未上市  | 31.56 | 31.56  | 349   | 11,014.44 | 11,014.44 | - |
| 300973 | 立高食品 | 2021 年 4 月 8 日  | 2021 年 10 月 15 日 | 新股流通受限 | 28.28 | 115.71 | 360   | 10,180.80 | 41,655.60 | - |
| 301015 | 百洋医药 | 2021 年 6 月 22 日 | 2021 年 12 月 30 日 | 新股流通受限 | 7.64  | 38.83  | 462   | 3,529.68  | 17,939.46 | - |
| 300968 | 格林精密 | 2021 年 4 月 6 日  | 2021 年 10 月 15 日 | 新股流通受限 | 6.87  | 12.07  | 1,162 | 7,982.94  | 14,025.34 | - |
| 300997 | 欢乐家  | 2021 年 5 月 26 日 | 2021 年 12 月 2 日  | 新股流通受限 | 4.94  | 13.05  | 928   | 4,584.32  | 12,110.40 | - |
| 300962 | 中金辐照 | 2021 年 3 月 29 日 | 2021 年 10 月 11 日 | 新股流通受限 | 3.40  | 16.37  | 576   | 1,958.40  | 9,429.12  | - |
| 301016 | 雷尔伟  | 2021 年 6 月 23 日 | 2021 年 12 月 30 日 | 新股流通受限 | 13.75 | 32.98  | 275   | 3,781.25  | 9,069.50  | - |
| 300966 | 共同药业 | 2021 年 3 月 31 日 | 2021 年 10 月 11 日 | 新股流通受限 | 8.24  | 31.54  | 286   | 2,356.64  | 9,020.44  | - |
| 300978 | 东箭科技 | 2021 年 4 月 15 日 | 2021 年 10 月 26 日 | 新股流通受限 | 8.42  | 13.60  | 593   | 4,993.06  | 8,064.80  | - |
| 300985 | 致远新能 | 2021 年 4 月 21 日 | 2021 年 10 月 29 日 | 新股流通受限 | 24.90 | 24.81  | 295   | 7,345.50  | 7,318.95  | - |
| 300971 | 博亚精工 | 2021 年 4 月 7 日  | 2021 年 10 月 15 日 | 新股流通受限 | 18.24 | 28.29  | 245   | 4,468.80  | 6,931.05  | - |
| 300991 | 创益通  | 2021 年 5 月 12 日 | 2021 年 11 月      | 新股流通受限 | 13.06 | 26.51  | 254   | 3,317.24  | 6,733.54  | - |

|        |      | 日               | 月 22<br>日        |        |       |       |     |          |          |   |
|--------|------|-----------------|------------------|--------|-------|-------|-----|----------|----------|---|
| 301011 | 华立科技 | 2021 年 6 月 9 日  | 2021 年 12 月 17 日 | 新股流通受限 | 14.20 | 33.84 | 175 | 2,485.00 | 5,922.00 | - |
| 300972 | 万辰生物 | 2021 年 4 月 8 日  | 2021 年 10 月 19 日 | 新股流通受限 | 7.19  | 12.65 | 430 | 3,091.70 | 5,439.50 | - |
| 300995 | 奇德新材 | 2021 年 5 月 17 日 | 2021 年 11 月 26 日 | 新股流通受限 | 14.72 | 23.32 | 191 | 2,811.52 | 4,454.12 | - |
| 301007 | 德迈仕  | 2021 年 6 月 4 日  | 2021 年 12 月 16 日 | 新股流通受限 | 5.29  | 14.44 | 303 | 1,602.87 | 4,375.32 | - |
| 301012 | 扬电科技 | 2021 年 6 月 15 日 | 2021 年 12 月 22 日 | 新股流通受限 | 8.05  | 24.26 | 170 | 1,368.50 | 4,124.20 | - |
| 300992 | 泰福泵业 | 2021 年 5 月 17 日 | 2021 年 11 月 25 日 | 新股流通受限 | 9.36  | 20.32 | 200 | 1,872.00 | 4,064.00 | - |
| 301010 | 晶雪节能 | 2021 年 6 月 9 日  | 2021 年 12 月 20 日 | 新股流通受限 | 7.83  | 17.61 | 218 | 1,706.94 | 3,838.98 | - |
| 301017 | 漱玉平民 | 2021 年 6 月 23 日 | 2022 年 1 月 5 日   | 新股流通受限 | 8.86  | 8.86  | 555 | 4,917.30 | 4,917.30 | - |
| 301020 | 密封科技 | 2021 年 6 月 28 日 | 2022 年 1 月 6 日   | 新股流通受限 | 10.64 | 10.64 | 421 | 4,479.44 | 4,479.44 | - |
| 301021 | 英诺激光 | 2021 年 6 月 28 日 | 2022 年 1 月 6 日   | 新股流通受限 | 9.46  | 9.46  | 290 | 2,743.40 | 2,743.40 | - |

