

# 兴业成长动力灵活配置混合型证券投资基金

## 2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:兴业基金管理有限公司

基金托管人:中国银行股份有限公司

送出日期:2023 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、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的法律责任。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。基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年1月1日起至2023年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                         | 5  |
| 2.4 信息披露方式                              | 6  |
| 2.5 其他相关资料                              | 6  |
| §3 主要财务指标和基金净值表现                        | 6  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6  |
| 3.2 基金净值表现                              | 7  |
| §4 管理人报告                                | 8  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 8  |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 9  |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 10 |
| 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             | 10 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 10 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 11 |
| 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                                | 12 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 12 |
| 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 | 12 |
| 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                                 | 15 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表                        | 16 |
| 6.4 报表附注                                | 19 |
| §7 投资组合报告                               | 43 |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 43 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 44 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细       | 45 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 50 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 59 |
| 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      | 60 |
| 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   | 60 |
| 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   | 60 |
| 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      | 60 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策                     | 60 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明               | 60 |
| 7.12 投资组合报告附注                           | 61 |
| §8 基金份额持有人信息                            | 62 |

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

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                     |
|------------|---------------------|
| 基金名称       | 兴业成长动力灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称       | 兴业成长动力混合            |
| 基金主代码      | 002597              |
| 基金运作方式     | 契约型开放式              |
| 基金合同生效日    | 2016年06月03日         |
| 基金管理人      | 兴业基金管理有限公司          |
| 基金托管人      | 中国银行股份有限公司          |
| 报告期末基金份额总额 | 133,681,438.94份     |
| 基金合同存续期    | 不定期                 |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金通过灵活的资产配置，基于对企业内在价值的深入研究，重点投资于质地优秀且未来预期成长性良好的上市公司，在充分控制风险和保证流动性的基础上，力争实现基金资产的长期稳健增值。   |
| 投资策略   | 本基金将结合国内外宏观经济环境、货币财政政策形势、证券市场走势的综合分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置，确定在不同时期和阶段基金在股票、债券等各类资产的投资比例，以最大限度地降低投资组合的风险、提高投资组合的收益。本基金的投资策略包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、权证投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 中证500指数收益率×55%+中证全债指数收益率×45%。   |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。   |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

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

|         |                         |                         |                           |
|---------|-------------------------|-------------------------|---------------------------|
| 名称      | 兴业基金管理有限公司              | 中国银行股份有限公司              |                           |
| 信息披露负责人 | 姓名                      | 张玲菡                     | 许俊                        |
|         | 联系电话                    | 021-22211888            | 010-66596688              |
|         | 电子邮箱                    | zhaoyue@cib-fund.com.cn | fxjd_hq@bank-of-china.com |
| 客户服务电话  | 40000-95561             | 95566                   |                           |
| 传真      | 021-22211997            | 010-66594942            |                           |
| 注册地址    | 福建省福州市鼓楼区五四路137号信和广场25楼 | 北京市西城区复兴门内大街1号          |                           |
| 办公地址    | 上海市浦东新区银城路167号13、14层    | 北京市西城区复兴门内大街1号          |                           |
| 邮政编码    | 200120                  | 100818                  |                           |
| 法定代表人   | 叶文煌                     | 葛海蛟                     |                           |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                      |
|---------------------|----------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 证券日报                 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.cib-fund.com.cn  |
| 基金中期报告备置地点          | 上海市浦东新区银城路167号13、14层 |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称         | 办公地址              |
|--------|------------|-------------------|
| 注册登记机构 | 兴业基金管理有限公司 | 上海市浦东新区银城路167号13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<br>(2023年01月01日-2023年06月30日) |
|---------------|----------------------------------|
| 本期已实现收益       | 18,362,849.01                    |

|                      |                       |
|----------------------|-----------------------|
| 本期利润                 | 19,609,825.97         |
| 加权平均基金份额本期利润         | 0.1416                |
| 本期加权平均净值利润率          | 10.86%                |
| 本期基金份额净值增长率          | 11.54%                |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | 报告期末<br>(2023年06月30日) |
| 期末可供分配利润             | 40,833,165.09         |
| 期末可供分配基金份额利润         | 0.3055                |
| 期末基金资产净值             | 174,514,604.03        |
| 期末基金份额净值             | 1.305                 |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b>  | 报告期末<br>(2023年06月30日) |
| 基金份额累计净值增长率          | 58.09%                |

