

兴银中证 500 指数增强型证券投资基金

2024 年中期报告

2024 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:浙商银行股份有限公司

报告送出日期:2024 年 08 月 30 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。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年8月29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2024年1月1日起至6月30日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	6
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	7
2.4 信息披露方式	7
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	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
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	12

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	12
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
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	13
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	60
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
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	62
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	62
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	62
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	62
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	62
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62

7.12 投资组合报告附注	62
§ 8 基金份额持有人信息	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	64
§ 9 开放式基金份额变动	64
§ 10 重大事件揭示	64
10.1 基金份额持有人大会决议	65
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	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
10.4 基金投资策略的改变	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	65
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	65
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	65
10.8 其他重大事件	66
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	67
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	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	67
§ 12 备查文件目录	68
12.1 备查文件目录	68
12.2 存放地点	68
12.3 查阅方式	68

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴银中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	兴银中证 500 指数增强	
基金主代码	010253	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 03 月 01 日	
基金管理人	兴银基金管理有限责任公司	
基金托管人	浙商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	90,076,576.64 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	兴银中证 500 指数增强 A	兴银中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	010253	011205
报告期末下属分级基金的份 额总额	31,731,588.47 份	58,344,988.17 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型指数基金，在力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年化跟踪误差不超过 7.75%的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力求实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。	
投资策略	本基金为指数增强型股票基金，采取定量方法进行组合管理，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.75%的基础上，追求获得超越标的指数的回报。本基金主要投资于中证 500 指数的成份股及备选成份股，为了获得超越指数的投资回报，可以在被动跟踪指数的基础上进行一些优化调整，如在一定幅度内减少或增强成份股的权重、替换或者增加一些非成份股。	
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%	
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数类似的风险收益特征。	
	兴银中证 500 指数增强 A	兴银中证 500 指数增强 C
下属分级基金的风险收益特征	风险收益特征同上。	风险收益特征同上。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		兴银基金管理有限责任公司	浙商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴真子	朱巍
	联系电话	86-21-20296358	0571-87659806
	电子邮箱	wzz@hffunds.cn	zsyhzctgb@czbank.com
客户服务电话		40000-96326	95527
传真		86-21-68630069	0571-88268688
注册地址		平潭综合实验区金井湾商务营运中心 6 号楼 11 层 03-3 房	浙江省杭州市萧山区鸿宁路 1788 号
办公地址		中国上海市浦东新区滨江大道 5129 号陆家嘴滨江中心 N1 幢三层、五层	杭州市拱墅区环城西路 76 号
邮政编码		200120	310006
法定代表人		吴若曼	陆建强

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金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	基金管理人和基金托管人办公场所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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（2024 年 01 月 01 日-2024 年 06 月 30 日）	
	兴银中证 500 指数增强 A	兴银中证 500 指数增强 C
本期已实现收益	-926, 233. 62	-1, 812, 747. 56
本期利润	-1, 906, 304. 13	-3, 704, 849. 58
加权平均基金份额本期利润	-0. 0583	-0. 0630
本期加权平均净值利润率	-7. 00%	-7. 61%
本期基金份额净值增长率	-6. 88%	-6. 97%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2024 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	-6,446,881.69	-12,188,776.92
期末可供分配基金份额利润	-0.2032	-0.2089
期末基金资产净值	25,284,706.78	46,156,211.25
期末基金份额净值	0.7968	0.7911
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2024 年 06 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	-20.32%	-20.89%

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴银中证 500 指数增强 A 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-6.29%	0.96%	-6.55%	0.91%	0.26%	0.05%
过去三个月	-4.71%	1.04%	-6.16%	1.09%	1.45%	-0.05%
过去六个月	-6.88%	1.39%	-8.46%	1.53%	1.58%	-0.14%
过去一年	-14.41%	1.10%	-16.71%	1.21%	2.30%	-0.11%
过去三年	-26.17%	1.11%	-26.01%	1.14%	-0.16%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-20.32%	1.10%	-21.09%	1.11%	0.77%	-0.01%

兴银中证 500 指数增强 C 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-6.30%	0.96%	-6.55%	0.91%	0.25%	0.05%
过去三个月	-4.76%	1.04%	-6.16%	1.09%	1.40%	-0.05%
过去六个月	-6.97%	1.39%	-8.46%	1.53%	1.49%	-0.14%
过去一年	-14.59%	1.10%	-16.71%	1.21%	2.12%	-0.11%
过去三年	-26.61%	1.11%	-26.01%	1.14%	-0.60%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-20.89%	1.10%	-21.09%	1.11%	0.20%	-0.01%

效起至今						
------	--	--	--	--	--	--

注：1、本基金成立于 2021 年 3 月 1 日；2、比较基准：中证 500 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。

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



注：1、本基金成立于 2021 年 3 月 1 日；2、比较基准：中证 500 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。

3.3 其他指标

注：无。

§ 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 53 只公开募集证券投资基金，净值总规模超 1200 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		
林学晨	本基金的基金经理	2021-07-16	-	11 年	硕士研究生，特许金融分析师（CFA），具有基金从业资格。曾任湘财证券研究所金融工程分析师。2015 年 7 月加入兴银基金管理有限责任公司，历任中央交易室衍生品交易员、衍生品业务部投资经理助理、投资经理；现任指数与量化投资部基金经理。

注：1、任职日期和离任日期一般情况下指公司做出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 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间交易价差的分析，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

产品主要采用多因子选股策略。其中因子涵盖行业、盈利、成长、规模、估值、风险、市场情绪、分析师预期等多维大类因子及其项下的各细分小类因子。团队根据市场状态的变化和因子研究的最新结论，对因子库和模型进行更新，以能够追踪市场的变动，持续跟踪稳健的优质因子。在上述基础上，兼顾股票本身流动性和风险分散度的同时构建股票投资组合。策略资产组合整体结构稳定，仓位控制灵活，市场适应性强。产品策略研究建立在对历史数据的大规模分析及对未来的高精度预测上，同时严格按照策略执行交易管理及风控。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴银中证 500 指数增强 A 基金份额净值为 0.7968 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-6.88%，同期业绩比较基准收益率为-8.46%；截至报告期末兴银中证 500 指数增强 C 基金份额净值为 0.7911 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-6.97%，同期业绩比较基准收益率为-8.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度 A 股市场经历了漫长调整期，期间防御型资产表现较好，而进攻型资产则受到较大压力。上证 50、上证指数和沪深 300 等大盘蓝筹股表现相对抗跌，科创 50、创业板指和中证 1000 等成长板块跌幅较大。经济内需的改善主要依赖于地产销售的回暖，但二手房成交和价格传导的持续

性有待观察。海外方面，美国经济数据稳健，价格、消费和地产领域出现温和降温迹象，全球制造业 PMI 已现扩张趋势，对我国外需有利。下半年海外流动性或将维持紧平衡，静待美联储降息落地。市场方面，我们下半年看震荡，当前下行空间预计有限，一是有维稳资金，二是陆续会有政策发力。中长期来看，目前市场仍处于低位，各类公司估值普遍较低，很多公司 PB/PE 水平具备吸引力，存在较大的增长潜力，值得投资者关注和把握。

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合规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对兴银基金管理有限责任公司编制和披露的兴银中证 500 指数增强型证券投资基金 2024 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了复核，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：兴银中证 500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	5,478,887.82	4,582,838.77
结算备付金		1,585,696.13	2,166,173.16
存出保证金		389,606.49	290,276.55
交易性金融资产	6.4.7.2	64,298,439.12	76,351,790.94
其中：股票投资		64,298,439.12	76,351,790.94
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	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		151,466.48	58,058.78
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		71,904,096.04	83,449,138.20
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	0.01
应付赎回款		81,854.62	72,695.14
应付管理人报酬		48,255.77	56,253.31
应付托管费		12,063.95	14,063.32
应付销售服务费		7,754.51	9,104.65
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	6.4.7.6	313,249.16	306,971.21
负债合计		463,178.01	459,087.64
净资产:			
实收基金	6.4.7.7	90,076,576.64	97,380,612.29
未分配利润	6.4.7.8	-18,635,658.61	-14,390,561.73
净资产合计		71,440,918.03	82,990,050.56
负债和净资产总计		71,904,096.04	83,449,138.20

注: 报告截止日 2024 年 06 月 30 日, 基金份额总额 90,076,576.64 份。其中兴银中证 500 指数增强 A 基金份额净值 0.7968 元, 基金份额总额 31,731,588.47 份; 兴银中证 500 指数增强 C 基金份额净值 0.7911 元, 基金份额总额 58,344,988.17 份。

6.2 利润表

会计主体: 兴银中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期: 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位: 人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
一、营业总收入		-5,027,975.61	2,819,490.59
1. 利息收入		13,957.99	26,063.77
其中：存款利息收入	6.4.7.9	13,616.89	26,063.77
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		341.10	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-2,172,863.53	43,003.95
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-2,802,072.19	-1,290,517.61
基金投资收益		-	-
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	-114,668.83	254,574.88
股利收益	6.4.7.15	743,877.49	1,078,946.68
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	-2,872,172.53	2,742,094.50
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	3,102.46	8,328.37
减：二、营业总支出		583,178.10	718,011.91
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	302,049.07	394,090.65
2. 托管费	6.4.10.2.2	75,512.27	98,522.63
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	48,388.23	66,241.40
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		-	1,325.65
8. 其他费用	6.4.7.18	157,228.53	157,831.58
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-5,611,153.71	2,101,478.68
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-5,611,153.71	2,101,478.68
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-5,611,153.71	2,101,478.68

6.3 净资产变动表

会计主体：兴银中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	97,380,612.29	-14,390,561.73	82,990,050.56
二、本期期初净资产	97,380,612.29	-14,390,561.73	82,990,050.56
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-7,304,035.65	-4,245,096.88	-11,549,132.53
（一）、综合收益总额	-	-5,611,153.71	-5,611,153.71
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-7,304,035.65	1,366,056.83	-5,937,978.82
其中：1. 基金申购款	7,594,470.59	-1,338,081.48	6,256,389.11
2. 基金赎回款	-14,898,506.24	2,704,138.31	-12,194,367.93
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	90,076,576.64	-18,635,658.61	71,440,918.03
项 目	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	107,675,480.76	-9,777,869.14	97,897,611.62
二、本期期初净资产	107,675,480.76	-9,777,869.14	97,897,611.62
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-6,608,245.72	2,479,097.34	-4,129,148.38
（一）、综合收益总额	-	2,101,478.68	2,101,478.68
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-6,608,245.72	377,618.66	-6,230,627.06
其中：1. 基金申购款	13,827,310.81	-713,906.14	13,113,404.67
2. 基金赎回款	-20,435,556.53	1,091,524.80	-19,344,031.73
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	101,067,235.04	-7,298,771.80	93,768,463.24

