

# 兴银国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金

## 2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人:兴银基金管理有限责任公司

基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期:2022 年 08 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022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2022年1月1日起至6月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告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股票投资明细	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
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	56
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	56
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	56
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	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.12 投资组合报告附注	57
§8 基金份额持有人信息	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
8.2 期末上市基金前十名持有人	58

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	59
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	59
§9 开放式基金份额变动.....	59
§10 重大事件揭示.....	59
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.....	60
10.4 基金投资策略的改变.....	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	60
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.....	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	60
10.8 其他重大事件.....	61
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
11.1 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
§12 备查文件目录.....	62
12.1 备查文件目录.....	63
12.2 存放地点.....	63
12.3 查阅方式.....	63

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	兴银国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	兴银国证新能源车电池ETF
场内简称	电池龙头
基金主代码	159767
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021年08月06日
基金管理人	兴银基金管理有限责任公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	135,873,672.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2021年08月23日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>本基金采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。</p> <p>特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股票长期停牌；（4）其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。</p> <p>本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年跟踪误差不超过2%。如因标的指数编制规则调</p>

	整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即国证新能源车电池指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

### 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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵建兴	胡波
	联系电话	021-20296318	021-61618888
	电子邮箱	zjx@hffunds.cn	Hub5@spdb.com.cn
客户服务电话		40000-96326	95528
传真		021-68630069	021-63602540
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	上海市中山东一路12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	上海市北京东路689号
邮政编码		200120	200001
法定代表人		张贵云	郑杨

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2022年01月01日- 2022年06月30日)
本期已实现收益	-12,706,573.07
本期利润	4,586,072.72
加权平均基金份额本期利润	0.0240
本期加权平均净值利润率	2.84%
本期基金份额净值增长率	1.13%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022年06月30日)
期末可供分配利润	1,269,372.94
期末可供分配基金份额利润	0.0093
期末基金资产净值	137,143,044.94
期末基金份额净值	1.0093
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022年06月30日)
基金份额累计净值增长率	0.93%

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

期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	25.05%	2.45%	25.34%	2.48%	-0.29%	-0.03%
过去三个月	22.16%	2.81%	21.65%	2.83%	0.51%	-0.02%
过去六个月	1.13%	2.73%	0.39%	2.75%	0.74%	-0.02%
自基金合同生效起至今	0.93%	2.46%	-5.07%	2.55%	6.00%	-0.09%

注：1、本基金成立于2021年8月6日；2、比较基准：国证新能源车电池指数收益率。

#### 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



兴银国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年08月06日-2022年06月30日)



注：1、本基金成立于2021年8月6日；2、比较基准：国证新能源车电池指数收益率。

### 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46只开放式基金（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、兴银长盈三个月定期开放债券型证券投资基金、兴银长益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、兴银货币市场基金、兴银大健康灵活配置混合型证券投资基金、兴银朝阳债券型证券投资基金、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、兴银合盈债券型证券投资基金、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、兴银汇逸三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、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、兴银中证科创创业50指数型证券投资基金、兴银国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金、兴银兴慧一年持有期混合型证券投资基金、兴银中证1000指数增强型证券投资基金、兴银碳中和主题混合型证券投资基金、兴银汇泓一年定期开放债券型发起式证券投资基金、兴银稳益30天持有期债券型证券投资基金、兴银合鑫债券型证券投资基金、兴银中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、兴银竞争优势混合型证券投资基金），净值总规模超700亿元。

#### 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		
刘帆	基金经理	2021-08-06	-	5	南开大学金融工程硕士，FRM（金融风险管理师）。曾任平安基金管理有限公司中央交易室交易员、ETF指数投资中心研究员兼基金经理助理。2020年11月加入兴银基金管理有限责

					任公司，现任兴银基金管理有限责任公司指数与量化投资部基金经理。
林学晨	基金经理	2021-08-06	-	8	硕士研究生，CFA持证人。曾任湘财证券研究所金融工程分析师。2015年7月加入兴银基金管理有限责任公司，历任兴银基金管理有限责任公司中央交易室衍生品交易员、衍生品业务部投资经理助理、投资经理；现任兴银基金管理有限责任公司指数与量化投资部基金经理。

备注：

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。

刘帆女士、林学晨先生均为本基金的首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

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

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

2022年上半年新能源汽车累计销量达259.2万辆。目前新能源汽车需求旺盛，交付量更多受供给端的影响。同时受益于油价高位以及汽车下乡、新能源汽车购置税减免等政策刺激，新能源汽车板块景气度仍维持高位。

展望下半年，政策端+生产端+新车型投放三重因素共振，新能源汽车销量有望全面释放。需求景气不减、技术迭代不休，新能源又将站在新的起跑线上。

报告期内，我们严格按照合同约定，紧密跟踪标的指数，追求跟踪误差最小化的理念进行被动投资。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴银国证新能源车电池ETF基金份额净值为1.0093元，本报告期内，基金份额净值增长率为1.13%，同期业绩比较基准收益率为0.39%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们对A股市场持谨慎偏乐观态度。海外方面，在高通胀背景下，美联储加息缩表继续推进，并且从节奏上看，三季度仍有尾部风险待释放。但整体而言，随着经济下行的预期，海外市场的主要风险将逐步从估值转向盈利。国内方面，随着经济数据逐步回暖，同时政策有望维持宽松，市场流动性合理充裕。站在中长期的维度，随着疫情冲击消退，经济逐步开始复苏，经济工作的主要任务也将逐步回归推动经济实现质的稳步提升和量的合理增长，政策重心将进一步聚焦于推动高质量发展。以新能源为代表的新兴产业中长期增长确定性强、空间大。