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。

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、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，不是当期发生数）。

### 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 | -0.84%   | 0.79%       | -0.18%     | 0.51%         | -0.66% | 0.28% |
| 过去三个月 | -1.66%   | 0.99%       | -2.09%     | 0.45%         | 0.43%  | 0.54% |
| 过去六个月 | 11.54%   | 1.05%       | 2.69%      | 0.43%         | 8.85%  | 0.62% |
| 过去一年  | -3.26%   | 0.94%       | -1.71%     | 0.53%         | -1.55% | 0.41% |
| 过去三年  | 17.89%   | 1.29%       | 8.45%      | 0.65%         | 9.44%  | 0.64% |

|            |        |       |        |       |        |       |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 自基金合同生效起至今 | 58.09% | 1.11% | 17.95% | 0.70% | 40.14% | 0.41% |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|

注：本基金的业绩比较基准为：中证500指数收益率\*55%+中证全债指数收益率\*45%。

### 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



## §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

兴业基金管理有限公司（以下简称“兴业基金”或“公司”）成立于2013年4月17日，是兴业银行控股的全国性基金管理公司。公司注册资本12亿元人民币，其中，兴业银行出资10.8亿元，持股比例90%，中海集团投资有限公司出资1.2亿元，持股比例10%。公司业务范围包括基金募集、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。目前，兴业基金已在北京、上海、深圳、福州等地设立分公司，并全资拥有基金子公司--兴业财富资产管理有限公司。

站在新时代的潮头浪尖，兴业基金坚守“受人之托、代客理财”的初心本源，坚守“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化，以“市场化、专业化、数字化”为转型方向，



不断提升主动管理能力，打磨产品线，强化核心竞争力，提升权益投资能力，巩固扩大固收优势并增强特色业务，致力于为广大投资者创造长期良好收益，为中国实体经济健康发展贡献自身应有力量。截至2023年6月30日，兴业基金共管理87只公募基金。

#### 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 |        |  |
| 高圣 | 基金经理 | 2018-03-02      | -    | 14年    | 中国籍，硕士学位，特许金融分析师（CFA），金融风险管理师(FRM), 具有证券投资基金从业资格。2009年4月至2012年7月在华泰证券股份有限公司研究所担任行业分析师，从事行业及公司研究。2012年7月至2017年8月在海通证券股份有限公司权益投资交易部担任行业公司研究岗位，从事股票投资研究工作。2017年9月加入兴业基金管理有限公司，现任基金经理。 |

1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期，除首任基金经理外，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，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。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的基金和投资组合。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

### 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

2023年上半年A股市场总体呈现为区间震荡，上证指数、深证成指小幅上涨，而创业板指有所下跌。一季度上旬，疫情管控放开后国内经济显著复苏，市场对未来经济修复的预期也更为乐观，因而顺周期的消费、金融、机械、地产链等表现较好；随后因后续经济数据略低于市场的乐观预期，以上板块从一季度中旬开始出现一定幅度调整；同时主题投资开始活跃，其中以CHATGPT为代表的人工智能成为市场最大热点，通信、传媒、计算机、电子行业的一批相关个股获得较大涨幅。5月下旬开始，人形机器人板块也开始活跃，成为市场另一热点。

本基金在2022年底已经布局消费、金融、计算机和传媒等板块，今年2月初顺周期板块表现较好时，本基金按此前既定投资策略，进行止盈操作，逐步减配顺周期的消费、金融，并增加了对计算机、通信、电子板块的配置；之后5月开始，随着TMT板块表现突出，本基金再次按既定策略，减配了TMT板块，并对组合进行了均衡配置，增加了2季度调整较多的顺周期的化工、金融、消费板块等板块的配置。本基金在个股配置方面相对分散，在行业方面的配置也总体较为分散和均衡。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴业成长动力混合基金份额净值为1.305元，本报告期内，基金份额净值增长率为11.54%，同期业绩比较基准收益率为2.69%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2023年下半年，国内宏观经济的渐进式温和复苏仍然值得期待。国内政策也在根据经济发展形势进行积极的调整，政策在巩固经济稳定增长方面仍有一定的发力空

间，促消费方面的政策开始逐步出台，居民的消费信心在逐步恢复。自2021年三季度以来，宏观经济进入去库存周期已有数个季度，前期库存周期与价格下行带来的压力或将逐步缓解，目前上市公司库存增速已经降至了历史较低水平，其所代表的大型企业或将率先走出去库周期，开启补库进程，而工业企业库存周期也有望在下半年逐步看到拐点，库存周期的企稳回升将会是下半年经济方面最值得期待的变化之一。