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：

吴若曼

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

兴银中证 500 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监许可（2020）3444 号注册募集。《兴银中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2021 年 3 月 1 日生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集规模为 264,037,562.28 份基金份额。本基金的基金管理人为兴银基金管理有限责任公司，基金托管人为浙商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》相关规定以及《兴银中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》等法律文件约定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以标的指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、银行存款、债券（包括国债、中央银行票据、地方政府债、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债、企业债、公司债、超短期融资券、短期融资券、中期票据、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券）、债券回购、股指期货、股票期权、资产支持证券、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金管理人根据相关法律法规可以参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终，在扣除股指期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%。

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的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 6

月 30 日的财务状况、2024 年 1 月 1 日至 2024 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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期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

根据财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

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

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

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日
活期存款	5,478,887.82
等于：本金	5,478,577.16
加：应计利息	310.66
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	5,478,887.82

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 06 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		67,187,055.97	-	64,298,439.12	-2,888,616.85
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		67,187,055.97	-	64,298,439.12	-2,888,616.85

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

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	3,091,800.00	0.00	-	-
—股指期货	3,091,800.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,091,800.00	-	-	-

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《证券投资基金股指期货投资会计核算业务细则（试行）》及《企业会计准则——金融工具列报》的相关规定，“权益衍生工具——股指期货投资”与“证券清算款——股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“权益衍生工具——股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2409	IC2409	3	2,925,120.00	-166,680.00
合计				-166,680.00
减：可抵销期货暂收款				-166,680.00
净额				0.00

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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

注：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

注：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 其他资产

注：本基金本报告期末持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	10.06
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	106,010.57
其中：交易所市场	106,010.57
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	57,228.53
应付指数使用费	150,000.00
合计	313,249.16

6.4.7.7 实收基金

兴银中证 500 指数增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	33,886,165.83	33,886,165.83

本期申购	457,872.50	457,872.50
本期赎回（以“-”号填列）	-2,612,449.86	-2,612,449.86
本期末	31,731,588.47	31,731,588.47

兴银中证 500 指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	63,494,446.46	63,494,446.46
本期申购	7,136,598.09	7,136,598.09
本期赎回（以“-”号填列）	-12,286,056.38	-12,286,056.38
本期末	58,344,988.17	58,344,988.17

6.4.7.8 未分配利润

兴银中证 500 指数增强 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-4,343,906.45	-546,276.21	- 4,890,182.66
本期期初	-4,343,906.45	-546,276.21	- 4,890,182.66
本期利润	-926,233.62	-980,070.51	- 1,906,304.13
本期基金份额交易产生的变动数	323,415.57	26,189.53	349,605.10
其中：基金申购款	-71,597.04	-10,496.01	-82,093.05
基金赎回款	395,012.61	36,685.54	431,698.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,946,724.50	-1,500,157.19	- 6,446,881.69

兴银中证 500 指数增强 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-8,479,481.95	-1,020,897.12	-9,500,379.07
本期期初	-8,479,481.95	-1,020,897.12	-9,500,379.07
本期利润	-1,812,747.56	-1,892,102.02	-3,704,849.58
本期基金份额交易产生的变动数	846,010.57	170,441.16	1,016,451.73
其中：基金申购款	-1,108,920.38	-147,068.05	-1,255,988.43
基金赎回款	1,954,930.95	317,509.21	2,272,440.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-9,446,218.94	-2,742,557.98	- 12,188,776.92

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	5,310.90
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	8,029.17
其他	276.82
合计	13,616.89

注：其他为存出保证金利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益**6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	489,537,532.52
减：卖出股票成本总额	491,808,154.97
减：交易费用	531,449.74
买卖股票差价收入	-2,802,072.19

6.4.7.10.2 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.11 债券投资收益

注：本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益**6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
股指期货投资收益	-113,733.33
减：交易费用	935.50
合计	-114,668.83

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	743,877.49
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	743,877.49

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-2,743,225.86
——股票投资	-2,743,225.86
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-128,946.67
——权证投资	-
————期货投资	-128,946.67
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-2,872,172.53

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	3,093.53
转换费收入	8.93
合计	3,102.46

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
----	---------------------------------------

审计费用	17,446.97
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
指数使用费	100,000.00
合计	157,228.53

6.4.7.19 分部报告

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

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

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

注：本基金与关联方的所有交易均是在正常业务中按照一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例

华福证券	-	-	266,974,048.58	18.29%
------	---	---	----------------	--------

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

注：本基金本报告期及上年可比期间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

注：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 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
关联方名称	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 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	61,751.00	18.86%	61,751.00	43.83%

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。权证交易不计佣金。
2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	302,049.07	394,090.65
其中：应支付销售机构的客户维护费	129,280.78	172,653.33
应支付基金管理人的净管理费	172,768.29	221,437.32

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.8% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值
基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	75,512.27	98,522.63

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：
 $H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$
H 为每日应计提的基金托管费
E 为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴银中证 500 指数增强 A	兴银中证 500 指数增强 C	合计
华福证券	-	1,560.63	1,560.63
兴银基金	-	0.36	0.36
浙商银行	-	2,492.83	2,492.83
合计	-	4,053.82	4,053.82
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴银中证 500 指数增强 A	兴银中证 500 指数增强 C	合计
华福证券	-	1,766.42	1,766.42
兴银基金	-	0.55	0.55
浙商银行	-	3,110.92	3,110.92
合计	-	4,877.89	4,877.89

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.20%，销售服务费计提的计算公式如下：
 $H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$
H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费
E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值
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

注：本基金本报告期及上年度可比期间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

注：本基金本报告期内无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

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

注：基金本报告期内无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

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

兴银中证 500 指数增强 A

份额单位：份

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2021 年 03 月 01 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	2,649,624.28	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份 额	-	-
报告期末持有的基金份额	2,649,624.28	-
报告期末持有的基金份额占基 金总份额比例	2.94%	-

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

注：除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浙商银行股份有限公司	5,478,887.82	5,310.90	7,098,651.77	12,048.10

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内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——固定净值型货币市场基金之外的基金

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024 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

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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

注：本基金于本报告期末和上年度末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

注：本基金本报告期末和上年度末未持有需按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有需按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金于本报告期末和上年度末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

注：本基金本报告期末和上年度末未持有需按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有需按长期信用评级列示的同业存单投资。

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制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券在证券交易所上市或可在银行间同业市场交易，因此除附注 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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金经营活动的现金流量与市场利率变化有一定的相关性，因此利率风险在一定程度上存在。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 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							
货币资	5,478,887.82	-	-	-	-	-	5,478,887.82

金							
结算备付金	1,585,696.13	-	-	-	-	-	1,585,696.13
存出保证金	389,606.49	-	-	-	-	-	389,606.49
交易性金融资产	-	-	-	-	-	64,298,439.12	64,298,439.12
应收申购款	-	-	-	-	-	151,466.48	151,466.48
资产总计	7,454,190.44	-	-	-	-	64,449,905.60	71,904,096.04
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	81,854.62	81,854.62
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	48,255.77	48,255.77
应付托管费	-	-	-	-	-	12,063.95	12,063.95
应付销售服务费	-	-	-	-	-	7,754.51	7,754.51
其他负债	-	-	-	-	-	313,249.16	313,249.16
负债总计	-	-	-	-	-	463,178.01	463,178.01
利率敏感度缺口	7,454,190.44	-	-	-	-	63,986,727.59	71,440,918.03
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	4,582,838.77	-	-	-	-	-	4,582,838.77
结算备付金	2,166,173.16	-	-	-	-	-	2,166,173.16
存出保证金	290,276.55	-	-	-	-	-	290,276.55
交易性金融资产	-	-	-	-	-	76,351,790.94	76,351,790.94

应收申购款	-	-	-	-	-	58,058.78	58,058.78
资产总计	7,039,288.48	-	-	-	-	76,409,849.72	83,449,138.20
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	0.01	0.01
应付赎回款	-	-	-	-	-	72,695.14	72,695.14
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	56,253.31	56,253.31
应付托管费	-	-	-	-	-	14,063.32	14,063.32
应付销售服务费	-	-	-	-	-	9,104.65	9,104.65
其他负债	-	-	-	-	-	306,971.21	306,971.21
负债总计	-	-	-	-	-	459,087.64	459,087.64
利率敏感度缺口	7,039,288.48	-	-	-	-	75,950,762.08	82,990,050.56

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；		
	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 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	-	-
	市场利率下降 25 个基点	-	-

注：于 6 月 30 日，本基金未持有对利率敏感的金融资产与金融负债。因此，市场利率的变动对本基金资产的净值无重大影响。

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。

本基金为指数增强型股票基金，采取定量方法进行组合管理。

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 2024 年 06 月 30 日		上年度末 2023 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	64,298,439.12	90.00	76,351,790.94	92.00
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	64,298,439.12	90.00	76,351,790.94	92.00

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 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上涨 5%	3,552,000.82	2,857,166.30
	沪深 300 指数下跌 5%	-3,552,000.82	-2,857,166.30

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

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	64,298,439.12	76,351,790.94
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	64,298,439.12	76,351,790.94

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 2024 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(2023 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 2024 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	64,298,439.12	89.42
	其中：股票	64,298,439.12	89.42
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	7,064,583.95	9.83
8	其他各项资产	541,072.97	0.75
9	合计	71,904,096.04	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	400,633.00	0.56
B	采矿业	2,408,518.00	3.37
C	制造业	34,749,144.56	48.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,778,457.00	3.89
E	建筑业	2,052,439.00	2.87
F	批发和零售业	439,624.00	0.62
G	交通运输、仓储和邮政业	1,721,767.00	2.41
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,312,505.44	3.24
J	金融业	3,520,523.20	4.93
K	房地产业	80,044.00	0.11
L	租赁和商务服务业	181,286.00	0.25
M	科学研究和技术服务业	450,190.00	0.63
N	水利、环境和公共设施管理业	597,245.00	0.84
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	205,387.00	0.29
R	文化、体育和娱乐业	886,631.96	1.24
S	综合	67,584.00	0.09
	合计	52,851,979.16	73.98

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	33,419.00	0.05
B	采矿业	585,895.00	0.82
C	制造业	7,904,158.56	11.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	422,762.60	0.59
E	建筑业	308,088.00	0.43
F	批发和零售业	368,544.00	0.52
G	交通运输、仓储和邮政业	333,617.00	0.47
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	626,861.50	0.88
J	金融业	366,973.10	0.51

K	房地产业	89,761.00	0.13
L	租赁和商务服务业	181,467.20	0.25
M	科学研究和技术服务业	64,480.00	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	126,620.00	0.18
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	31,793.00	0.04
S	综合	2,020.00	0.00
	合计	11,446,459.96	16.02