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额单位：人民币元

| 股票代码   | 股票名称 | 停牌日期            | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量（股）   | 期末成本总额        | 期末估值总额        | 备注 |
|--------|------|-----------------|------|--------|------|--------|---------|---------------|---------------|----|
| 600460 | 士兰微  | 2021 年 6 月 30 日 | 临时停牌 | 56.35  | -    | -      | 337,800 | 12,843,101.43 | 19,035,030.00 | -  |

**6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购。

**6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购。

**6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

无。

**6.4.13 金融工具风险及管理****6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

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

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

**6.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好

信用等级的证券，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。

#### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本基金报告期末未持有除国债、政策性金融债以外的需按短期信用评级列示的债券投资。

#### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末未持有需按短期信用评级列示的资产支持证券。

#### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末未持有需按短期信用评级列示的同业存单。

#### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末未持有除国债、政策性金融债以外的需按长期信用评级列示的债券投资。

#### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末未持有需按长期信用评级列示的资产支持证券。

#### **6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末未持有需按长期信用评级列示的同业存单。

### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人在开放赎回期间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。

#### **6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析**

无。

#### **6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 | 1 个月以内        | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息            | 合计             |
|------------------------|---------------|--------|----------|-------|-------|----------------|----------------|
| 资产                     |               |        |          |       |       |                |                |
| 银行存款                   | 1,862,730.46  | 0.00   | 0.00     | 0.00  | 0.00  | -              | 1,862,730.46   |
| 结算备付金                  | 49,190,957.60 | -      | -        | -     | -     | -              | 49,190,957.60  |
| 交易性金融资产                | 0.00          | 0.00   | 0.00     | 0.00  | 0.00  | 833,268,081.53 | 833,268,081.53 |
| 应收利息                   | -             | -      | -        | -     | -     | 6,092.17       | 6,092.17       |
| 应收申购款                  | -             | -      | -        | -     | -     | 414,315.57     | 414,315.57     |
| 资产总计                   | 51,053,688.06 | 0.00   | 0.00     | 0.00  | 0.00  | 833,688,489.27 | 884,742,177.33 |
| 负债                     |               |        |          |       |       |                |                |

|                          |               |        |          |       |       |                |                |
|--------------------------|---------------|--------|----------|-------|-------|----------------|----------------|
| 其他负债                     | -             | -      | -        | -     | -     | 80,136.49      | 80,136.49      |
| 应付赎回款                    | -             | -      | -        | -     | -     | 4,748.33       | 4,748.33       |
| 应付管理人报酬                  | -             | -      | -        | -     | -     | 1,050,414.62   | 1,050,414.62   |
| 应付托管费                    | -             | -      | -        | -     | -     | 140,055.29     | 140,055.29     |
| 应付销售服务费                  | -             | -      | -        | -     | -     | 43,916.50      | 43,916.50      |
| 负债总计                     | 0.00          | 0.00   | 0.00     | 0.00  | 0.00  | 1,319,271.23   | 1,319,271.23   |
| 利率敏感度缺口                  | 51,053,688.06 | 0.00   | 0.00     | 0.00  | 0.00  | 832,369,218.04 | 883,422,906.10 |
| 上年度末<br>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                       |               |        |          |       |       |                |                |
| 资产总计                     | -             | -      | -        | -     | -     | -              | -              |
| 负债                       |               |        |          |       |       |                |                |
| 负债总计                     | -             | -      | -        | -     | -     | -              | -              |
| 利率敏感度缺口                  | -             | -      | -        | -     | -     | -              | -              |