## 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

无。

### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行利润分配，符合法律法规的规定及《基金合同》的约定。本报告期内本基金没有应分配但尚未分配的利润。

### 4.8 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遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对兴银国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，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、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人依照《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、托管协议的规定，对兴银国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 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

本报告期内，由兴银基金管理有限责任公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：兴银国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	840,830.82	880,837.99
结算备付金		37,101.73	79,162.76
存出保证金		128,565.48	253,061.48
交易性金融资产	6.4.7.2	136,771,111.88	156,971,260.35
其中：股票投资		136,771,111.88	156,971,260.35
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-

衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		130,618.92	5,641.55
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	297.51
资产总计		137,908,228.83	158,190,261.64
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年06月30日</b>	<b>上年度末 2021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		-	-
应付清算款		543,443.61	243,003.96
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		63,577.81	54,540.07
应付托管费		12,715.56	10,908.02
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	6.4.7.5	145,446.91	317,603.38
负债合计		765,183.89	626,055.43
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.6	135,873,672.00	157,873,672.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.7	1,269,372.94	-309,465.79
净资产合计		137,143,044.94	157,564,206.21
负债和净资产总计		137,908,228.83	158,190,261.64

注：报告截止日2022年6月30日，基金份额净值1.0093元，份额总额135,873,672.00份；

## 6.2 利润表

会计主体：兴银国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至2022年0 6月30日
<b>一、营业总收入</b>		5,161,453.29
1. 利息收入		3,817.68
其中：存款利息收入	6.4.7.8	3,817.68
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-12,273,591.05
其中：股票投资收益	6.4.7.9	-12,627,468.36
基金投资收益	6.4.7.10	-
债券投资收益	6.4.7.11	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-



股利收益	6.4.7.15	353,877.31
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	17,292,645.79
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	138,580.87
<b>减：二、营业总支出</b>		575,380.57
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	399,998.38
2. 托管费	6.4.10.2.2	79,999.76
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失		-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.18	95,382.43
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		4,586,072.72
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		4,586,072.72
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-
<b>六、综合收益总额</b>		4,586,072.72

本基金合同生效日为2021年8月6日，无上年度可比期间数据。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：兴银国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日

	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	157,873,672. 00	-	-309,465.79	157,564,206. 21
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	157,873,672. 00	-	-309,465.79	157,564,206. 21
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-22,000,000. 00	-	1,578,838.73	-20,421,161. 27
(一)、综合收益总额	-	-	4,586,072.72	4,586,072.72
(二)、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)	-22,000,000. 00	-	-3,007,233.9 9	-25,007,233. 99
其中：1. 基金申购款	177,000,000. 00	-	-24,590,826. 86	152,409,173. 14
2. 基金赎回款	-199,000,00 0.00	-	21,583,592.8 7	-177,416,40 7.13
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	135,873,672. 00	-	1,269,372.94	137,143,044. 94

本基金合同生效日为2021年8月6日，无上年度可比期间数据。

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：

赵建兴

刘钊

崔可

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

兴银国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会证监许可〔2021〕1755号文准予注册，本基金首次募集资金总额为人民币352,873,672元。《兴银国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金》于2021年8月6日正式生效。本基金为交易型开放式基金，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，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

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《兴银国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金》等法律文件约定，本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。为更好的实现基金的投资目标，本基金可能少量投资于国内依法发行上市的非成份股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会注册或核准上市的股票）、债券（包括国家债券、央行票据、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、债券回购、资产支持证券、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、货币市场工具、金融衍生工具（包括股指期货、股票期权等）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。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%；股指期货、股票期权及其他金融工具的投资比例按照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规对该比例要求有变更的，在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。本基金的业绩比较基准为：标的指数收益率，即国证新能源车电池指数收益率。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注6.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金2022年6月30日的财务状况、2022年1月1日至2022年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

除下文6.4.5.1会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

### 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

本基金自2022年度起执行了财政部发布的《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量(修订)》、《企业会计准则第23号—金融资产转移(修订)》、《企业会计准则第24号—套期会计(修订)》及《企业会计准则第37号—金融工具列报(修订)》(统称“新金融工具准则”)和2022年中国证监会发布的修订的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》。

##### (a) 新金融工具准则

根据财政部发布的新金融工具准则相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，本基金应当自2022年1月1日起执行新金融工具准则。

新金融工具准则修订了财政部于2006年颁布的《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》和《企业会计准则第24号—套期保值》以及财政部于2014年修订的《企业会计准则第37号—金融工具列报》(统称“原金融工具准则”)。

新金融工具准则将金融资产划分为三个基本分类：(1) 以摊余成本计量的金融资产；(2) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产；及(3) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在新金融工具准则下，金融资产的分类是基于本基金管理金融资产的业务模式及该资产合同现金流量特征而确定。新金融工具准则取消了原金融工具准则中规定的持有至到期投资、贷款和应收款项及可供出售金融资产三个分类类别。根据新金融工具准则，嵌入衍生工具不再从金融资产的主合同中分拆出来，而是将混合金融工具整体适用关于金融资产分类的相关规定。