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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	占基金资产净值比例 (%)
1	601228	广州港	271,800	828,990.00	1.16
2	600517	国网英大	189,100	818,803.00	1.15
3	300003	乐普医疗	51,200	759,808.00	1.06
4	600820	隧道股份	116,200	758,786.00	1.06
5	600177	雅戈尔	106,200	756,144.00	1.06
6	688772	珠海冠宇	49,834	742,526.60	1.04
7	600872	中炬高新	31,900	723,811.00	1.01
8	600339	中油工程	231,900	723,528.00	1.01
9	600549	厦门钨业	41,800	721,050.00	1.01
10	300558	贝达药业	20,600	670,530.00	0.94
11	002064	华峰化学	91,000	652,470.00	0.91
12	300054	鼎龙股份	26,400	598,752.00	0.84
13	600967	内蒙一机	81,500	586,800.00	0.82
14	300677	英科医疗	21,300	571,053.00	0.80
15	002532	天山铝业	66,100	536,071.00	0.75
16	000683	远兴能源	76,300	527,233.00	0.74
17	601608	中信重工	134,400	512,064.00	0.72
18	600528	中铁工业	64,600	472,872.00	0.66
19	601231	环旭电子	29,000	465,450.00	0.65
20	600315	上海家化	25,900	460,502.00	0.64
21	688516	奥特维	10,985	459,282.85	0.64
22	300207	欣旺达	29,600	449,032.00	0.63

23	600582	天地科技	65,000	447,850.00	0.63
24	300296	利亚德	99,400	447,300.00	0.63
25	300070	碧水源	104,200	436,598.00	0.61
26	601216	君正集团	117,000	431,730.00	0.60
27	000887	中鼎股份	34,600	423,504.00	0.59
28	600578	京能电力	130,600	423,144.00	0.59
29	000598	兴蓉环境	55,800	419,616.00	0.59
30	000830	鲁西化工	35,100	406,809.00	0.57
31	603228	景旺电子	12,700	403,860.00	0.57
32	600583	海油工程	66,900	395,379.00	0.55
33	600968	海油发展	94,700	390,164.00	0.55
34	002128	电投能源	18,300	386,130.00	0.54
35	600521	华海药业	22,600	385,330.00	0.54
36	002557	洽洽食品	13,600	383,384.00	0.54
37	000883	湖北能源	63,000	378,630.00	0.53
38	601058	赛轮轮胎	27,000	378,000.00	0.53
39	601717	郑煤机	25,500	377,400.00	0.53
40	600282	南钢股份	75,700	376,986.00	0.53
41	601139	深圳燃气	54,700	365,396.00	0.51
42	002138	顺络电子	12,900	354,234.00	0.50
43	601611	中国核建	42,600	344,634.00	0.48
44	600062	华润双鹤	17,500	342,650.00	0.48
45	002465	海格通信	32,700	338,772.00	0.47
46	600143	金发科技	50,200	331,822.00	0.46
47	601198	东兴证券	41,300	328,748.00	0.46
48	000050	深天马 A	44,300	322,504.00	0.45
49	601000	唐山港	68,200	320,540.00	0.45
50	300088	长信科技	67,900	319,130.00	0.45
51	300253	卫宁健康	53,500	315,650.00	0.44
52	000739	普洛药业	22,900	310,753.00	0.43
53	300136	信维通信	15,800	309,364.00	0.43
54	002414	高德红外	52,500	309,225.00	0.43
55	002019	亿帆医药	24,900	307,764.00	0.43
56	300009	安科生物	35,500	303,170.00	0.42
57	600361	创新新材	75,000	302,250.00	0.42
58	002984	森麒麟	12,200	293,898.00	0.41
59	002065	东华软件	64,500	291,540.00	0.41
60	002152	广电运通	27,300	285,558.00	0.40
61	000027	深圳能源	39,000	284,700.00	0.40
62	688002	睿创微纳	10,003	279,783.91	0.39
63	000636	风华高科	21,000	274,260.00	0.38
64	000958	电投产融	74,900	274,134.00	0.38
65	688387	信科移动	54,055	272,437.20	0.38

66	603658	安图生物	5,900	271,813.00	0.38
67	002203	海亮股份	33,200	264,936.00	0.37
68	300251	光线传媒	31,300	263,233.00	0.37
69	002384	东山精密	12,700	262,890.00	0.37
70	002507	涪陵榨菜	21,400	262,150.00	0.37
71	688425	铁建重工	71,000	261,280.00	0.37
72	300568	星源材质	31,700	259,940.00	0.36
73	600380	健康元	23,100	258,027.00	0.36
74	002340	格林美	40,300	256,711.00	0.36
75	002153	石基信息	44,700	256,131.00	0.36
76	300676	华大基因	7,200	252,072.00	0.35
77	000932	华菱钢铁	55,400	245,422.00	0.34
78	000778	新兴铸管	69,700	242,556.00	0.34
79	600497	驰宏锌锗	45,300	241,902.00	0.34
80	000825	太钢不锈	71,300	240,994.00	0.34
81	002739	万达电影	19,900	240,591.00	0.34
82	000630	铜陵有色	65,900	237,899.00	0.33
83	000066	中国长城	27,100	237,125.00	0.33
84	601636	旗滨集团	36,600	236,070.00	0.33
85	300002	神州泰岳	28,800	233,856.00	0.33
86	600500	中化国际	66,500	232,085.00	0.32
87	000060	中金岭南	54,521	231,169.04	0.32
88	002508	老板电器	10,400	229,840.00	0.32
89	601555	东吴证券	38,900	229,510.00	0.32
90	603345	安井食品	3,000	222,930.00	0.31
91	000960	锡业股份	13,800	213,762.00	0.30
92	603486	科沃斯	4,500	212,310.00	0.30
93	601567	三星医疗	6,000	210,000.00	0.29
94	002945	华林证券	20,800	207,584.00	0.29
95	600066	宇通客车	8,000	206,400.00	0.29
96	601958	金钼股份	19,800	206,118.00	0.29
97	600399	抚顺特钢	36,500	205,495.00	0.29
98	002294	信立泰	7,700	205,051.00	0.29
99	000039	中集集团	21,900	202,794.00	0.28
100	000400	许继电气	5,800	199,578.00	0.28
101	002926	华西证券	30,000	197,700.00	0.28
102	000559	万向钱潮	43,600	194,456.00	0.27
103	603160	汇顶科技	2,800	192,500.00	0.27
104	300017	网宿科技	23,700	187,230.00	0.26
105	002353	杰瑞股份	5,300	185,924.00	0.26
106	300724	捷佳伟创	3,400	183,634.00	0.26
107	601598	中国外运	32,600	183,538.00	0.26
108	002487	大金重工	7,900	180,752.00	0.25

109	688153	唯捷创芯	4,800	177,600.00	0.25
110	300765	新诺威	7,000	176,610.00	0.25
111	600988	赤峰黄金	10,800	176,472.00	0.25
112	000156	华数传媒	27,300	171,444.00	0.24
113	601118	海南橡胶	37,400	170,170.00	0.24
114	002625	光启技术	9,600	166,560.00	0.23
115	300803	指南针	4,500	163,845.00	0.23
116	001872	招商港口	8,500	163,625.00	0.23
117	600598	北大荒	13,100	163,619.00	0.23
118	300012	华测检测	16,000	160,960.00	0.23
119	002008	大族激光	7,700	160,160.00	0.22
120	002409	雅克科技	2,500	157,275.00	0.22
121	002439	启明星辰	9,000	155,340.00	0.22
122	600901	江苏金租	29,200	147,460.00	0.21
123	000878	云南铜业	11,400	142,044.00	0.20
124	000563	陕国投 A	51,600	141,900.00	0.20
125	600511	国药股份	4,600	141,634.00	0.20
126	600737	中粮糖业	14,700	140,973.00	0.20
127	002966	苏州银行	18,600	139,500.00	0.20
128	301267	华夏眼科	6,700	138,824.00	0.19
129	600060	海信视像	5,600	138,544.00	0.19
130	000997	新大陆	9,800	136,318.00	0.19
131	600352	浙江龙盛	15,800	135,722.00	0.19
132	300567	精测电子	2,400	135,624.00	0.19
133	002831	裕同科技	5,200	133,068.00	0.19
134	300001	特锐德	6,600	132,792.00	0.19
135	600873	梅花生物	13,100	131,262.00	0.18
136	600535	天士力	10,200	128,316.00	0.18
137	600909	华安证券	29,500	124,195.00	0.17
138	002423	中粮资本	16,000	119,840.00	0.17
139	300604	长川科技	4,400	119,548.00	0.17
140	002517	恺英网络	12,300	117,465.00	0.16
141	600863	内蒙华电	24,600	114,144.00	0.16
142	603379	三美股份	2,900	113,506.00	0.16
143	601298	青岛港	11,800	112,808.00	0.16
144	600885	宏发股份	4,000	110,720.00	0.15
145	600299	安迪苏	11,400	110,580.00	0.15
146	600970	中材国际	9,100	109,746.00	0.15
147	603927	中科软	6,000	108,540.00	0.15
148	603893	瑞芯微	1,800	106,506.00	0.15
149	603589	口子窖	2,700	105,813.00	0.15
150	600862	中航高科	5,600	105,168.00	0.15
151	000513	丽珠集团	2,700	100,467.00	0.14

152	603156	养元饮品	4,700	99,969.00	0.14
153	600098	广州发展	15,600	99,840.00	0.14
154	601019	山东出版	8,400	99,288.00	0.14
155	600398	海澜之家	10,700	98,868.00	0.14
156	601666	平煤股份	8,700	97,440.00	0.14
157	601098	中南传媒	7,800	96,876.00	0.14
158	600867	通化东宝	11,500	96,255.00	0.13
159	000728	国元证券	15,600	94,536.00	0.13
160	002958	青农商行	35,100	94,068.00	0.13
161	601997	贵阳银行	17,800	93,806.00	0.13
162	600704	物产中大	21,100	91,574.00	0.13
163	600008	首创环保	33,900	90,852.00	0.13
164	002266	浙富控股	32,500	90,675.00	0.13
165	001203	大中矿业	9,300	89,373.00	0.13
166	002056	横店东磁	7,000	87,290.00	0.12
167	600170	上海建工	39,900	85,785.00	0.12
168	601665	齐鲁银行	17,300	84,943.00	0.12
169	601128	常熟银行	11,160	84,481.20	0.12
170	002608	江苏国信	10,700	82,925.00	0.12
171	300373	扬杰科技	2,100	81,690.00	0.11
172	601928	凤凰传媒	7,401	81,114.96	0.11
173	600348	华阳股份	7,950	79,182.00	0.11
174	601990	南京证券	10,300	79,104.00	0.11
175	002155	湖南黄金	4,300	77,830.00	0.11
176	300776	帝尔激光	1,600	73,536.00	0.10
177	002595	豪迈科技	1,900	72,523.00	0.10
178	000703	恒逸石化	10,100	71,609.00	0.10
179	600529	山东药玻	2,800	70,952.00	0.10
180	300529	健帆生物	2,600	70,746.00	0.10
181	603979	金诚信	1,400	70,742.00	0.10
182	002429	兆驰股份	14,700	70,707.00	0.10
183	603568	伟明环保	3,400	69,972.00	0.10
184	600038	中直股份	1,700	69,887.00	0.10
185	300595	欧普康视	4,400	68,992.00	0.10
186	000967	盈峰环境	16,200	68,526.00	0.10
187	600707	彩虹股份	10,000	68,100.00	0.10
188	600516	方大炭素	15,800	68,098.00	0.10
189	002558	巨人网络	7,200	67,968.00	0.10
190	600977	中国电影	6,300	67,788.00	0.09
191	600673	东阳光	9,600	67,584.00	0.09
192	000998	隆平高科	6,800	66,844.00	0.09
193	600141	兴发集团	3,500	66,780.00	0.09
194	300383	光环新网	7,900	66,755.00	0.09