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

无。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2020 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  | 833,268,081.53 | 94.32         | -    | -             |
| 交易性金融资产-基金投资  | -              | -             | -    | -             |
| 交易性金融资产-债券投资  | -              | -             | -    | -             |
| 交易性金融资产-贵金属投资 | -              | -             | -    | -             |
| 衍生金融资产-权证投资   | -              | -             | -    | -             |
| 其他            | -              | -             | -    | -             |
| 合计            | 833,268,081.53 | 94.32         | -    | -             |

#### 6.4.13.4.3.2 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（2021年6月30日）             | 上年度末（2020年12月31日） |
|    | 沪深300指数上涨5%                                                                         | 42,241,452.80               | -                 |
|    | 沪深300指数下跌5%                                                                         | -42,241,452.80              | -                 |

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 6.4.14 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2021年6月30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833,268,081.53元，无属于第二层次的余额，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

对于本基金投资的证券，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，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

(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。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额             | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 833,268,081.53 | 94.18         |
|    | 其中：股票             | 833,268,081.53 | 94.18         |
| 2  | 基金投资              | —              | —             |
| 3  | 固定收益投资            | —              | —             |
|    | 其中：债券             | —              | —             |
|    | 资产支持证券            | —              | —             |
| 4  | 贵金属投资             | —              | —             |
| 5  | 金融衍生品投资           | —              | —             |
| 6  | 买入返售金融资产          | —              | —             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | —              | —             |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 51,053,688.06  | 5.77          |
| 8  | 其他各项资产            | 420,407.74     | 0.05          |
| 9  | 合计                | 884,742,177.33 | 100.00        |

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|----------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 5,439.50       | 0.00          |
| B  | 采矿业              | —              | —             |
| C  | 制造业              | 588,383,999.63 | 66.60         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 11,266,660.90  | 1.28          |
| E  | 建筑业              | 11,014.44      | 0.00          |
| F  | 批发和零售业           | 8,090,701.98   | 0.92          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | —              | —             |
| H  | 住宿和餐饮业           | —              | —             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 177,787,546.76 | 20.12         |
| J  | 金融业              | 32,746,548.30  | 3.71          |
| K  | 房地产业             | —              | —             |
| L  | 租赁和商务服务业         | —              | —             |
| M  | 科学研究和技术服务业       | —              | —             |

|   |               |                |       |
|---|---------------|----------------|-------|
| 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       | 790.02         | 0.00  |
| R | 文化、体育和娱乐业     | 14,975,380.00  | 1.70  |
| S | 综合            | -              | -     |
|   | 合计            | 833,268,081.53 | 94.32 |