新金融工具准则以“预期信用损失”模型替代了原金融工具准则中的“已发生损失”模型。“预期信用损失”模型要求持续评估金融资产的信用风险，因此在新金融工具准则下，本基金信用损失的确认时点早于原金融工具准则。

本基金按照新金融工具准则的衔接规定，对新金融工具准则施行日（即2022年1月1日）未终止确认的金融工具的分类和计量（含减值）进行追溯调整。本基金未调整比较财务报表数据，将金融工具的原账面价值和在新金融工具准则施行日的新账面价值之间的差额计入2022年年初留存收益或其他综合收益。

执行新金融工具准则对2022年1月1日本基金资产负债表各项目的的影响汇总如下：

(i) 金融工具的分类影响

以摊余成本计量的金融资产

于2021年12月31日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息，对应的账面价值分别为人民币880,837.99元、79,162.76元、253,061.48元、297.51元。

于2022年1月1日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金，对应的账面价值分别为人民币880,967.09元、79,205.88元、253,186.77元。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

于2021年12月31日，本基金按照原金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币156,971,260.35元。

于2022年1月1日，本基金按照新金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币156,971,260.35元。

以摊余成本计量的金融负债

于2021年12月31日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为应付交易费用、其他负债，对应的账面价值分别为人民币110,425.30元、207,178.08元。

于2022年1月1日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为其他负债，对应的账面价值分别为人民币317,603.38元。

(b) 修订的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》

本基金根据修订的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》编制财务报表时，调整了部分财务报表科目的列报和披露，未对财务报表列报和披露产生重大影响。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 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[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《财政部、国家税务总局、证监会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》、《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》（财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号）、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《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》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 自2016年5月1日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

自2018年1月1日起，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让2017年12月31日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价（2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2018年1月1日（含）以后，管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴20%的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，其股息红利所得暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。

(e) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在2018年1月1日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

## 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 2022年06月30日
----	--------------------

活期存款	840,830.82
等于：本金	840,747.79
加：应计利息	83.03
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	840,830.82

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	125,754,939.23	-	136,771,111.88	11,016,172.65
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	125,754,939.23	-	136,771,111.88	11,016,172.65

注：股票投资的公允价值和股票投资的公允价值变动均包含可退替代款估值增值。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

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 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付交易费用	43,057.40
其中：交易所市场	43,057.40
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	102,389.51
合计	145,446.91

#### 6.4.7.6 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	157,873,672.00	157,873,672.00
本期申购	177,000,000.00	177,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-199,000,000.00	-199,000,000.00
本期末	135,873,672.00	135,873,672.00

注：此处申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.7 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
本期期初	26,440,487.26	-26,749,953.05	-309,465.79
本期利润	-12,706,573.07	17,292,645.79	4,586,072.72
本期基金份额交易产生的变动数	1,187,273.49	-4,194,507.48	-3,007,233.99
其中：基金申购款	24,978,323.35	-49,569,150.21	-24,590,826.86
基金赎回款	-23,791,049.86	45,374,642.73	21,583,592.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,921,187.68	-13,651,814.74	1,269,372.94

#### 6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	活期存款利息收入	1,128.07
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	948.16	
其他	1,741.45	
合计	3,817.68	

注：其他为结算保证金利息收入。

## 6.4.7.9 股票投资收益

## 6.4.7.9.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,719,381.59
股票投资收益——赎回差价收入	-10,908,086.77
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-12,627,468.36

## 6.4.7.9.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
卖出股票成交总额	61,937,638.39
减：卖出股票成本总额	63,499,992.74
减：交易费用	157,027.24
买卖股票差价收入	-1,719,381.59

## 6.4.7.9.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
赎回基金份额对价总额	177,416,407.13
减：现金支付赎回款总额	25,830,453.13
减：赎回股票成本总额	162,494,040.77
减：交易费用	-
赎回差价收入	-10,908,086.77

## 6.4.7.9.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.10 基金投资收益

无。

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无债券投资收益。

##### 6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期未进行资产支持证券的投资。

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

##### 6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期未进行贵金属投资。

##### 6.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期未进行贵金属投资。

##### 6.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期未进行贵金属投资。

##### 6.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期未进行贵金属投资。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

##### 6.4.7.14.1 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。

#### 6.4.7.14.2 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。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
股票投资产生的股利收益	353,877.31
基金投资产生的股利收益	-
合计	353,877.31

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	17,292,645.79
——股票投资	17,292,645.79
——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增值税	-
合计	17,292,645.79

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
基金赎回费收入	-
ETF基金替代损益	138,580.87
合计	138,580.87

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代股票的实际买入成本(实际卖出成本)与申购(赎回)确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

#### 6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
审计费用	25,787.07
信息披露费	59,507.37
汇划手续费	171.00
其他	9,916.99
合计	95,382.43

#### 6.4.7.19 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

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

##### 6.4.8.2 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。

#### 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

**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	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司	基金托管人
华福证券有限责任公司	基金管理人的股东、基金销售机构、申购赎回代理券商
国脉科技股份有限公司	基金管理人的股东
上海兴瀚资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

注：本基金与关联方的所有交易均是在正常业务中按照一般商业条款订立。

**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8月6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 2022年01月01日至2022年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华福证券	98,827,133.51	84.81%