195	603858	步长制药	4,400	66,660.00	0.09
196	600390	五矿资本	16,300	66,015.00	0.09
197	300861	美畅股份	3,400	65,790.00	0.09
198	603786	科博达	1,000	64,150.00	0.09
199	301358	湖南裕能	2,000	62,920.00	0.09
200	600153	建发股份	7,000	62,510.00	0.09
201	603225	新凤鸣	4,000	62,360.00	0.09
202	600801	华新水泥	4,400	60,500.00	0.08
203	000937	冀中能源	8,900	59,630.00	0.08
204	600755	厦门国贸	8,300	59,511.00	0.08
205	002756	永兴材料	1,600	57,248.00	0.08
206	600483	福能股份	4,900	57,134.00	0.08
207	300866	安克创新	800	56,968.00	0.08
208	002572	索菲亚	3,700	56,721.00	0.08
209	600765	中航重机	2,600	53,040.00	0.07
210	300118	东方日升	4,300	52,030.00	0.07
211	688188	柏楚电子	280	51,674.00	0.07
212	002273	水晶光电	2,900	49,242.00	0.07
213	601577	长沙银行	5,400	44,172.00	0.06
214	688099	晶晨股份	717	42,532.44	0.06
215	300502	新易盛	400	42,220.00	0.06
216	000738	航发控制	2,100	42,147.00	0.06
217	002444	巨星科技	1,700	41,990.00	0.06
218	600879	航天电子	5,400	41,958.00	0.06
219	601179	中国西电	5,200	41,808.00	0.06
220	601108	财通证券	6,200	40,982.00	0.06
221	600350	山东高速	4,600	40,710.00	0.06
222	002078	太阳纸业	2,900	40,455.00	0.06
223	002262	恩华药业	1,700	40,358.00	0.06
224	002028	思源电气	600	40,140.00	0.06
225	002563	森马服饰	6,900	40,089.00	0.06
226	603517	绝味食品	2,600	40,040.00	0.06
227	600316	洪都航空	2,400	39,912.00	0.06
228	000155	川能动力	3,700	39,849.00	0.06
229	002797	第一创业	7,800	39,702.00	0.06
230	603885	吉祥航空	3,600	39,564.00	0.06
231	601168	西部矿业	2,200	39,490.00	0.06
232	601158	重庆水务	8,200	39,360.00	0.06
233	600739	辽宁成大	4,700	39,339.00	0.06
234	301029	怡合达	2,000	39,320.00	0.06
235	000021	深科技	2,600	39,312.00	0.06
236	300146	汤臣倍健	2,900	39,295.00	0.06
237	603179	新泉股份	1,000	39,240.00	0.05

238	002408	齐翔腾达	7,000	39,200.00	0.05
239	600298	安琪酵母	1,400	39,102.00	0.05
240	000988	华工科技	1,300	38,909.00	0.05
241	600329	达仁堂	1,200	38,868.00	0.05
242	000623	吉林敖东	2,900	38,860.00	0.05
243	600642	申能股份	4,400	38,852.00	0.05
244	600096	云天化	2,000	38,840.00	0.05
245	600499	科达制造	4,600	38,778.00	0.05
246	000009	中国宝安	4,500	38,700.00	0.05
247	601966	玲珑轮胎	2,100	38,577.00	0.05
248	688525	佰维存储	600	38,490.00	0.05
249	002531	天顺风能	4,300	38,442.00	0.05
250	603456	九洲药业	2,800	38,416.00	0.05
251	603650	彤程新材	1,300	38,415.00	0.05
252	603868	飞科电器	1,000	38,400.00	0.05
253	600566	济川药业	1,200	38,052.00	0.05
254	001286	陕西能源	3,300	38,049.00	0.05
255	603317	天味食品	3,332	38,018.12	0.05
256	603707	健友股份	3,200	38,016.00	0.05
257	600546	山煤国际	2,600	38,012.00	0.05
258	300888	稳健医疗	1,500	37,950.00	0.05
259	600763	通策医疗	700	37,835.00	0.05
260	300390	天华新能	2,200	37,796.00	0.05
261	300144	宋城演艺	4,700	37,741.00	0.05
262	600580	卧龙电驱	3,100	37,665.00	0.05
263	688385	复旦微电	1,200	37,656.00	0.05
264	600095	湘财股份	6,300	37,548.00	0.05
265	688475	萤石网络	1,100	37,521.00	0.05
266	002185	华天科技	4,600	37,490.00	0.05
267	688778	厦钨新能	1,200	37,488.00	0.05
268	603233	大参林	2,600	37,180.00	0.05
269	002518	科士达	2,100	37,170.00	0.05
270	601965	中国汽研	2,200	37,158.00	0.05
271	603305	旭升集团	3,500	36,960.00	0.05
272	688029	南微医学	600	36,936.00	0.05
273	603939	益丰药房	1,500	36,825.00	0.05
274	300114	中航电测	800	36,200.00	0.05
275	603688	石英股份	1,200	35,532.00	0.05
276	000921	海信家电	1,100	35,464.00	0.05
277	002373	千方科技	3,900	35,373.00	0.05
278	300394	天孚通信	400	35,368.00	0.05
279	600129	太极集团	1,200	34,704.00	0.05
280	603290	斯达半导	400	34,444.00	0.05

281	688032	禾迈股份	298	34,204.44	0.05
282	603883	老百姓	1,820	33,415.20	0.05
283	688234	天岳先进	700	32,844.00	0.05
284	603826	坤彩科技	1,120	32,446.40	0.05
285	003022	联泓新科	2,300	31,533.00	0.04
286	600416	湘电股份	3,100	30,814.00	0.04
287	600827	百联股份	4,100	30,258.00	0.04
288	002683	广东宏大	1,500	30,195.00	0.04
289	002120	韵达股份	3,900	30,186.00	0.04
290	000032	深桑达 A	2,000	29,960.00	0.04
291	601016	节能风电	10,000	29,900.00	0.04
292	000785	居然之家	12,300	29,889.00	0.04
293	600959	江苏有线	11,300	29,832.00	0.04
294	600928	西安银行	9,100	29,757.00	0.04
295	600126	杭钢股份	7,200	29,592.00	0.04
296	603596	伯特利	760	29,564.00	0.04
297	300058	蓝色光标	5,400	29,376.00	0.04
298	600859	王府井	2,500	29,350.00	0.04
299	600839	四川长虹	6,500	29,185.00	0.04
300	000959	首钢股份	10,700	29,104.00	0.04
301	002195	岩山科技	11,500	28,865.00	0.04
302	002939	长城证券	4,300	28,810.00	0.04
303	600925	苏能股份	5,700	28,785.00	0.04
304	002044	美年健康	7,600	28,728.00	0.04
305	688538	和辉光电	14,500	28,710.00	0.04
306	688779	长远锂科	6,200	28,706.00	0.04
307	000818	航锦科技	1,300	28,704.00	0.04
308	002472	双环传动	1,300	28,626.00	0.04
309	300748	金力永磁	2,200	28,512.00	0.04
310	600663	陆家嘴	3,200	28,224.00	0.04
311	002500	山西证券	6,000	28,200.00	0.04
312	601568	北元集团	7,600	28,196.00	0.04
313	002385	大北农	7,300	28,105.00	0.04
314	688567	孚能科技	2,900	27,840.00	0.04
315	600848	上海临港	3,000	27,330.00	0.04
316	600208	新潮中宝	15,500	24,490.00	0.03
317	600392	盛和资源	2,800	24,136.00	0.03
318	300699	光威复材	900	22,347.00	0.03
319	603000	人民网	800	15,992.00	0.02
320	001227	兰州银行	5,200	12,376.00	0.02
321	300285	国瓷材料	300	5,355.00	0.01
322	300037	新宙邦	100	2,856.00	0.00
323	600927	永安期货	200	2,230.00	0.00

324	601077	渝农商行	400	2,008.00	0.00
325	600995	南网储能	200	1,932.00	0.00
326	601866	中远海发	700	1,806.00	0.00
327	600985	淮北矿业	100	1,674.00	0.00
328	600418	江淮汽车	100	1,584.00	0.00
329	600699	均胜电子	100	1,482.00	0.00
330	600998	九州通	10	48.80	0.00

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	占基金资产净值比例 (%)
1	600219	南山铝业	26,900	102,489.00	0.14
2	601018	宁波港	29,700	100,980.00	0.14
3	000975	山金国际	6,000	97,740.00	0.14
4	300783	三只松鼠	4,400	96,228.00	0.13
5	003816	中国广核	20,600	95,378.00	0.13
6	600011	华能国际	9,900	95,238.00	0.13
7	601857	中国石油	9,200	94,944.00	0.13
8	601728	中国电信	15,400	94,710.00	0.13
9	600028	中国石化	14,900	94,168.00	0.13
10	000725	京东方 A	22,600	92,434.00	0.13
11	002583	海能达	22,600	91,982.00	0.13
12	601989	中国重工	18,600	91,698.00	0.13
13	600487	亨通光电	5,800	91,466.00	0.13
14	601899	紫金矿业	5,200	91,364.00	0.13
15	601318	中国平安	2,200	90,992.00	0.13
16	600019	宝钢股份	13,600	90,440.00	0.13
17	600875	东方电气	4,900	90,405.00	0.13
18	601319	中国人保	17,500	90,125.00	0.13
19	300750	宁德时代	500	90,015.00	0.13
20	600320	振华重工	26,300	89,946.00	0.13
21	600406	国电南瑞	3,600	89,856.00	0.13
22	300795	米奥会展	5,100	89,403.00	0.13
23	000758	中色股份	17,500	88,900.00	0.12
24	002661	克明食品	11,900	88,893.00	0.12
25	688210	统联精密	4,000	88,600.00	0.12
26	300375	鹏翎股份	22,700	87,849.00	0.12
27	002613	北玻股份	25,100	87,348.00	0.12
28	002521	齐峰新材	7,400	86,950.00	0.12
29	301097	天益医疗	2,300	86,572.00	0.12
30	300463	迈克生物	7,600	86,488.00	0.12