### 7.2.2 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股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）   | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 300671 | 富满电子 | 726,350 | 95,616,714.00 | 10.82        |
| 2  | 688699 | 明微电子 | 201,423 | 57,470,010.36 | 6.51         |
| 3  | 300750 | 宁德时代 | 85,300  | 45,618,440.00 | 5.16         |
| 4  | 002371 | 北方华创 | 130,500 | 36,198,090.00 | 4.10         |
| 5  | 603260 | 合盛硅业 | 349,980 | 26,916,961.80 | 3.05         |
| 6  | 002876 | 三利谱  | 399,000 | 25,815,300.00 | 2.92         |
| 7  | 603026 | 石大胜华 | 133,200 | 21,585,060.00 | 2.44         |
| 8  | 002594 | 比亚迪  | 85,100  | 21,360,100.00 | 2.42         |
| 9  | 600703 | 三安光电 | 625,400 | 20,044,070.00 | 2.27         |
| 10 | 300059 | 东方财富 | 592,680 | 19,433,977.20 | 2.20         |
| 11 | 600460 | 士兰微  | 337,800 | 19,035,030.00 | 2.15         |
| 12 | 300327 | 中颖电子 | 221,400 | 18,869,922.00 | 2.14         |
| 13 | 300655 | 晶瑞股份 | 509,497 | 18,591,545.53 | 2.10         |
| 14 | 688116 | 天奈科技 | 157,470 | 18,581,460.00 | 2.10         |
| 15 | 300014 | 亿纬锂能 | 177,500 | 18,447,575.00 | 2.09         |
| 16 | 300458 | 全志科技 | 204,300 | 17,908,938.00 | 2.03         |
| 17 | 300274 | 阳光电源 | 155,100 | 17,845,806.00 | 2.02         |
| 18 | 603876 | 鼎胜新材 | 561,800 | 17,443,890.00 | 1.97         |
| 19 | 688626 | 翔宇医疗 | 133,409 | 16,121,143.56 | 1.82         |
| 20 | 002756 | 永兴材料 | 268,900 | 15,969,971.00 | 1.81         |
| 21 | 688111 | 金山办公 | 40,423  | 15,959,000.40 | 1.81         |
| 22 | 688012 | 中微公司 | 95,041  | 15,769,202.72 | 1.79         |
| 23 | 600399 | 抚顺特钢 | 861,400 | 15,625,796.00 | 1.77         |

|    |        |      |           |               |      |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 24 | 300142 | 沃森生物 | 245,400   | 15,141,180.00 | 1.71 |
| 25 | 300413 | 芒果超媒 | 218,300   | 14,975,380.00 | 1.70 |
| 26 | 688200 | 华峰测控 | 31,320    | 14,824,695.60 | 1.68 |
| 27 | 603076 | 乐惠国际 | 268,760   | 14,284,594.00 | 1.62 |
| 28 | 002645 | 华宏科技 | 879,400   | 14,052,812.00 | 1.59 |
| 29 | 300790 | 宇瞳光学 | 408,109   | 13,847,138.37 | 1.57 |
| 30 | 300775 | 三角防务 | 353,600   | 13,507,520.00 | 1.53 |
| 31 | 600760 | 中航沈飞 | 223,420   | 13,472,226.00 | 1.53 |
| 32 | 002241 | 歌尔股份 | 312,900   | 13,373,346.00 | 1.51 |
| 33 | 601995 | 中金公司 | 215,900   | 13,277,850.00 | 1.50 |
| 34 | 000301 | 东方盛虹 | 611,200   | 12,774,080.00 | 1.45 |
| 35 | 300896 | 爱美客  | 15,900    | 12,543,192.00 | 1.42 |
| 36 | 600309 | 万华化学 | 113,998   | 12,405,262.36 | 1.40 |
| 37 | 600905 | 三峡能源 | 1,765,200 | 11,226,672.00 | 1.27 |
| 38 | 003022 | 联泓新科 | 362,300   | 11,122,610.00 | 1.26 |
| 39 | 002080 | 中材科技 | 393,300   | 10,292,661.00 | 1.17 |
| 40 | 300624 | 万兴科技 | 149,020   | 8,729,591.60  | 0.99 |
| 41 | 000963 | 华东医药 | 169,320   | 7,790,413.20  | 0.88 |
| 42 | 600893 | 航发动力 | 144,233   | 7,671,753.27  | 0.87 |
| 43 | 688276 | 百克生物 | 3,486     | 364,565.88    | 0.04 |
| 44 | 688161 | 威高骨科 | 3,069     | 325,467.45    | 0.04 |
| 45 | 301015 | 百洋医药 | 4,614     | 251,115.78    | 0.03 |
| 46 | 301016 | 雷尔伟  | 2,747     | 115,711.58    | 0.01 |
| 47 | 688499 | 利元亨  | 2,149     | 83,488.65     | 0.01 |
| 48 | 688087 | 英科再生 | 2,469     | 54,219.24     | 0.01 |
| 49 | 301017 | 漱玉平民 | 5,550     | 49,173.00     | 0.01 |
| 50 | 301020 | 密封科技 | 4,210     | 44,794.40     | 0.01 |
| 51 | 300973 | 立高食品 | 360       | 41,655.60     | 0.00 |
| 52 | 688067 | 爱威科技 | 1,259     | 39,520.01     | 0.00 |
| 53 | 688367 | 工大高科 | 1,717     | 37,035.69     | 0.00 |
| 54 | 605090 | 九丰能源 | 1,090     | 35,326.90     | 0.00 |
| 55 | 688681 | 科汇股份 | 1,899     | 34,903.62     | 0.00 |
| 56 | 601528 | 瑞丰银行 | 2,230     | 34,721.10     | 0.00 |
| 57 | 301021 | 英诺激光 | 2,899     | 27,424.54     | 0.00 |
| 58 | 001207 | 联科科技 | 682       | 22,581.02     | 0.00 |
| 59 | 688226 | 威腾电气 | 2,693     | 17,289.06     | 0.00 |
| 60 | 300968 | 格林精密 | 1,162     | 14,025.34     | 0.00 |
| 61 | 001208 | 华菱线缆 | 1,754     | 13,558.42     | 0.00 |
| 62 | 603171 | 税友股份 | 637       | 12,230.40     | 0.00 |