**6.4.10.1.2 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。

**6.4.10.1.3 债券交易**

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

**6.4.10.1.4 债券回购交易**

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

**6.4.10.1.5 基金交易**

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行基金交易。

#### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华福证券	72,271.36	84.81%	31,937.57	74.17%

#### 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 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	399,998.38
其中：支付销售机构的客户维护费	-

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	79,999.76

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金无销售服务费。

#### 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 各关联方投资本基金的情况

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

本基金本报告期间无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

##### 6.4.10.4.2 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

本基金本报告期间无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.10.5 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 2022年01月01日至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行股份有限公司	840,830.82	1,128.07

#### 6.4.10.6 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。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本报告期内本基金未进行利润分配。

## 6.4.12 期末（2022年06月30日）本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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	受限期	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
600938	中国海油	2022-04-14	6个月	新股锁定	10.80	15.86	84,004	907,243.20	1,332,303.44	-
301139	元道通信	2022-06-30	6个交易日	新股未上市	38.46	38.46	1,474	56,690.04	56,690.04	-
301239	普瑞眼科	2022-06-22	9个交易日	新股未上市	33.65	33.65	1,551	52,191.15	52,191.15	-
301233	盛帮股份	2022-06-24	8个交易日	新股未上市	41.52	41.52	992	41,187.84	41,187.84	-
301238	瑞泰新材	2022-06-10	6个月	创业板打新限售	19.18	32.07	384	7,365.12	12,314.88	-
301215	中汽股份	2022-02-28	6个月	创业板打新限售	3.80	6.39	1,797	6,828.60	11,482.83	-
301220	亚香股份	2022-06-15	6个月	创业板打新限售	35.98	39.15	285	10,254.30	11,157.75	-
3011	新特	2022	6个月	创业	13.7	15.4	695	9,54	10,7	-

20	电气	-04-11	月	板打 新限售	3	9		2.35	65.5 5	
3012 98	东利 机械	2022 -05- 27	6个 月	创业 板打 新限售	12.6 8	20.8 3	502	6,36 5.36	10,4 56.6 6	-
3011 12	信邦 智能	2022 -06- 20	6个 月	创业 板打 新限售	27.5 3	45.0 4	208	5,72 6.24	9,36 8.32	-
3011 87	欧圣 电气	2022 -04- 13	6个 月	创业 板打 新限售	21.3 3	22.5 4	403	8,59 5.99	9,08 3.62	-
3012 59	艾布 鲁	2022 -04- 18	6个 月	创业 板打 新限售	18.3 9	24.9 4	353	6,49 1.67	8,80 3.82	-
3012 63	泰恩 康	2022 -03- 22	6个 月	创业 板打 新限售	19.9 3	31.3 8	277	5,52 0.61	8,69 2.26	-
3011 25	腾亚 精工	2022 -05- 27	6个 月	创业 板打 新限售	22.4 9	27.4 2	311	6,99 4.39	8,52 7.62	-
3012 86	侨源 股份	2022 -06- 06	6个 月	创业 板打 新限售	16.9 1	19.7 9	427	7,22 0.57	8,45 0.33	-
3011 62	国能 日新	2022 -04- 19	6个 月	创业 板打 新限售	45.1 3	54.1 1	156	7,04 0.28	8,44 1.16	-

				售						
301268	铭利达	2022-03-29	6个月	创业板打新限售	28.50	34.87	229	6,526.50	7,985.23	-
301163	宏德股份	2022-04-11	6个月	创业板打新限售	26.27	32.33	235	6,173.45	7,597.55	-
301288	清研环境	2022-04-14	6个月	创业板打新限售	19.09	19.98	367	7,006.03	7,332.66	-
301302	华如科技	2022-06-16	6个月	创业板打新限售	52.03	56.42	127	6,607.81	7,165.34	-
301212	联盛化学	2022-04-07	6个月	创业板打新限售	29.67	33.28	208	6,171.36	6,922.24	-
301130	西点药业	2022-02-16	6个月	创业板打新限售	22.55	37.70	183	4,126.65	6,899.10	-
301122	采纳股份	2022-01-19	6个月	创业板打新限售	50.31	70.37	97	4,880.07	6,825.89	-
301217	铜冠铜箔	2022-01-20	6个月	创业板打新限售	17.27	14.83	440	7,598.80	6,525.20	-
3011	元道	2022	6个	创业	38.4	38.4	164	6,30	6,30	-

39	通信	-06-30	月	板打 新限售	6	6		7.44	7.44	
3012 56	华融 化学	2022 -03- 14	6个 月	创业 板打 新限售	8.05	10.0 8	623	5,01 5.15	6,27 9.84	-
3010 97	天益 医疗	2022 -03- 25	6个 月	创业 板打 新限售	52.3 7	47.8 3	130	6,80 8.10	6,21 7.90	-
3012 39	普瑞 眼科	2022 -06- 22	6个 月	创业 板打 新限售	33.6 5	33.6 5	173	5,82 1.45	5,82 1.45	-
3012 28	实朴 检测	2022 -01- 21	6个 月	创业 板打 新限售	20.0 8	20.3 4	282	5,66 2.56	5,73 5.88	-
3011 53	中科 江南	2022 -05- 10	6个 月	创业 板打 新限售	33.6 8	43.9 8	130	4,37 8.40	5,71 7.40	-
3012 48	杰创 智能	2022 -04- 13	6个 月	创业 板打 新限售	39.0 7	29.8 7	189	7,38 4.23	5,64 5.43	-
3012 01	诚达 药业	2022 -01- 12	6个 月	创业 板打 新限售	72.6 9	71.5 4	71	5,16 0.99	5,07 9.34	-
3011 09	军信 股份	2022 -04- 06	6个 月	创业 板打 新限售	23.2 4	16.1 4	313	7,27 5.29	5,05 1.82	-