从估值角度看A股具有中长期重要的配置机会。目前A股股息率与10年国债到期收益率比值处于近年来的高区域，权益资产估值处于接近绝对底部位置，显示A股市场整体具有较高的风险补偿水平，整体上看具有很重要的配置机会，因此我们对A股中长期的投资机会持偏乐观的态度，我们积极配置权益资产，保持较高的权益资产配置比例。

我们依然认为经济复苏和科技进步有望成为2023年下半年A股重要的投资方向。具体来看，1.经济复苏方面：2023年上半年尽管国内经济复苏的力度低于市场的乐观预期，但经济仍处于温和复苏的过程中，企业的库存在下降，盈利能力见底回升，总体宏观形势依然向好。从中长期维度看顺周期的行业存在投资机会，目前其经过上半年的下跌调整后，拉上时间维度来看，未来潜在回报率在逐步提升。特别是顺周期板块中的一些行业经历了过去一段时间的需求减弱竞争加剧，弱势企业逐步淘汰出局，剩下的企业面临的竞争格局更优，未来供需双重改善下这些行业发展态势优良。我们将在以上板块中深入挖掘个股进行配置。2.科技进步方面：过去三年，新能源领域的科技进步较多，在A股市场演绎的酣畅淋漓，2023年上半年开始人工智能领域的科技进步显著，相关板块在美股和A股市场均表现突出，尽管其中部分个股已经处于估值的高位，但由于人工智能的发展空间巨大，其中仍然存在可以挖掘的机会。此外，人形机器人、自动驾驶领域也存在科技的突破，也适合深耕挖掘其中的机会。长周期看，我国经济发展当下的基本特征已由高速增长阶段转向高质量发展阶段。科技领域仍将孕育众多投资机会。

构建高性价比组合是本基金的最核心思路。我们坚持优选估值低、高成长、高性价比的标的进行投资的理念，在个股层面适度分散，并且注重回撤的控制，力争获得可持续的超额收益。具体而言，本基金目前重点关注的投资方向包括：1、估值处于历史低位，竞争格局获得改善，未来在经济复苏大背景下基本面有望显著改善的价值股；2、所在行业经历经济周期下行后处于底部区域，供给格局已经得到改善，未来需求有望向上获得高增长的成长股，3、科技进步方向的核心引领者和受益标的。

面对2023年下半年的A股市场，我们将以进取的心态，进行积极踏实的研究、审慎严谨的投资，我们也将勤勉尽责，在市场波动中保持定力，努力为投资人创造更多的正回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。

估值委员会设主任委员一名，由分管运营的公司领导担任，副主任委员一名，由分管合规的公司领导担任，专业委员若干名，由研究部、投资管理部门（视会议议题内容选择相关投资方向部门）、风险部门、监察稽核部门、基金运营部门负责人或其指定人员组成。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。

估值委员会主要工作职责如下：制定合理、公允的估值方法；对估值方法进行讨论并作出评价，在发生了影响估值公允性及合理性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用；评价现有估值方法对新投资策略或新投资品种的适用性，对新投资策略或新投资品种采用的估值方法作出决定；讨论、决定其他与估值相关的重大问题。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。

本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

会计师事务所对相关估值模型、假设及参数的适当性出具意见。

定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金合同》，基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。