|    |        |      |     |           |      |
|----|--------|------|-----|-----------|------|
| 63 | 300997 | 欢乐家  | 928 | 12,110.40 | 0.00 |
| 64 | 605287 | 德才股份 | 349 | 11,014.44 | 0.00 |
| 65 | 300962 | 中金辐照 | 576 | 9,429.12  | 0.00 |
| 66 | 300966 | 共同药业 | 286 | 9,020.44  | 0.00 |
| 67 | 300978 | 东箭科技 | 593 | 8,064.80  | 0.00 |
| 68 | 300985 | 致远新能 | 295 | 7,318.95  | 0.00 |
| 69 | 300971 | 博亚精工 | 245 | 6,931.05  | 0.00 |
| 70 | 300991 | 创益通  | 254 | 6,733.54  | 0.00 |
| 71 | 301011 | 华立科技 | 175 | 5,922.00  | 0.00 |
| 72 | 300972 | 万辰生物 | 430 | 5,439.50  | 0.00 |
| 73 | 605011 | 杭州热电 | 525 | 4,662.00  | 0.00 |
| 74 | 300995 | 奇德新材 | 191 | 4,454.12  | 0.00 |
| 75 | 301007 | 德迈仕  | 303 | 4,375.32  | 0.00 |
| 76 | 301012 | 扬电科技 | 170 | 4,124.20  | 0.00 |
| 77 | 300992 | 泰福泵业 | 200 | 4,064.00  | 0.00 |
| 78 | 301010 | 晶雪节能 | 218 | 3,838.98  | 0.00 |
| 79 | 000516 | 国际医学 | 42  | 790.02    | 0.00 |

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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      | 占期末基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1  | 600196 | 复星医药 | 58,896,599.77 | 6.67           |
| 2  | 600111 | 北方稀土 | 41,171,662.20 | 4.66           |
| 3  | 300671 | 富满电子 | 38,002,276.00 | 4.30           |
| 4  | 300750 | 宁德时代 | 37,745,927.60 | 4.27           |
| 5  | 300347 | 泰格医药 | 35,359,195.74 | 4.00           |
| 6  | 601899 | 紫金矿业 | 35,328,560.89 | 4.00           |
| 7  | 002876 | 三利谱  | 32,913,779.86 | 3.73           |
| 8  | 300677 | 英科医疗 | 31,444,476.00 | 3.56           |
| 9  | 002371 | 北方华创 | 30,582,736.00 | 3.46           |
| 10 | 688699 | 明微电子 | 30,413,979.76 | 3.44           |
| 11 | 300674 | 宇信科技 | 29,620,594.00 | 3.35           |
| 12 | 600460 | 士兰微  | 29,073,750.43 | 3.29           |
| 13 | 300458 | 全志科技 | 28,113,670.00 | 3.18           |
| 14 | 600438 | 通威股份 | 27,263,475.00 | 3.09           |