				售						
3011 37	哈焊 华通	2022 -03- 14	6个 月	创业 板打 新限 售	15.3 7	15.9 9	313	4,81 0.81	5,00 4.87	-
3011 50	中一 科技	2022 -04- 14	6个 月	创业 板打 新限 售	109. 04	82.7 6	60	6,54 2.40	4,96 5.60	-
3012 36	软通 动力	2022 -03- 08	6个 月	创业 板打 新限 售	48.5 9	31.3 8	156	7,57 9.52	4,89 5.28	-
3012 16	万凯 新材	2022 -03- 21	6个 月	创业 板打 新限 售	35.6 8	29.8 4	164	5,85 1.52	4,89 3.76	-
3012 33	盛帮 股份	2022 -06- 24	6个 月	创业 板打 新限 售	41.5 2	41.5 2	111	4,60 8.72	4,60 8.72	-
3011 48	嘉戎 技术	2022 -04- 14	6个 月	创业 板打 新限 售	38.3 9	23.9 0	187	7,17 8.93	4,46 9.30	-
3011 03	何氏 眼科	2022 -03- 14	6个 月	创业 板打 新限 售	32.5 7	32.0 2	137	4,46 2.50	4,38 6.74	-
3011 35	瑞德 智能	2022 -04- 01	6个 月	创业 板打 新限 售	31.9 8	26.2 6	165	5,27 6.70	4,33 2.90	-
3012	三元	2022	6个	创业	72.8	45.6	93	6,77	4,24	-

06	生物	-01-26	月	板打 新限售	7	9		6.60	9.17	
3011 51	冠龙 节能	2022 -03- 30	6个 月	创业 板打 新限售	30.8 2	21.4 6	192	5,91 7.44	4,12 0.32	-
3012 22	浙江 恒威	2022 -03- 02	6个 月	创业 板打 新限售	33.9 8	28.9 6	141	4,79 1.18	4,08 3.36	-
3011 17	佳缘 科技	2022 -01- 07	6个 月	创业 板打 新限售	46.8 0	54.4 4	75	3,51 0.00	4,08 3.00	-
3012 58	富士 莱	2022 -03- 21	6个 月	创业 板打 新限售	48.3 0	41.6 8	96	4,63 6.80	4,00 1.28	-
3012 79	金道 科技	2022 -04- 06	6个 月	创业 板打 新限售	31.2 0	22.8 1	174	5,42 8.80	3,96 8.94	-
3012 37	和顺 科技	2022 -03- 16	6个 月	创业 板打 新限售	56.6 9	41.8 6	92	5,21 5.48	3,85 1.12	-
3011 58	德石 股份	2022 -01- 07	6个 月	创业 板打 新限售	15.6 4	20.3 8	183	2,86 2.12	3,72 9.54	-
3011 81	标榜 股份	2022 -02- 11	6个 月	创业 板打 新限售	40.2 5	30.5 9	118	4,74 9.50	3,60 9.62	-

				售						
301207	华兰疫苗	2022-02-10	6个月	创业板打新限售	56.88	56.42	63	3,583.44	3,554.46	-
301219	腾远钴业	2022-03-10	6个月	创业板打新限售	96.66	87.82	36	3,479.60	3,161.52	-
301123	奕东电子	2022-01-14	6个月	创业板打新限售	37.23	25.39	121	4,504.83	3,072.19	-
301110	青木股份	2022-03-04	6个月	创业板打新限售	63.10	39.85	70	4,417.00	2,789.50	-
300834	星辉环材	2022-01-06	6个月	创业板打新限售	55.57	30.03	60	3,334.20	1,801.80	-
301196	唯科科技	2022-01-04	6个月	创业板打新限售	64.08	37.52	33	2,114.64	1,238.16	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本报告期内本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 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。

### 6.4.13 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

本基金未持有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

本基金未持有需按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金未持有需按短期信用评级列示的同业存单投资。

##### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金未持有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

本基金未持有需按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金未持有需按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基

金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持大部分证券为依法上市的股票等资产，本报告期末本基金持有的资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

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 2022 年 06 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	840,830.82	-	-	-	-	-	840,830.82
结算备付金	37,101.73	-	-	-	-	-	37,101.73
存出保证金	128,565.48	-	-	-	-	-	128,565.48
交易性金融资产	-	-	-	-	-	136,771,111.88	136,771,111.88
应收清算款	-	-	-	-	-	116,610.01	116,610.01
资产总计	1,006,498.03	-	-	-	-	136,887,721.89	137,894,219.92
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	529,434.70	529,434.70
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	63,577.81	63,577.81
应付托管费	-	-	-	-	-	12,715.56	12,715.56
其他负债	-	-	-	-	-	145,446.91	145,446.91