本报告期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

本报告期内，本基金不存在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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在兴业成长动力灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本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”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：兴业成长动力灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2023年06月30日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|------------|---------|--------------------|---------------------|
| <b>资产：</b> |         |                    |                     |
| 银行存款       | 6.4.7.1 | 27,623,666.67      | 10,822,531.06       |
| 结算备付金      |         | 1,917,245.51       | 1,575,909.16        |
| 存出保证金      |         | 123,739.66         | 99,744.67           |
| 交易性金融资产    | 6.4.7.2 | 152,103,451.76     | 160,156,707.83      |
| 其中：股票投资    |         | 141,943,322.99     | 149,827,255.78      |
| 基金投资       |         | -                  | -                   |
| 债券投资       |         | 10,160,128.77      | 10,329,452.05       |
| 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         |            | -                  | 4,922,222.22       |
| 应收股利          |            | -                  | -                  |
| 应收申购款         |            | 10,976.18          | 74,056.68          |
| 递延所得税资产       |            | -                  | -                  |
| 其他资产          | 6.4.7.5    | -                  | -                  |
| 资产总计          |            | 181,779,079.78     | 177,651,171.62     |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末</b>         | <b>上年度末</b>        |
|               |            | <b>2023年06月30日</b> | <b>2022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         |            | 5,584,238.54       | 7,973,764.78       |
| 应付赎回款         |            | 35,789.15          | 85,387.02          |
| 应付管理人报酬       |            | 218,224.06         | 218,538.03         |
| 应付托管费         |            | 36,370.72          | 36,422.99          |
| 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          | 6.4.7.6    | 1,389,853.28       | 1,054,894.97       |
| 负债合计          |            | 7,264,475.75       | 9,369,007.79       |
| <b>净资产：</b>   |            |                    |                    |
| 实收基金          | 6.4.7.7    | 133,681,438.94     | 143,837,274.19     |
| 其他综合收益        |            | -                  | -                  |
| 未分配利润         | 6.4.7.8    | 40,833,165.09      | 24,444,889.64      |
| 净资产合计         |            | 174,514,604.03     | 168,282,163.83     |

|          |  |                |                |
|----------|--|----------------|----------------|
| 负债和净资产总计 |  | 181,779,079.78 | 177,651,171.62 |
|----------|--|----------------|----------------|

注：报告截止日2023年06月30日，基金份额净值1.305元，基金份额总额133,681,438.94份。

## 6.2 利润表

会计主体：兴业成长动力灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

| 项目               | 附注号      | 本期<br>2023年01月01日至<br>2023年06月30日 | 上年度可比期间<br>2022年01月01日至202<br>2年06月30日 |
|------------------|----------|-----------------------------------|--|
| <b>一、营业总收入</b>   |          | 21,280,492.72                     | -25,973,668.40                         |
| 1.利息收入           |          | 55,179.34                         | 38,748.73                              |
| 其中：存款利息收入        | 6.4.7.9  | 55,179.34                         | 38,748.73                              |
| 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） |          | 19,964,286.88                     | -31,050,279.27                         |
| 其中：股票投资收益        | 6.4.7.10 | 19,116,708.52                     | -32,889,464.36                         |
| 基金投资收益           |          | -                                 | -                                      |
| 债券投资收益           | 6.4.7.11 | 3,344.32                          | 166,713.15                             |
| 资产支持证券投资         | 6.4.7.12 | -                                 | -                                      |
| 收益               |          |                                   |  |
| 贵金属投资收益          |          | -                                 | -                                      |
| 衍生工具收益           | 6.4.7.13 | -                                 | -                                      |
| 股利收益             | 6.4.7.14 | 844,234.04                        | 1,672,471.94                           |
| 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)      | 6.4.7.15   | 1,246,976.96  | 5,029,211.34   |
| 4.汇兑收益(损失以“-”号填列)          |            | -             | -              |
| 5.其他收入(损失以“-”号填列)          | 6.4.7.16   | 14,049.54     | 8,650.80       |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 1,670,666.75  | 1,929,823.40   |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 1,342,920.84  | 1,567,794.02   |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 223,820.11    | 261,298.96     |
| 3. 销售服务费                   |            | -             | -              |
| 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                  | 6.4.7.17   | -             | -              |
| 7. 税金及附加                   |            | -             | -              |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.18   | 103,925.80    | 100,730.42     |
| <b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b> |            | 19,609,825.97 | -27,903,491.80 |
| 减：所得税费用                    |            | -             | -              |
| <b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>   |            | 19,609,825.97 | -27,903,491.80 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | -             | -              |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | 19,609,825.97 | -27,903,491.80 |