|    |        |       |               |      |
|----|--------|-------|---------------|------|
| 15 | 605111 | 新洁能   | 26,880,706.50 | 3.04 |
| 16 | 600893 | 航发动力  | 26,482,368.07 | 3.00 |
| 17 | 300059 | 东方财富  | 26,282,864.16 | 2.98 |
| 18 | 000928 | 中钢国际  | 25,348,121.96 | 2.87 |
| 19 | 300760 | 迈瑞医疗  | 25,278,566.00 | 2.86 |
| 20 | 000625 | 长安汽车  | 25,212,572.21 | 2.85 |
| 21 | 000799 | 酒鬼酒   | 24,961,094.00 | 2.83 |
| 22 | 601598 | 中国外运  | 24,251,284.30 | 2.75 |
| 23 | 300253 | 卫宁健康  | 23,891,745.68 | 2.70 |
| 24 | 603026 | 石大胜华  | 22,696,649.10 | 2.57 |
| 25 | 601111 | 中国国航  | 22,133,173.98 | 2.51 |
| 26 | 601016 | 节能风电  | 21,994,250.00 | 2.49 |
| 27 | 002152 | 广电运通  | 21,951,160.07 | 2.48 |
| 28 | 600711 | 盛屯矿业  | 21,780,137.05 | 2.47 |
| 29 | 600059 | 古越龙山  | 21,554,940.75 | 2.44 |
| 30 | 002594 | 比亚迪   | 21,513,406.50 | 2.44 |
| 31 | 300142 | 沃森生物  | 21,424,558.00 | 2.43 |
| 32 | 002192 | 融捷股份  | 21,252,162.00 | 2.41 |
| 33 | 600031 | 三一重工  | 20,747,965.33 | 2.35 |
| 34 | 603260 | 合盛硅业  | 19,829,956.55 | 2.24 |
| 35 | 605358 | 立昂微   | 19,052,858.00 | 2.16 |
| 36 | 601601 | 中国太保  | 18,936,574.00 | 2.14 |
| 37 | 002645 | 华宏科技  | 18,229,014.00 | 2.06 |
| 38 | 601658 | 邮储银行  | 18,059,517.85 | 2.04 |
| 39 | 000725 | 京东方 A | 17,993,342.00 | 2.04 |

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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      | 占期末基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1  | 600196 | 复星医药 | 57,810,507.88 | 6.54           |
| 2  | 600111 | 北方稀土 | 40,546,180.00 | 4.59           |
| 3  | 300347 | 泰格医药 | 40,107,703.31 | 4.54           |
| 4  | 601899 | 紫金矿业 | 32,296,549.95 | 3.66           |
| 5  | 000625 | 长安汽车 | 28,646,417.84 | 3.24           |
| 6  | 300458 | 全志科技 | 27,841,232.94 | 3.15           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 7  | 300674 | 宇信科技 | 27,207,864.20 | 3.08 |
| 8  | 300677 | 英科医疗 | 26,463,433.23 | 3.00 |
| 9  | 300760 | 迈瑞医疗 | 25,797,349.00 | 2.92 |
| 10 | 000928 | 中钢国际 | 25,742,978.59 | 2.91 |
| 11 | 000799 | 酒鬼酒  | 25,464,392.00 | 2.88 |
| 12 | 601598 | 中国外运 | 25,189,548.46 | 2.85 |
| 13 | 605111 | 新洁能  | 24,151,442.60 | 2.73 |
| 14 | 601016 | 节能风电 | 22,920,654.00 | 2.59 |
| 15 | 002192 | 融捷股份 | 22,662,211.00 | 2.57 |
| 16 | 600438 | 通威股份 | 22,210,535.00 | 2.51 |
| 17 | 600711 | 盛屯矿业 | 21,759,886.28 | 2.46 |
| 18 | 601111 | 中国国航 | 21,113,899.80 | 2.39 |
| 19 | 002152 | 广电运通 | 21,112,445.75 | 2.39 |
| 20 | 600702 | 舍得酒业 | 20,875,299.00 | 2.36 |
| 21 | 600031 | 三一重工 | 20,577,206.30 | 2.33 |
| 22 | 300253 | 卫宁健康 | 20,522,036.38 | 2.32 |
| 23 | 600436 | 片仔癀  | 19,660,035.90 | 2.23 |
| 24 | 000516 | 国际医学 | 19,369,575.08 | 2.19 |
| 25 | 600059 | 古越龙山 | 18,754,966.00 | 2.12 |
| 26 | 002340 | 格林美  | 18,234,441.48 | 2.06 |