31	002242	九阳股份	8,200	85,936.00	0.12
32	002881	美格智能	4,300	85,312.00	0.12
33	601968	宝钢包装	18,100	84,708.00	0.12
34	000333	美的集团	1,300	83,850.00	0.12
35	003019	宸展光电	3,310	83,842.30	0.12
36	688136	科兴制药	5,000	83,800.00	0.12
37	002973	侨银股份	9,000	80,460.00	0.11
38	601668	中国建筑	15,000	79,650.00	0.11
39	603668	天马科技	6,910	78,428.50	0.11
40	688489	三未信安	2,900	77,256.00	0.11
41	002062	宏润建设	16,300	56,724.00	0.08
42	300566	激智科技	3,900	54,561.00	0.08
43	300439	美康生物	5,300	48,548.00	0.07
44	002666	德联集团	13,100	47,422.00	0.07
45	300556	丝路视觉	2,800	46,844.00	0.07
46	688768	容知日新	2,000	46,820.00	0.07
47	605128	上海沿浦	1,644	45,851.16	0.06
48	300194	福安药业	12,200	45,628.00	0.06
49	300084	海默科技	8,400	44,940.00	0.06
50	300679	电连技术	1,100	44,253.00	0.06
51	002782	可立克	3,900	43,212.00	0.06
52	300304	云意电气	6,600	42,966.00	0.06
53	000919	金陵药业	6,800	42,568.00	0.06
54	002706	良信股份	6,200	42,532.00	0.06
55	300349	金卡智能	3,500	41,720.00	0.06
56	003005	竞业达	2,000	41,680.00	0.06
57	603020	爱普股份	6,200	41,354.00	0.06
58	603239	浙江仙通	3,000	41,130.00	0.06
59	002020	京新药业	3,900	40,833.00	0.06
60	000920	沃顿科技	5,500	40,315.00	0.06
61	601600	中国铝业	5,200	39,676.00	0.06
62	000850	华茂股份	13,000	39,520.00	0.06
63	688045	必易微	1,300	39,091.00	0.05
64	002536	飞龙股份	4,100	39,032.00	0.05
65	300233	金城医药	2,600	38,792.00	0.05
66	002947	恒铭达	1,100	38,720.00	0.05
67	603766	隆鑫通用	5,700	38,646.00	0.05
68	301171	易点天下	2,600	38,220.00	0.05
69	000166	申万宏源	8,800	37,928.00	0.05
70	603755	日辰股份	1,600	37,008.00	0.05
71	600874	创业环保	6,500	36,335.00	0.05
72	300665	飞鹿股份	7,100	35,997.00	0.05
73	300409	道氏技术	4,200	35,952.00	0.05

74	002250	联化科技	7,400	35,520.00	0.05
75	002877	智能自控	4,800	35,472.00	0.05
76	300331	苏大维格	2,200	35,376.00	0.05
77	605555	德昌股份	1,900	35,359.00	0.05
78	300428	立中集团	1,900	35,321.00	0.05
79	002139	拓邦股份	3,300	35,046.00	0.05
80	600308	华泰股份	11,100	34,854.00	0.05
81	300499	高澜股份	3,200	34,688.00	0.05
82	603583	捷昌驱动	1,700	34,646.00	0.05
83	603856	东宏股份	3,400	34,612.00	0.05
84	002996	顺博合金	5,900	34,515.00	0.05
85	002360	同德化工	6,800	34,408.00	0.05
86	603916	苏博特	5,100	34,221.00	0.05
87	300193	佳士科技	4,600	34,132.00	0.05
88	300246	宝莱特	5,600	33,880.00	0.05
89	300471	厚普股份	4,200	33,096.00	0.05
90	688352	硕中科技	2,900	33,089.00	0.05
91	600094	大名城	8,500	32,895.00	0.05
92	000045	深纺织 A	4,100	32,882.00	0.05
93	601186	中国铁建	3,800	32,566.00	0.05
94	300258	精锻科技	4,000	32,520.00	0.05
95	600405	动力源	8,900	32,129.00	0.04
96	600993	马应龙	1,200	32,004.00	0.04
97	688205	德科立	1,100	31,691.00	0.04
98	600100	同方股份	6,200	31,558.00	0.04
99	002145	中核钛白	9,600	31,488.00	0.04
100	688602	康鹏科技	4,100	31,447.00	0.04
101	600033	福建高速	9,300	31,155.00	0.04
102	600525	长园集团	7,300	31,098.00	0.04
103	600987	航民股份	4,400	31,064.00	0.04
104	002402	和而泰	2,900	31,059.00	0.04
105	600894	广日股份	2,700	31,050.00	0.04
106	605188	国光连锁	4,000	31,000.00	0.04
107	300158	振东制药	8,000	30,560.00	0.04
108	601800	中国交建	3,400	30,396.00	0.04
109	300034	钢研高纳	1,900	30,191.00	0.04
110	002580	圣阳股份	4,900	30,135.00	0.04
111	300303	聚飞光电	6,200	30,132.00	0.04
112	600623	华谊集团	5,200	30,056.00	0.04
113	001213	中铁特货	7,600	30,020.00	0.04
114	603823	百合花	3,100	29,977.00	0.04
115	000601	韶能股份	8,100	29,889.00	0.04
116	002275	桂林三金	2,400	29,784.00	0.04

117	000828	东莞控股	3,300	29,733.00	0.04
118	600409	三友化工	5,900	29,618.00	0.04
119	002121	科陆电子	7,800	29,562.00	0.04
120	002011	盾安环境	3,000	29,490.00	0.04
121	002728	特一药业	3,800	29,450.00	0.04
122	603128	华贸物流	5,100	29,427.00	0.04
123	000607	华媒控股	9,500	29,355.00	0.04
124	300140	节能环境	4,900	29,253.00	0.04
125	600366	宁波韵升	5,600	29,232.00	0.04
126	002376	新北洋	5,400	29,106.00	0.04
127	000030	富奥股份	5,900	28,969.00	0.04
128	688233	神工股份	1,500	28,905.00	0.04
129	600267	海正药业	4,100	28,782.00	0.04
130	600216	浙江医药	2,600	28,548.00	0.04
131	002212	天融信	5,800	28,246.00	0.04
132	002519	银河电子	5,700	27,987.00	0.04
133	688226	威腾电气	1,600	27,968.00	0.04
134	300527	中船应急	4,300	27,821.00	0.04
135	002635	安洁科技	1,800	27,792.00	0.04
136	605007	五洲特纸	2,200	27,786.00	0.04
137	300099	尤洛卡	6,100	27,694.00	0.04
138	301116	益客食品	3,100	27,683.00	0.04
139	002448	中原内配	4,800	27,552.00	0.04
140	603387	基蛋生物	3,500	27,160.00	0.04
141	001322	箭牌家居	3,700	27,047.00	0.04
142	600449	宁夏建材	2,300	27,025.00	0.04
143	300415	伊之密	1,300	27,014.00	0.04
144	002675	东诚药业	2,200	26,972.00	0.04
145	300705	九典制药	1,000	26,740.00	0.04
146	002461	珠江啤酒	3,600	26,712.00	0.04
147	002498	汉缆股份	8,100	26,649.00	0.04
148	002226	江南化工	5,900	26,432.00	0.04
149	600027	华电国际	3,800	26,372.00	0.04
150	300203	聚光科技	2,600	26,234.00	0.04
151	300323	华灿光电	6,000	26,100.00	0.04
152	300379	东方通	3,200	25,856.00	0.04
153	002935	天奥电子	2,140	25,851.20	0.04
154	000534	万泽股份	2,600	25,818.00	0.04
155	300206	理邦仪器	3,000	25,770.00	0.04
156	002204	大连重工	6,000	25,620.00	0.04
157	600210	紫江企业	4,800	25,536.00	0.04
158	605365	立达信	1,600	25,392.00	0.04
159	002241	歌尔股份	1,300	25,363.00	0.04

160	002925	盈趣科技	2,000	25,340.00	0.04
161	002705	新宝股份	1,800	25,326.00	0.04
162	002317	众生药业	2,200	25,146.00	0.04
163	301263	泰恩康	2,000	25,060.00	0.04
164	601678	滨化股份	7,200	25,056.00	0.04
165	300587	天铁股份	6,200	25,048.00	0.04
166	688187	时代电气	500	24,690.00	0.03
167	300482	万孚生物	1,000	24,400.00	0.03
168	600388	龙净环保	2,100	24,381.00	0.03
169	601609	金田股份	4,300	24,338.00	0.03
170	601390	中国中铁	3,700	24,124.00	0.03
171	002697	红旗连锁	5,200	24,076.00	0.03
172	300772	运达股份	2,500	24,000.00	0.03
173	000876	新希望	2,600	23,764.00	0.03
174	002035	华帝股份	3,800	23,674.00	0.03
175	002841	视源股份	800	23,624.00	0.03
176	000059	华锦股份	5,600	23,464.00	0.03
177	603556	海兴电力	500	23,415.00	0.03
178	002648	卫星化学	1,300	23,374.00	0.03
179	601311	骆驼股份	2,900	23,258.00	0.03
180	600422	昆药集团	1,300	23,179.00	0.03
181	002545	东方铁塔	3,400	23,154.00	0.03
182	002027	分众传媒	3,800	23,028.00	0.03
183	601727	上海电气	6,200	22,940.00	0.03
184	688289	圣湘生物	1,300	22,854.00	0.03
185	601700	风范股份	5,200	22,828.00	0.03
186	600782	新钢股份	6,800	22,576.00	0.03
187	601669	中国电建	4,000	22,360.00	0.03
188	300068	南都电源	2,700	22,356.00	0.03
189	600740	山西焦化	5,700	22,344.00	0.03
190	601038	一拖股份	1,400	22,134.00	0.03
191	002475	立讯精密	400	15,724.00	0.02
192	002823	凯中精密	1,200	14,640.00	0.02
193	601838	成都银行	900	13,671.00	0.02
194	603328	依顿电子	1,700	13,362.00	0.02
195	603299	苏盐井神	1,400	13,300.00	0.02
196	600784	鲁银投资	2,800	13,272.00	0.02
197	002046	国机精工	1,300	13,221.00	0.02
198	600000	浦发银行	1,600	13,168.00	0.02
199	600372	中航机载	1,100	13,167.00	0.02
200	000551	创元科技	1,500	13,095.00	0.02
201	601121	宝地矿业	2,300	13,087.00	0.02
202	002106	莱宝高科	1,200	13,080.00	0.02