负债总计	-	-	-	-	-	751,174.98	751,174.98
利率敏感度缺口	1,006,498.03	-	-	-	-	136,136,546.91	137,143,044.94
上年度末 2021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	880,837.99	-	-	-	-	-	880,837.99
结算备付金	79,162.76	-	-	-	-	-	79,162.76
存出保证金	253,061.48	-	-	-	-	-	253,061.48
交易性金融资产	-	-	-	-	-	156,971,260.35	156,971,260.35
应收利息	-	-	-	-	-	297.51	297.51
资产总计	1,213,062.23	-	-	-	-	156,971,557.86	158,184,620.09
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	237,362.41	237,362.41
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	54,540.07	54,540.07
应付托管费	-	-	-	-	-	10,908.02	10,908.02
应付交易费用	-	-	-	-	-	110,425.30	110,425.30
其他负债	-	-	-	-	-	207,178.08	207,178.08
负债总计	-	-	-	-	-	620,413.88	620,413.88
利率敏感度缺口	1,213,062.23	-	-	-	-	156,351,143.98	157,564,206.21

## 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除利率之外的其他市场变量保持不变；	
假设	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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
--	--	--------------------	---------------------

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

#### 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。

本基金采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。

#### 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 2022年06月30日		上年度末 2021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	136,771,111.88	99.73	156,971,260.35	99.62
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	136,771,111.88	99.73	156,971,260.35	99.62

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除下述市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	沪深300指数上涨5%	9,074,892.96	10,459,503.32
	沪深300指数下跌5%	-9,074,892.96	-10,459,503.32

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

### 6.4.14 公允价值

#### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	134,973,213.75	156,720,809.44
第二层次	1,797,898.13	250,450.91
第三层次	-	-
合计	136,771,111.88	156,971,260.35

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

无。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2022年6月30日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2021年12月31日：无)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于2022年6月30日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## § 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	136,771,111.88	99.18
	其中：股票	136,771,111.88	99.18
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	877,932.55	0.64
8	其他各项资产	259,184.40	0.19
9	合计	137,908,228.83	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	132,520,249.15	96.63
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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	2,113,883.00	1.54
	合计	134,634,132.15	98.17

### 7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,332,320.89	0.97
C	制造业	537,610.11	0.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	7,444.75	0.01
F	批发和零售业	28,295.47	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	14,977.44	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	107,691.24	0.08
J	金融业	-	-
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	23,879.91	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	22,360.58	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	62,399.34	0.05
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-

合计	2,136,979.73	1.56
----	--------------	------

### 7.2.3 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。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	38,420	20,516,280.00	14.96
2	002594	比亚迪	56,400	18,808,836.00	13.71
3	002812	恩捷股份	37,600	9,416,920.00	6.87
4	300014	亿纬锂能	93,700	9,135,750.00	6.66
5	603799	华友钴业	94,050	8,993,061.00	6.56
6	002460	赣锋锂业	59,800	8,892,260.00	6.48
7	002709	天赐材料	90,500	5,616,430.00	4.10
8	300450	先导智能	74,331	4,696,232.58	3.42
9	603659	璞泰来	47,016	3,968,150.40	2.89
10	002050	三花智控	135,018	3,710,294.64	2.71
11	002074	国轩高科	71,800	3,274,080.00	2.39
12	300769	德方纳米	7,860	3,212,224.80	2.34
13	002340	格林美	337,500	3,071,250.00	2.24
14	300207	欣旺达	90,800	2,869,280.00	2.09
15	300073	当升科技	30,300	2,737,302.00	2.00
16	688005	容百科技	20,629	2,670,217.76	1.95
17	002407	多氟多	49,300	2,411,263.00	1.76
18	600884	杉杉股份	78,400	2,330,048.00	1.70
19	300568	星源材质	74,617	2,166,877.68	1.58
20	000009	中国宝安	156,700	2,113,883.00	1.54

21	300037	新宙邦	35,360	1,858,521.60	1.36
22	300919	中伟股份	14,800	1,833,720.00	1.34
23	002056	横店东磁	60,400	1,607,848.00	1.17
24	603026	石大胜华	10,400	1,511,640.00	1.10
25	002850	科达利	9,500	1,510,500.00	1.10
26	002245	蔚蓝锂芯	63,589	1,475,900.69	1.08
27	600549	厦门钨业	59,400	1,284,228.00	0.94
28	600482	中国动力	76,400	1,200,244.00	0.88
29	300618	寒锐钴业	16,100	932,512.00	0.68
30	300001	特锐德	46,700	808,377.00	0.59

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600938	中国海油	84,005	1,332,320.89	0.97
2	301139	元道通信	1,638	62,997.48	0.05
3	301239	普瑞眼科	1,724	58,012.60	0.04
4	301201	诚达药业	705	51,488.14	0.04
5	301233	盛帮股份	1,103	45,796.56	0.03
6	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.03
7	301069	凯盛新材	539	24,853.29	0.02
8	603051	鹿山新材	272	21,488.00	0.02
9	001308	康冠科技	667	19,456.39	0.01
10	301089	拓新药业	121	15,200.02	0.01
11	301073	君亭酒店	216	14,977.44	0.01
12	301238	瑞泰新材	384	12,314.88	0.01
13	301215	中汽股份	1,797	11,482.83	0.01
14	001268	联合精密	409	11,337.48	0.01
15	301082	久盛电气	610	11,315.50	0.01
16	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.01