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |                  |
|--------------|------------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 2,457,430,060.66 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,779,682,055.00 |

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

**7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

无。

**7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

报告期内本基金未进行股指期货投资。

**7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，旨在采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金投资范围不包含国债期货，无相关投资政策。

**7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金投资范围不包含国债期货，无相关投资政策。

**7.11.3 本期国债期货投资评价**

本基金投资范围不包含国债期货，无相关投资政策。

**7.12 投资组合报告附注****7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明**

无。

**7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明**

无。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额         |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | -          |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 6,092.17   |
| 5  | 应收申购款   | 414,315.57 |

|   |       |            |
|---|-------|------------|
| 6 | 其他应收款 | -          |
| 7 | 待摊费用  | -          |
| 8 | 其他    | -          |
| 9 | 合计    | 420,407.74 |

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金无股指期货投资。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额<br>级别                                          | 持有人<br>户数<br>(户) | 户均持有的<br>基金份额 | 持有人结构        |        |                |         |
|---------------------------------------------------|------------------|---------------|--------------|--------|----------------|---------|
|                                                   |                  |               | 机构投资者        |        | 个人投资者          |         |
|                                                   |                  |               | 持有份额         | 占总份额比例 | 持有份额           | 占总份额比例  |
| 兴 银<br>科 技<br>增 长 1<br>个 月<br>滚 动<br>持 有<br>混 合 A | 11,282           | 57,730.90     | 1,106,282.65 | 0.17%  | 650,213,681.08 | 99.83%  |
| 兴 银<br>科 技<br>增 长 1<br>个 月<br>滚 动<br>持 有<br>混 合 C | 1,145            | 72,817.77     | —            | 0.00%  | 83,376,352.25  | 100.00% |
| 合计                                                | 12,427           | 59,120.97     | 1,106,282.65 | 0.15%  | 733,590,033.33 | 99.85%  |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别                | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|---------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 兴银科技增长 1 个月滚动持有混合 A | 0.99      | 0.00%    |
|                  | 兴银科技增长 1 个月滚动持有混合 C | 55,258.25 | 0.07%    |
|                  | 合计                  | 55,259.24 | 0.01%    |

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目           | 份额级别        | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------|-------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金 | 兴银科技增长 1 个月 | —                 |

|                    |                     |      |
|--------------------|---------------------|------|
| 投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 滚动持有混合 A            |      |
|                    | 兴银科技增长 1 个月滚动持有混合 C | 0~10 |
|                    | 合计                  | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金    | 兴银科技增长 1 个月滚动持有混合 A | —    |
|                    | 兴银科技增长 1 个月滚动持有混合 C | —    |
|                    | 合计                  | —    |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                                     | 兴银科技增长 1<br>个月滚动持有混<br>合 A | 兴银科技增长 1<br>个月滚动持有混<br>合 C |
|----------------------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 基金合同生效日（2021 年 2 月 18 日）基金份<br>额总额     | 816,687,900.16             | 139,265,384.10             |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购<br>份额              | 4,603,086.87               | 493,199.33                 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎<br>回份额            | 169,971,023.30             | 56,382,231.18              |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变<br>动份额（份额减少以“-”填列） | -                          | -                          |
| 本报告期期末基金份额总额                           | 651,319,963.73             | 83,376,352.25              |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