203	603167	渤海轮渡	1,600	13,072.00	0.02
204	600814	杭州解百	2,200	12,980.00	0.02
205	300403	汉宇集团	1,900	12,977.00	0.02
206	002543	万和电气	1,300	12,948.00	0.02
207	601116	三江购物	1,700	12,937.00	0.02
208	603360	百傲化学	1,100	12,925.00	0.02
209	300170	汉得信息	2,100	12,894.00	0.02
210	300381	溢多利	2,100	12,894.00	0.02
211	600278	东方创业	2,400	12,888.00	0.02
212	000417	合肥百货	3,100	12,865.00	0.02
213	603015	弘讯科技	1,700	12,852.00	0.02
214	002449	国星光电	1,800	12,816.00	0.02
215	000906	浙商中拓	1,900	12,806.00	0.02
216	603693	江苏新能	1,100	12,782.00	0.02
217	002282	博深股份	2,000	12,780.00	0.02
218	600480	凌云股份	1,300	12,779.00	0.02
219	300660	江苏雷利	500	12,760.00	0.02
220	603612	索通发展	1,000	12,760.00	0.02
221	600650	锦江在线	1,800	12,744.00	0.02
222	300388	节能国祯	2,300	12,742.00	0.02
223	603551	奥普科技	1,300	12,740.00	0.02
224	603618	杭电股份	2,900	12,702.00	0.02
225	002540	亚太科技	2,400	12,696.00	0.02
226	600850	电科数字	700	12,670.00	0.02
227	300708	聚灿光电	1,400	12,600.00	0.02
228	301299	卓创资讯	300	12,600.00	0.02
229	600727	鲁北化工	2,000	12,600.00	0.02
230	000973	佛塑科技	3,400	12,546.00	0.02
231	600736	苏州高新	3,000	12,480.00	0.02
232	600846	同济科技	1,800	12,294.00	0.02
233	300532	今天国际	1,000	12,290.00	0.02
234	002674	兴业科技	1,200	12,264.00	0.02
235	603496	恒为科技	500	12,225.00	0.02
236	300396	迪瑞医疗	600	12,186.00	0.02
237	300743	天地数码	900	12,186.00	0.02
238	600132	重庆啤酒	200	12,140.00	0.02
239	603229	奥翔药业	1,200	12,060.00	0.02
240	600826	兰生股份	2,240	12,051.20	0.02
241	600760	中航沈飞	300	12,030.00	0.02
242	605369	拱东医疗	300	11,970.00	0.02
243	002730	电光科技	1,700	11,968.00	0.02
244	001234	泰慕士	700	11,893.00	0.02
245	603096	新经典	700	11,830.00	0.02

246	300634	彩讯股份	700	11,781.00	0.02
247	600926	杭州银行	900	11,745.00	0.02
248	605066	天正电气	2,100	11,697.00	0.02
249	002318	久立特材	500	11,665.00	0.02
250	605507	国邦医药	700	11,655.00	0.02
251	603677	奇精机械	1,000	11,650.00	0.02
252	301280	珠城科技	300	11,640.00	0.02
253	605166	聚合顺	1,100	11,539.00	0.02
254	601126	四方股份	600	11,532.00	0.02
255	600097	开创国际	1,400	11,522.00	0.02
256	002884	凌霄泵业	600	11,520.00	0.02
257	600114	东睦股份	800	11,512.00	0.02
258	600262	北方股份	700	11,501.00	0.02
259	688028	沃尔德	700	11,501.00	0.02
260	603198	迎驾贡酒	200	11,500.00	0.02
261	300631	久吾高科	600	11,490.00	0.02
262	301219	腾远钴业	300	11,478.00	0.02
263	300407	凯发电气	1,500	11,400.00	0.02
264	300378	鼎捷软件	700	11,389.00	0.02
265	300387	富邦股份	1,900	11,381.00	0.02
266	002907	华森制药	900	11,358.00	0.02
267	601616	广电电气	3,900	11,349.00	0.02
268	002296	辉煌科技	1,100	11,341.00	0.02
269	002267	陕天然气	1,500	11,340.00	0.02
270	002779	中坚科技	400	11,336.00	0.02
271	002807	江阴银行	3,000	11,310.00	0.02
272	603258	电魂网络	700	11,305.00	0.02
273	301122	采纳股份	600	11,298.00	0.02
274	603535	嘉诚国际	700	11,298.00	0.02
275	603031	安孚科技	500	11,290.00	0.02
276	603976	正川股份	800	11,288.00	0.02
277	601222	林洋能源	1,800	11,286.00	0.02
278	605376	博迁新材	500	11,285.00	0.02
279	600050	中国联通	2,400	11,280.00	0.02
280	300113	顺网科技	1,100	11,264.00	0.02
281	002839	张家港行	2,800	11,256.00	0.02
282	603116	红蜻蜓	2,500	11,250.00	0.02
283	002616	长青集团	2,600	11,232.00	0.02
284	000690	宝新能源	2,200	11,220.00	0.02
285	002768	国恩股份	600	11,220.00	0.02
286	603903	中持股份	1,600	11,216.00	0.02
287	300404	博济医药	1,400	11,214.00	0.02
288	002442	龙星化工	2,600	11,180.00	0.02

289	600908	无锡银行	2,100	11,172.00	0.02
290	603355	莱克电气	517	11,167.20	0.02
291	600386	北巴传媒	4,000	11,160.00	0.02
292	002066	瑞泰科技	1,400	11,130.00	0.02
293	002598	山东章鼓	1,500	11,130.00	0.02
294	301065	本立科技	700	11,130.00	0.02
295	600717	天津港	2,600	11,102.00	0.02
296	000928	中钢国际	2,000	11,100.00	0.02
297	600794	保税科技	3,500	11,095.00	0.02
298	601326	秦港股份	3,500	11,095.00	0.02
299	300230	永利股份	3,300	11,088.00	0.02
300	002073	软控股份	1,500	11,085.00	0.02
301	688077	大地熊	700	11,081.00	0.02
302	600371	万向德农	1,600	11,072.00	0.02
303	600261	阳光照明	4,100	11,070.00	0.02
304	002393	力生制药	700	11,067.00	0.02
305	600982	宁波能源	3,100	11,067.00	0.02
306	603323	苏农银行	2,300	11,063.00	0.02
307	603025	大豪科技	800	11,056.00	0.02
308	603788	宁波高发	900	11,052.00	0.02
309	603993	洛阳钼业	1,300	11,050.00	0.02
310	600235	民丰特纸	2,400	11,040.00	0.02
311	300802	矩子科技	700	11,039.00	0.02
312	002392	北京利尔	3,500	11,025.00	0.02
313	002286	保龄宝	2,000	11,020.00	0.02
314	000544	中原环保	1,400	11,018.00	0.02
315	603983	丸美股份	400	11,012.00	0.02
316	002476	宝莫股份	3,000	11,010.00	0.02
317	601860	紫金银行	4,400	11,000.00	0.02
318	603041	美思德	1,100	11,000.00	0.02
319	600865	百大集团	1,700	10,999.00	0.02
320	002083	孚日股份	2,600	10,998.00	0.02
321	000517	荣安地产	4,100	10,988.00	0.02
322	600819	耀皮玻璃	2,600	10,972.00	0.02
323	600693	东百集团	3,900	10,959.00	0.02
324	603238	诺邦股份	1,100	10,956.00	0.02
325	603365	水星家纺	700	10,955.00	0.02
326	002061	浙江交科	3,000	10,950.00	0.02
327	002961	瑞达期货	1,000	10,950.00	0.02
328	600790	轻纺城	3,400	10,948.00	0.02
329	603817	海峡环保	2,300	10,948.00	0.02
330	603798	康普顿	1,300	10,946.00	0.02
331	002166	莱茵生物	1,600	10,944.00	0.02

332	002342	巨力索具	3,800	10,944.00	0.02
333	002662	京威股份	3,600	10,944.00	0.02
334	603730	岱美股份	1,100	10,934.00	0.02
335	603321	梅轮电梯	1,600	10,928.00	0.02
336	603919	金徽酒	600	10,902.00	0.02
337	300120	经纬辉开	2,100	10,899.00	0.02
338	600168	武汉控股	2,780	10,897.60	0.02
339	002249	大洋电机	2,300	10,879.00	0.02
340	603999	读者传媒	2,300	10,879.00	0.02
341	603610	麒盛科技	1,100	10,868.00	0.02
342	300453	三鑫医疗	1,700	10,863.00	0.02
343	603173	福斯达	500	10,855.00	0.02
344	000548	湖南投资	2,700	10,854.00	0.02
345	002365	永安药业	1,500	10,830.00	0.02
346	002469	三维化学	1,900	10,830.00	0.02
347	002969	嘉美包装	3,800	10,830.00	0.02
348	688678	福立旺	1,000	10,830.00	0.02
349	002017	东信和平	1,300	10,829.00	0.02
350	600128	苏豪弘业	1,700	10,829.00	0.02
351	000735	罗牛山	2,500	10,825.00	0.02
352	603909	建发合诚	1,300	10,816.00	0.02
353	002054	德美化工	2,200	10,802.00	0.02
354	603269	海鸥股份	1,100	10,802.00	0.02
355	002852	道道全	1,500	10,800.00	0.02
356	002774	快意电梯	1,700	10,795.00	0.02
357	002315	焦点科技	400	10,784.00	0.02
358	002550	千红制药	2,000	10,780.00	0.02
359	000926	福星股份	3,400	10,778.00	0.02
360	601969	海南矿业	1,700	10,778.00	0.02
361	600379	宝光股份	1,300	10,777.00	0.02
362	002998	优彩资源	1,900	10,773.00	0.02
363	603080	新疆火炬	800	10,768.00	0.02
364	600037	歌华有线	1,800	10,764.00	0.02
365	301003	江苏博云	500	10,755.00	0.02
366	603318	水发燃气	1,900	10,754.00	0.02
367	000025	特力 A	800	10,752.00	0.02
368	600125	铁龙物流	1,800	10,746.00	0.02
369	600577	精达股份	2,700	10,719.00	0.02
370	000567	海德股份	1,910	10,715.10	0.01
371	300039	上海凯宝	2,000	10,700.00	0.01
372	600284	浦东建设	2,000	10,680.00	0.01
373	601500	通用股份	2,000	10,680.00	0.01
374	601512	中新集团	1,400	10,668.00	0.01