17	301120	新特电气	695	10,765.55	0.01
18	301078	孩子王	725	10,628.50	0.01
19	301298	东利机械	502	10,456.66	0.01
20	301112	信邦智能	208	9,368.32	0.01
21	301187	欧圣电气	403	9,083.62	0.01
22	301259	艾布鲁	353	8,803.82	0.01
23	301263	泰恩康	277	8,692.26	0.01
24	301155	海力风电	94	8,554.00	0.01
25	301125	腾亚精工	311	8,527.62	0.01
26	301286	侨源股份	427	8,450.33	0.01
27	301162	国能日新	156	8,441.16	0.01
28	301268	铭利达	229	7,985.23	0.01
29	301163	宏德股份	235	7,597.55	0.01
30	301098	金埔园林	307	7,444.75	0.01
31	301288	清研环境	367	7,332.66	0.01
32	301302	华如科技	127	7,165.34	0.01
33	301212	联盛化学	208	6,922.24	0.01
34	301130	西点药业	183	6,899.10	0.01
35	301087	可孚医疗	161	6,865.04	0.01
36	301122	采纳股份	97	6,825.89	0.00
37	301091	深城交	244	6,661.20	0.00
38	301111	粤万年青	241	6,608.22	0.00
39	301217	铜冠铜箔	440	6,525.20	0.00
40	301090	华润材料	598	6,524.18	0.00
41	301256	华融化学	623	6,279.84	0.00
42	301097	天益医疗	130	6,217.90	0.00
43	301101	明月镜片	119	6,108.27	0.00
44	301133	金钟股份	218	6,053.86	0.00
45	301228	实朴检测	282	5,735.88	0.00
46	301153	中科江南	130	5,717.40	0.00
47	301248	杰创智能	189	5,645.43	0.00

48	301109	军信股份	313	5,051.82	0.00
49	301137	哈焊华通	313	5,004.87	0.00
50	301150	中一科技	60	4,965.60	0.00
51	301236	软通动力	156	4,895.28	0.00
52	301216	万凯新材	164	4,893.76	0.00
53	301149	隆华新材	317	4,853.27	0.00
54	301126	达嘉维康	281	4,813.53	0.00
55	301148	嘉戎技术	187	4,469.30	0.00
56	301093	华兰股份	131	4,439.59	0.00
57	301103	何氏眼科	137	4,386.74	0.00
58	301135	瑞德智能	165	4,332.90	0.00
59	301063	海锅股份	153	4,262.58	0.00
60	301206	三元生物	93	4,249.17	0.00
61	301088	戎美股份	223	4,161.18	0.00
62	301198	喜悦智行	183	4,126.65	0.00
63	301151	冠龙节能	192	4,120.32	0.00
64	301222	浙江恒威	141	4,083.36	0.00
65	301117	佳缘科技	75	4,083.00	0.00
66	300854	中兰环保	203	4,035.64	0.00
67	301258	富士莱	96	4,001.28	0.00
68	301211	亨迪药业	184	3,989.12	0.00
69	301279	金道科技	174	3,968.94	0.00
70	301237	和顺科技	92	3,851.12	0.00
71	301158	德石股份	183	3,729.54	0.00
72	301221	光庭信息	56	3,630.48	0.00
73	301181	标榜股份	118	3,609.62	0.00
74	301207	华兰疫苗	63	3,554.46	0.00
75	301068	大地海洋	144	3,477.60	0.00
76	301079	邵阳液压	140	3,472.00	0.00
77	301092	争光股份	106	3,334.76	0.00
78	301138	华研精机	108	3,321.00	0.00

79	301199	迈赫股份	99	3,171.96	0.00
80	301219	腾远钴业	36	3,161.52	0.00
81	301123	奕东电子	121	3,072.19	0.00
82	301182	凯旺科技	123	2,922.48	0.00
83	301193	家联科技	103	2,796.45	0.00
84	301110	青木股份	70	2,789.50	0.00
85	301190	善水科技	115	2,728.95	0.00
86	301100	风光股份	116	2,503.28	0.00
87	301179	泽宇智能	57	2,326.17	0.00
88	301189	奥尼电子	58	1,931.98	0.00
89	300834	星辉环材	60	1,801.80	0.00
90	301108	洁雅股份	37	1,464.09	0.00
91	301196	唯科科技	33	1,238.16	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603799	华友钴业	10,294,856.28	6.53
2	300750	宁德时代	9,436,210.00	5.99
3	603659	璞泰来	5,289,544.00	3.36
4	603026	石大胜华	3,294,389.00	2.09
5	688005	容百科技	3,089,829.57	1.96
6	600884	杉杉股份	3,002,331.00	1.91
7	300769	德方纳米	2,796,983.00	1.78
8	300919	中伟股份	2,176,783.00	1.38
9	600482	中国动力	1,655,954.00	1.05
10	600110	诺德股份	1,631,781.00	1.04
11	600549	厦门钨业	1,590,554.01	1.01
12	600938	中国海油	1,296,054.00	0.82

13	002594	比亚迪	1,261,933.00	0.80
14	002812	恩捷股份	1,251,073.00	0.79
15	002460	赣锋锂业	1,146,056.00	0.73
16	300037	新宙邦	731,840.00	0.46
17	002709	天赐材料	726,115.00	0.46
18	002850	科达利	684,368.00	0.43
19	300014	亿纬锂能	568,987.38	0.36
20	300450	先导智能	534,084.00	0.34