- (1) 基金管理人于 2021 年 7 月 20 日公告，郑翊鸣先生担任公司财务总监。
- (2) 基金管理人于 2021 年 8 月 27 日公告，赵建兴先生担任公司总经理。
- (3) 报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本年度由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金进行审计。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易             |              | 应支付该券商的佣金    |            | 备注 |
|------|--------|------------------|--------------|--------------|------------|----|
|      |        | 成交金额             | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金           | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 华福证券 | 2      | 4,234,358,981.73 | 100.00%      | 3,485,257.65 | 100.00%    | -  |

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 |              | 债券回购交易 |                | 权证交易 |              |
|------|------|--------------|--------|----------------|------|--------------|
|      | 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 |
|      |      |              |        |                |      |              |

|      |              |         |                  |         |   |   |
|------|--------------|---------|------------------|---------|---|---|
| 华福证券 | 1,967,245.44 | 100.00% | 9,711,600,000.00 | 100.00% | - | - |
|------|--------------|---------|------------------|---------|---|---|

## 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                                                                                                        | 法定披露方式                     | 法定披露日期          |
|----|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------|-----------------|
| 1  | 兴银科技增长 1 个月滚动持有期混合型证券投资基金基金份额发售公告；兴银科技增长 1 个月滚动持有期混合型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告                                                  | 上海证券报                      | 2021 年 1 月 13 日 |
| 2  | 兴银科技增长 1 个月滚动持有期混合型证券投资基金基金份额发售公告、基金招募说明书、基金合同、基金托管协议、产品资料概要份额 A、产品资料概要份额 C                                                 | 指定网站                       | 2021 年 1 月 13 日 |
| 3  | 兴银科技增长 1 个月滚动持有期混合型证券投资基金提前结束募集的公告                                                                                          | 上海证券报、指定网站                 | 2021 年 2 月 2 日  |
| 4  | 兴银科技增长 1 个月滚动持有期混合型证券投资基金基金合同生效公告                                                                                           | 上海证券报、指定网站                 | 2021 年 2 月 19 日 |
| 5  | 兴银科技增长 1 个月滚动持有期混合型证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告                                                                                      | 上海证券报、指定网站                 | 2021 年 3 月 13 日 |
| 6  | 兴银科技增长 1 个月滚动持有期混合型证券投资基金（兴银科技增长 1 个月滚动持有混合 A 份额）基金产品资料概要（更新）、兴银科技增长 1 个月滚动持有期混合型证券投资基金（兴银科技增长 1 个月滚动持有混合 C 份额）基金产品资料概要（更新） | 指定网站、中数平台                  | 2021 年 3 月 16 日 |
| 7  | 兴银基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告                                                                                                     | 上海证券报、证券时报、证券日报、中国证券报、指定网站 | 2021 年 3 月 17 日 |
| 8  | 兴银基金管理有限公司及子公司关于办公地址变更的公告                                                                                                   | 上海证券报、证券时报、证券日报、中国证券报、指定网站 | 2021 年 4 月 16 日 |

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内单一投资者持有基金份额比例未出现超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

|    |
|----|
| 无。 |
|----|

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予兴银科技增长 1 个月滚动持有期混合型证券投资基金募集注册的文件
2. 《兴银科技增长 1 个月滚动持有期混合型证券投资基金基金合同》
3. 《兴银科技增长 1 个月滚动持有期混合型证券投资基金托管协议》
4. 《兴银科技增长 1 个月滚动持有期混合型证券投资基金招募说明书》
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照
6. 报告期内在指定信息披露媒体上公开披露的各项公告

### 12.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处。

### 12.3 查阅方式

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

兴银基金管理有限责任公司

2021 年 8 月 31 日