375	600828	茂业商业	4,500	10,665.00	0.01
376	002112	三变科技	1,200	10,656.00	0.01
377	000589	贵州轮胎	2,100	10,647.00	0.01
378	002860	星帅尔	1,300	10,647.00	0.01
379	603017	中衡设计	1,200	10,632.00	0.01
380	002752	昇兴股份	2,100	10,626.00	0.01
381	000411	英特集团	1,100	10,593.00	0.01
382	688089	嘉必优	800	10,592.00	0.01
383	002277	友阿股份	4,900	10,584.00	0.01
384	000930	中粮科技	2,100	10,563.00	0.01
385	603680	今创集团	1,600	10,560.00	0.01
386	603790	雅运股份	1,100	10,560.00	0.01
387	600513	联环药业	1,300	10,543.00	0.01
388	603897	长城科技	600	10,530.00	0.01
389	603337	杰克股份	400	10,528.00	0.01
390	603727	博迈科	800	10,528.00	0.01
391	603995	甬金股份	600	10,512.00	0.01
392	300110	华仁药业	3,400	10,506.00	0.01
393	603368	柳药集团	600	10,500.00	0.01
394	603819	神力股份	1,000	10,500.00	0.01
395	300384	三联虹普	800	10,496.00	0.01
396	600586	金晶科技	1,800	10,440.00	0.01
397	002215	诺普信	1,400	10,430.00	0.01
398	605118	力鼎光电	700	10,423.00	0.01
399	002034	旺能环境	800	10,408.00	0.01
400	300837	浙矿股份	500	10,380.00	0.01
401	603655	朗博科技	700	10,374.00	0.01
402	000065	北方国际	1,000	10,370.00	0.01
403	002303	美盈森	4,300	10,363.00	0.01
404	600489	中金黄金	700	10,360.00	0.01
405	002237	恒邦股份	900	10,359.00	0.01
406	000923	河钢资源	600	10,332.00	0.01
407	603683	晶华新材	1,300	10,322.00	0.01
408	300638	广和通	600	10,260.00	0.01
409	601199	江南水务	2,100	10,227.00	0.01
410	603611	诺力股份	600	10,224.00	0.01
411	688222	成都先导	900	10,215.00	0.01
412	603266	天龙股份	600	10,152.00	0.01
413	603351	威尔药业	500	10,130.00	0.01
414	300841	康华生物	200	10,128.00	0.01
415	601566	九牧王	1,200	10,104.00	0.01
416	300791	仙乐健康	400	10,080.00	0.01
417	603380	易德龙	500	10,040.00	0.01

418	603908	牧高笛	500	10,030.00	0.01
419	300130	新国都	600	9,984.00	0.01
420	003007	直真科技	400	9,980.00	0.01
421	301290	东星医疗	500	9,955.00	0.01
422	600605	汇通能源	400	9,952.00	0.01
423	603308	应流股份	800	9,936.00	0.01
424	300652	雷迪克	500	9,915.00	0.01
425	603507	振江股份	300	9,846.00	0.01
426	301187	欧圣电气	400	9,700.00	0.01
427	601008	连云港	2,800	9,632.00	0.01
428	003006	百亚股份	400	9,480.00	0.01
429	688201	信安世纪	800	9,448.00	0.01
430	300922	天秦装备	600	7,794.00	0.01
431	300842	帝科股份	200	7,760.00	0.01
432	002081	金螳螂	2,300	6,969.00	0.01
433	601988	中国银行	900	4,158.00	0.01
434	003025	思进智能	300	3,693.00	0.01
435	603039	泛微网络	100	3,176.00	0.00
436	603516	淳中科技	100	3,157.00	0.00
437	600332	白云山	100	2,933.00	0.00
438	000063	中兴通讯	100	2,797.00	0.00
439	600363	联创光电	100	2,752.00	0.00
440	601138	工业富联	100	2,740.00	0.00
441	300607	拓斯达	200	2,724.00	0.00
442	603322	超讯通信	100	2,651.00	0.00
443	605198	安德利	100	2,640.00	0.00
444	301383	天键股份	100	2,612.00	0.00
445	601633	长城汽车	100	2,530.00	0.00
446	301507	民生健康	200	2,524.00	0.00
447	605116	奥锐特	100	2,503.00	0.00
448	600362	江西铜业	100	2,368.00	0.00
449	300435	中泰股份	200	2,354.00	0.00
450	603719	良品铺子	200	2,334.00	0.00
451	603867	新化股份	100	2,333.00	0.00
452	603067	振华股份	200	2,332.00	0.00
453	603187	海容冷链	200	2,332.00	0.00
454	600461	洪城环境	200	2,316.00	0.00
455	600835	上海机电	200	2,302.00	0.00
456	688101	三达膜	200	2,276.00	0.00
457	001208	华菱线缆	300	2,274.00	0.00
458	600188	兖矿能源	100	2,273.00	0.00
459	601328	交通银行	300	2,241.00	0.00
460	603070	万控智造	200	2,238.00	0.00

461	000990	诚志股份	300	2,232.00	0.00
462	600919	江苏银行	300	2,229.00	0.00
463	601939	建设银行	300	2,220.00	0.00
464	600602	云赛智联	200	2,208.00	0.00
465	603155	新亚强	200	2,192.00	0.00
466	002462	嘉事堂	200	2,188.00	0.00
467	601288	农业银行	500	2,180.00	0.00
468	601208	东材科技	300	2,178.00	0.00
469	301370	国科恒泰	200	2,174.00	0.00
470	600251	冠农股份	300	2,172.00	0.00
471	601881	中国银河	200	2,172.00	0.00
472	000815	美利云	300	2,157.00	0.00
473	605056	咸亨国际	200	2,156.00	0.00
474	603888	新华网	100	2,151.00	0.00
475	601816	京沪高铁	400	2,148.00	0.00
476	600273	嘉化能源	300	2,142.00	0.00
477	605268	王力安防	300	2,139.00	0.00
478	603901	永创智能	300	2,127.00	0.00
479	600223	福瑞达	300	2,121.00	0.00
480	600929	雪天盐业	400	2,120.00	0.00
481	002104	恒宝股份	400	2,112.00	0.00
482	603158	腾龙股份	300	2,112.00	0.00
483	000779	甘咨询	300	2,103.00	0.00
484	600789	鲁抗医药	300	2,100.00	0.00
485	605389	长龄液压	100	2,099.00	0.00
486	600237	铜峰电子	400	2,088.00	0.00
487	601009	南京银行	200	2,078.00	0.00
488	603200	上海洗霸	100	2,078.00	0.00
489	600640	国脉文化	200	2,070.00	0.00
490	300314	戴维医疗	200	2,068.00	0.00
491	600229	城市传媒	300	2,067.00	0.00
492	601061	中信金属	300	2,061.00	0.00
493	600997	开滦股份	300	2,058.00	0.00
494	603915	国茂股份	200	2,058.00	0.00
495	002952	亚世光电	100	2,055.00	0.00
496	688588	凌志软件	300	2,055.00	0.00
497	600057	厦门象屿	300	2,040.00	0.00
498	600330	天通股份	300	2,040.00	0.00
499	601658	邮储银行	400	2,028.00	0.00
500	002036	联创电子	300	2,025.00	0.00
501	600805	悦达投资	500	2,020.00	0.00
502	601368	绿城水务	500	2,020.00	0.00
503	601998	中信银行	300	2,010.00	0.00

504	603118	共进股份	300	2,010.00	0.00
505	603703	盛洋科技	200	2,006.00	0.00
506	300005	探路者	400	2,004.00	0.00
507	600178	东安动力	200	2,004.00	0.00
508	000863	三湘印象	500	2,000.00	0.00
509	002643	万润股份	200	2,000.00	0.00
510	600588	用友网络	200	2,000.00	0.00
511	002941	新疆交建	200	1,996.00	0.00
512	600682	南京新百	400	1,996.00	0.00
513	600295	鄂尔多斯	200	1,984.00	0.00
514	603270	金帝股份	100	1,984.00	0.00
515	600367	红星发展	200	1,982.00	0.00
516	600523	贵航股份	200	1,980.00	0.00
517	301017	漱玉平民	200	1,968.00	0.00
518	600776	东方通信	200	1,966.00	0.00
519	605337	李子园	200	1,964.00	0.00
520	600834	申通地铁	300	1,962.00	0.00
521	603223	恒通股份	300	1,956.00	0.00
522	605199	葫芦娃	200	1,950.00	0.00
523	300248	新开普	300	1,947.00	0.00
524	002510	天汽模	500	1,945.00	0.00
525	600531	豫光金铅	300	1,932.00	0.00
526	600015	华夏银行	300	1,920.00	0.00
527	601606	长城军工	200	1,912.00	0.00
528	002386	天原股份	500	1,910.00	0.00
529	603315	福鞍股份	200	1,908.00	0.00
530	603520	司太立	200	1,908.00	0.00
531	002042	华孚时尚	500	1,905.00	0.00
532	600016	民生银行	500	1,895.00	0.00
533	600825	新华传媒	500	1,895.00	0.00
534	600552	凯盛科技	200	1,886.00	0.00
535	600478	科力远	500	1,885.00	0.00
536	603588	高能环境	300	1,884.00	0.00
537	600880	博瑞传播	500	1,880.00	0.00
538	600292	远达环保	400	1,876.00	0.00
539	603777	来伊份	200	1,874.00	0.00
540	300846	首都在线	200	1,872.00	0.00
541	002544	普天科技	100	1,869.00	0.00
542	603399	永杉锂业	300	1,857.00	0.00
543	002923	润都股份	200	1,852.00	0.00
544	300797	钢研纳克	200	1,852.00	0.00
545	300968	格林精密	200	1,852.00	0.00
546	600797	浙大网新	400	1,852.00	0.00

547	002161	远望谷	400	1,848.00	0.00
548	603629	利通电子	100	1,846.00	0.00
549	000910	大亚圣象	300	1,842.00	0.00
550	300397	天和防务	200	1,840.00	0.00
551	601101	昊华能源	200	1,838.00	0.00
552	603357	设计总院	200	1,838.00	0.00
553	002344	海宁皮城	600	1,836.00	0.00
554	603273	天元智能	100	1,835.00	0.00
555	605133	嵘泰股份	100	1,833.00	0.00
556	600851	海欣股份	400	1,828.00	0.00
557	605179	一鸣食品	200	1,826.00	0.00
558	002681	奋达科技	500	1,825.00	0.00
559	600030	中信证券	100	1,823.00	0.00
560	603018	华设集团	200	1,818.00	0.00
561	600279	重庆港	500	1,815.00	0.00
562	603890	春秋电子	200	1,812.00	0.00
563	605018	长华集团	200	1,812.00	0.00
564	600973	宝胜股份	500	1,805.00	0.00
565	601952	苏垦农发	200	1,804.00	0.00
566	002170	芭田股份	300	1,803.00	0.00
567	600395	盘江股份	300	1,803.00	0.00
568	603912	佳力图	300	1,800.00	0.00
569	688033	天宜上佳	300	1,800.00	0.00
570	002527	新时达	300	1,797.00	0.00
571	600795	国电电力	300	1,797.00	0.00
572	600123	兰花科创	200	1,790.00	0.00
573	603085	天成自控	200	1,788.00	0.00
574	300307	慈星股份	300	1,785.00	0.00
575	300128	锦富技术	600	1,782.00	0.00
576	300131	英唐智控	400	1,780.00	0.00
577	600648	外高桥	200	1,772.00	0.00
578	002416	爱施德	200	1,770.00	0.00
579	605319	无锡振华	100	1,770.00	0.00
580	605050	福然德	200	1,762.00	0.00
581	002379	宏创控股	300	1,758.00	0.00
582	603733	仙鹤股份	100	1,758.00	0.00
583	600990	四创电子	100	1,755.00	0.00
584	301028	东亚机械	200	1,754.00	0.00
585	601169	北京银行	300	1,752.00	0.00
586	603060	国检集团	300	1,752.00	0.00
587	600081	东风科技	200	1,750.00	0.00
588	600617	国新能源	700	1,750.00	0.00
589	600629	华建集团	400	1,744.00	0.00