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603799	华友钴业	12,410,565.40	7.88
2	603659	璞泰来	6,141,786.00	3.90
3	002594	比亚迪	5,620,685.00	3.57
4	300750	宁德时代	4,005,776.00	2.54
5	603026	石大胜华	3,552,235.34	2.25
6	600884	杉杉股份	3,381,076.01	2.15
7	002192	融捷股份	3,353,556.42	2.13
8	600110	诺德股份	2,809,624.00	1.78
9	300769	德方纳米	2,151,214.00	1.37
10	600549	厦门钨业	1,840,504.00	1.17
11	002460	赣锋锂业	1,766,825.00	1.12
12	002812	恩捷股份	1,136,607.00	0.72
13	688005	容百科技	1,050,748.60	0.67
14	002074	国轩高科	1,016,560.00	0.65
15	300014	亿纬锂能	992,972.00	0.63
16	300919	中伟股份	872,512.00	0.55

17	300450	先导智能	657,251.00	0.42
18	002850	科达利	656,760.00	0.42
19	300037	新宙邦	525,556.00	0.33
20	600938	中国海油	520,920.00	0.33

注：“本期累计买入金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	59,129,413.25
卖出股票收入（成交）总额	61,937,638.39

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本报告期内本基金未进行资产支持证券投资。

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

本报告期内本基金未进行贵金属投资。

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

本报告期内本基金未进行权证投资。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

报告期内未进行股指期货投资

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明



报告期内未进行国债期货投资

## 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监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

赣锋锂业（002460）于2022年6月8日收到深圳证券交易所《关于对江西赣锋锂业股份有限公司的监管函》（编号：公司部监管函【2022】第117号）。根据《关于对江西赣锋锂业股份有限公司的监管函》内容，江西赣锋锂业股份有限公司在信息披露方面存在违规行为。本基金为指数型基金，上述股票系标的指数成份股，投资决策程序符合公司投资制度的规定。除上述证券外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 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

### 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	128,565.48
2	应收清算款	130,618.92
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	259,184.40

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期内本基金未进行可转债的投资。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期内本基金前十名股票中未存在流通受限的股票。

## 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600938	中国海油	1,332,303.44	0.97	新股锁定
2	301139	元道通信	62,997.48	0.05	新股未上市
3	301239	普瑞眼科	58,012.60	0.04	新股未上市
4	301233	盛帮股份	45,796.56	0.03	新股未上市
5	301201	诚达药业	5,079.34	0.00	创业板打新限售

## 7.12.6 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。

## § 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

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
19,782	6,868.55	6,946,490.00	5.11%	128,927,182.00	94.89%

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	史德洪	4,555,300.00	3.35%
2	中信建投证券股份有限公司	3,351,928.00	2.47%
3	陈胜	2,551,745.00	1.88%

4	成都贝德机械有限责任公司	2,000,057.00	1.47%
5	黄孝福	2,000,000.00	1.47%
6	范泽明	1,974,300.00	1.45%
7	董帝銮	1,620,043.00	1.19%
8	广发证券股份有限公司	1,516,896.00	1.12%
9	陈天龙	1,507,043.00	1.11%
10	袁浩文	1,397,300.00	1.03%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2021年08月06日)基金份额总额	352,873,672.00
本报告期期初基金份额总额	157,873,672.00
本报告期基金总申购份额	177,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	199,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	135,873,672.00

## § 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) 2022年1月28日，吴真子女士担任基金管理人督察长，余富材先生不再担任基金管理人督察长。

(2) 2022年2月28日，沈阳女士担任基金管理人副总经理。

(3) 2022年8月25日，吴真子女士不再担任基金管理人督察长，总经理赵建兴先生代为履行督察长职务。

(4) 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、公募基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金的投资策略未发生重大改变。

### 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	
华创证券	2	17,700,834.12	15.19%	12,945.06	15.19%	-
华福证券	3	98,827,133.51	84.81%	72,271.36	84.81%	-

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。

## 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	兴银国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	指定网站	2022-01-24
2	兴银基金管理有限责任公司旗下部分基金 2021 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	2022-01-24
3	兴银基金管理有限责任公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、指定网站	2022-01-29
4	关于旗下基金参与中信建投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	2022-02-15
5	兴银基金管理有限责任公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、指定网站	2022-03-01
6	关于旗下基金在部分代销渠道开通转换、定期定额投资并参与费率优惠活动的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、指定网站	2022-03-31
7	兴银国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金 2021 年年度报告	指定网站	2022-03-21
8	兴银基金管理有限责任公司旗下部分基金 2021 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	2022-03-21
9	兴银基金管理有限责任公司关于旗下全资子公司自有资金申购公司旗下基金的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报	2022-04-06

10	兴银国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金 2022年第1季度报告	指定网站	2022-04-22
11	兴银基金管理有限责任公司旗下部分基金2022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	2022-04-22
12	兴银基金关于面向特定投资者通过直销柜台认、申购旗下所有基金实施费率优惠的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、指定网站	2022-07-02
13	关于旗下基金参与浦发银行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	2022-07-07
14	兴银国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）（2022年第1号）、兴银国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	指定网站、中数平台	2022-07-19
15	兴银国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金 2022年第2季度报告	指定网站	2022-07-21
16	兴银基金管理有限责任公司旗下部分基金2022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	2022-07-21

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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朝阳债券型证券投资基金募集注册的文件
2. 《兴银国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
3. 《兴银国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
4. 《兴银国证新能源车电池交易型开放式指数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

## 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  
二〇二二年八月三十一日