590	600335	国机汽车	300	1,731.00	0.00
591	600502	安徽建工	400	1,720.00	0.00
592	300341	麦克奥迪	200	1,716.00	0.00
593	600035	楚天高速	400	1,716.00	0.00
594	603815	交建股份	300	1,716.00	0.00
595	605228	神通科技	200	1,716.00	0.00
596	600488	津药药业	500	1,715.00	0.00
597	600336	澳柯玛	400	1,712.00	0.00
598	300213	佳讯飞鸿	300	1,710.00	0.00
599	601398	工商银行	300	1,710.00	0.00
600	300291	百纳千成	400	1,704.00	0.00
601	600184	光电股份	200	1,702.00	0.00
602	601200	上海环境	200	1,700.00	0.00
603	601068	中铝国际	400	1,684.00	0.00
604	600829	人民同泰	300	1,683.00	0.00
605	300263	隆华科技	300	1,680.00	0.00
606	603936	博敏电子	200	1,680.00	0.00
607	002454	松芝股份	300	1,677.00	0.00
608	300322	硕贝德	200	1,676.00	0.00
609	603861	白云电器	200	1,674.00	0.00
610	603626	科森科技	300	1,668.00	0.00
611	300569	天能重工	400	1,664.00	0.00
612	002026	山东威达	200	1,660.00	0.00
613	600509	天富能源	300	1,653.00	0.00
614	002187	广百股份	400	1,652.00	0.00
615	603222	济民医疗	300	1,650.00	0.00
616	603689	皖天然气	200	1,644.00	0.00
617	605388	均瑶健康	300	1,644.00	0.00
618	688247	宣泰医药	200	1,644.00	0.00
619	600628	新世界	300	1,626.00	0.00
620	605299	舒华体育	200	1,624.00	0.00
621	603708	家家悦	200	1,622.00	0.00
622	300493	润欣科技	200	1,618.00	0.00
623	605218	伟时电子	100	1,615.00	0.00
624	600645	中源协和	100	1,610.00	0.00
625	603676	卫信康	200	1,602.00	0.00
626	001267	汇绿生态	300	1,581.00	0.00
627	600039	四川路桥	200	1,578.00	0.00
628	002788	鹭燕医药	200	1,576.00	0.00
629	603636	南威软件	200	1,540.00	0.00
630	600158	中体产业	200	1,538.00	0.00
631	002988	豪美新材	100	1,535.00	0.00
632	603686	福龙马	200	1,524.00	0.00

633	603758	秦安股份	200	1,520.00	0.00
634	603108	润达医疗	100	1,514.00	0.00
635	300434	金石亚药	200	1,500.00	0.00
636	600195	中牧股份	200	1,498.00	0.00
637	603065	宿迁联盛	200	1,494.00	0.00
638	600742	一汽富维	200	1,490.00	0.00
639	601788	光大证券	100	1,462.00	0.00
640	603217	元利科技	100	1,410.00	0.00
641	601698	中国卫通	100	1,409.00	0.00
642	002189	中光学	100	1,394.00	0.00
643	603211	晋拓股份	100	1,371.00	0.00
644	600562	国睿科技	100	1,366.00	0.00
645	603738	泰晶科技	100	1,364.00	0.00
646	605368	蓝天燃气	100	1,364.00	0.00
647	300229	拓尔思	100	1,343.00	0.00
648	300872	天阳科技	100	1,325.00	0.00
649	301277	新天地	100	1,298.00	0.00
650	603739	蔚蓝生物	100	1,292.00	0.00
651	605158	华达新材	200	1,286.00	0.00
652	603439	贵州三力	100	1,276.00	0.00
653	603035	常熟汽饰	100	1,268.00	0.00
654	600452	涪陵电力	100	1,267.00	0.00
655	603206	嘉环科技	100	1,263.00	0.00
656	600897	厦门空港	100	1,261.00	0.00
657	603848	好太太	100	1,259.00	0.00
658	603135	中重科技	100	1,253.00	0.00
659	600055	万东医疗	100	1,235.00	0.00
660	603881	数据港	90	1,143.90	0.00
661	002182	宝武镁业	80	902.40	0.00
662	000153	丰原药业	60	322.80	0.00
663	688369	致远互联	20	314.60	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	000563	陕国投 A	1,928,386.00	2.32
2	600339	中油工程	1,900,766.00	2.29
3	600177	雅戈尔	1,878,445.00	2.26
4	000932	华菱钢铁	1,826,371.00	2.20
5	600820	隧道股份	1,753,093.00	2.11

6	600867	通化东宝	1,752,148.00	2.11
7	600968	海油发展	1,750,798.00	2.11
8	600998	九州通	1,716,795.00	2.07
9	002925	盈趣科技	1,686,302.00	2.03
10	600873	梅花生物	1,673,865.00	2.02
11	688772	珠海冠宇	1,652,497.37	1.99
12	002203	海亮股份	1,600,849.00	1.93
13	600060	海信视像	1,594,788.00	1.92
14	002128	电投能源	1,588,027.00	1.91
15	600126	杭钢股份	1,585,649.00	1.91
16	600549	厦门钨业	1,545,535.00	1.86
17	601000	唐山港	1,537,355.00	1.85
18	601228	广州港	1,535,909.00	1.85
19	600282	南钢股份	1,532,881.00	1.85
20	000887	中鼎股份	1,501,871.00	1.81

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	002925	盈趣科技	2,192,229.00	2.64
2	002273	水晶光电	2,067,948.00	2.49
3	000563	陕国投 A	1,945,926.00	2.34
4	600998	九州通	1,938,571.44	2.34
5	600060	海信视像	1,869,993.00	2.25
6	000598	兴蓉环境	1,838,733.00	2.22
7	601991	大唐发电	1,809,762.00	2.18
8	600126	杭钢股份	1,798,783.00	2.17
9	600131	国网信通	1,780,653.00	2.15
10	600863	内蒙华电	1,780,418.00	2.15
11	601000	唐山港	1,757,984.00	2.12
12	600867	通化东宝	1,739,135.00	2.10
13	600873	梅花生物	1,705,528.00	2.06
14	600282	南钢股份	1,704,022.00	2.05
15	600901	江苏金租	1,699,654.00	2.05
16	000932	华菱钢铁	1,640,549.00	1.98
17	600497	驰宏锌锗	1,599,221.00	1.93
18	002867	周大生	1,595,839.00	1.92
19	002128	电投能源	1,591,078.00	1.92
20	002958	青农商行	1,582,010.00	1.91

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	482,498,029.01
卖出股票收入（成交）总额	489,537,532.52

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

运用衍生品捕捉利率变动的波段交易机会，并通过期现套利、跨期套利和跨品种套利等择机增厚收益，同时灵活调整组合敞口，控制回撤。

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 本期国债期货投资评价

无。

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

报告期内，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	389,606.49
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	151,466.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	541,072.97

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限的情况。

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

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中未存在流通受限的情况。

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

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例

兴银中证 500 指数增强 A	1,512	20,986.5	2,649,624.28	8.35%	29,081,964.19	91.65%
兴银中证 500 指数增强 C	14,420	4,046.12	0.00	0.00%	58,344,988.17	100%
合计	15,932	5,653.81	2,649,624.28	2.94%	87,426,952.36	97.06%

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	兴银中证 500 指数增强 A	43,553.24	0.137255%
	兴银中证 500 指数增强 C	41,908.8	0.071829%
	合计	85,462.04	0.094877%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	兴银中证 500 指数增强 A	0
	兴银中证 500 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	兴银中证 500 指数增强 A	0~10
	兴银中证 500 指数增强 C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	兴银中证 500 指数增强 A	兴银中证 500 指数增强 C
基金合同生效日（2021 年 03 月 01 日）基金份额总额	120,603,411.79	143,434,150.49
本报告期期初基金份额总额	33,886,165.83	63,494,446.46
本报告期基金总申购份额	457,872.50	7,136,598.09
减：本报告期基金总赎回份额	2,612,449.86	12,286,056.38
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	31,731,588.47	58,344,988.17

§ 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) 2024 年 4 月 19 日，吴真子担任基金管理人督察长，郑瑞健不再担任基金管理人督察长。

(2) 2024 年 7 月 22 日，董事长吴若曼代任基金管理人总经理，赵建兴不再担任基金管理人总经理。

(3) 2024 年 7 月 22 日，陈晓毅担任基金管理人首席信息官，赵建兴不再担任基金管理人首席信息官。

(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、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

无。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），报告期内无改聘情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人及其高级管理人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2024 年 04 月 30 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会上海监管局
受到的具体措施类型	警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	未严格执行公司制度
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已完成整改
其他	无

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	675,617,263.25	69.51%	166,099.13	74.09%	-
招商证券	2	296,418,298.28	30.49%	58,077.53	25.91%	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	2	-	-	-	-	-

注：1、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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	1,000,000.00	100.00%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	兴银基金管理有限责任公司旗下基金 2023 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	2024-01-20
2	兴银中证 500 指数增强型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	指定网站	2024-01-20
3	兴银基金管理有限责任公司旗下部分基金 2023 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	2024-03-28
4	兴银中证 500 指数增强型证券投资基金 2023 年年度报告	指定网站	2024-03-28
5	关于旗下部分基金参与万得基金费率优惠活动并开通定期定额投资的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、指定网站	2024-04-19
6	兴银基金管理有限责任公司关于督察长变更的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、指定网站	2024-04-20
7	兴银中证 500 指数增强型证券投资基金 2024 年 1 季度报告	指定网站	2024-04-20
8	兴银基金管理有限责任公司旗下基金 2024 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	2024-04-20
9	关于旗下部分基金在济安财富（北京）基金销售有限公司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	2024-04-22
10	兴银基金管理有限责任公司关于暂停海银基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、指定网站	2024-06-12
11	关于兴银基金管理有限责任公司旗下基金调整股票估值方法的提示性公告	上海证券报、证券时报、证券日报、中国证券报、指定网站	2024-06-19
12	兴银中证 500 指数增强型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	指定网站、中数平台	2024-06-20

§ 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

注：本基金本报告期内单一投资者持有基金份额比例未出现超过 20%的情况。

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聚瑞债券型证券投资基金变更注册为兴银中证 500 指数增强型证券投资基金的文件
2. 《兴银中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》
3. 《兴银中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》
4. 《兴银中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照
6. 报告期内在指定信息披露媒体上公开披露的各项公告
7. 中国证监会规定的其他备查文件

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

二〇二四年八月三十日