### 6.3 净资产(基金净值)变动表

会计主体：兴业成长动力灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元



| 项目                                  | 本期<br>2023年01月01日至2023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）                     | 143,837,274.19                | -      | 24,444,889.64 | 168,282,163.83 |
| 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）                     | 143,837,274.19                | -      | 24,444,889.64 | 168,282,163.83 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                | -10,155,835.25                | -      | 16,388,275.45 | 6,232,440.20   |
| （一）、综合收益总额                          | -                             | -      | 19,609,825.97 | 19,609,825.97  |
| （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） | -10,155,835.25                | -      | -3,221,550.52 | -13,377,385.77 |
| 其中：1.基金申购款                          | 4,141,090.13                  | -      | 1,291,918.94  | 5,433,009.07   |
| 2.基金赎回款                             | -14,296,925.38                | -      | -4,513,469.46 | -18,810,394.84 |
| （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)                     | 133,681,438.94                     | -      | 40,833,165.09  | 174,514,604.03 |
| 项目                                  | 上年度可比期间<br>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)                     | 164,030,048.63                     | -      | 84,823,416.41  | 248,853,465.04 |
| 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)                     | 164,030,048.63                     | -      | 84,823,416.41  | 248,853,465.04 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                | -11,286,524.39                     | -      | -31,568,482.91 | -42,855,007.30 |
| (一)、综合收益总额                          | -                                  | -      | -27,903,491.80 | -27,903,491.80 |
| (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) | -11,286,524.39                     | -      | -3,664,991.11  | -14,951,515.50 |

|  |                |   |               |                |
|--|----------------|---|---------------|----------------|
| 其中：1.基金申购款                               | 6,930,822.10   | - | 2,284,312.12  | 9,215,134.22   |
| 2.基金赎回款                                  | -18,217,346.49 | - | -5,949,303.23 | -24,166,649.72 |
| (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)                          | 152,743,524.24 | - | 53,254,933.50 | 205,998,457.74 |

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：

叶文煌

张顺国

夏鹏

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

兴业成长动力灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人兴业基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《兴业成长动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2015]2641号文准予募集注册。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为212,527,217.99份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(16)第0467号的验资报告。基金合同于2016年6月3日正式生效。本基金的基金管理人为兴业基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及本基金招募说明书的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国

内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、债券(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、短期公司债、中小企业私募债券、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、债券回购、银行存款、货币市场工具、资产支持证券、国债期货、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例为0%-95%;权证投资占基金资产净值的比例为0%-3%;每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货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、应收申购款等;持有的单只中小企业私募债券,其市值不得超过基金资产净值的10%。本基金参与股指期货、国债期货交易,应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。本基金的业绩比较基准为:中证500指数收益率×55%+中证全债指数收益率×45%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金2023年06月30日的财务状况以及自2023年1月1日起至2023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 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《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，主要税项列示如下：

(1)证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税；2018年1月1日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

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

(3)对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目   | 本期末<br>2023年06月30日 |
|------|--------------------|
| 活期存款 | 27,623,666.67      |

|              |               |
|--------------|---------------|
| 等于：本金        | 27,619,785.45 |
| 加：应计利息       | 3,881.22      |
| 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           | 27,623,666.67 |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2023年06月30日 |              |                |               |
|---------------|--------------------|--------------|----------------|---------------|
|               | 成本                 | 应计利息         | 公允价值           | 公允价值变动        |
| 股票            | 140,930,408.23     | -            | 141,943,322.99 | 1,012,914.76  |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                  | -            | -              | -             |
| 债券            | 交易所市场              | -            | -              | -             |
|               | 银行间市场              | 9,974,900.00 | 161,128.77     | 10,160,128.77 |
|               | 合计                 | 9,974,900.00 | 161,128.77     | 10,160,128.77 |
| 资产支持证券        | -                  | -            | -              | -             |
| 基金            | -                  | -            | -              | -             |
| 其他            | -                  | -            | -              | -             |
| 合计            | 150,905,308.23     | 161,128.77   | 152,103,451.76 | 1,037,014.76  |

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2023年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  |
| 应付赎回费       | 0.31               |
| 应付交易费用      | 1,301,050.41       |
| 其中：交易所市场    | 1,301,050.41       |
| 银行间市场       | -                  |
| 应付利息        | -                  |
| 预提费用        | 88,802.56          |
| 合计          | 1,389,853.28       |

### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目   | 本期<br>2023年01月01日至2023年06月30日 |                |
|------|-------------------------------|----------------|
|      | 基金份额（份）                       | 账面金额           |
| 上年度末 | 143,837,274.19                | 143,837,274.19 |

|               |                |                |
|---------------|----------------|----------------|
| 本期申购          | 4,141,090.13   | 4,141,090.13   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -14,296,925.38 | -14,296,925.38 |
| 本期末           | 133,681,438.94 | 133,681,438.94 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

#### 6.4.7.8 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           | 143,092,411.79 | -118,647,522.15 | 24,444,889.64 |
| 本期利润           | 18,362,849.01  | 1,246,976.96    | 19,609,825.97 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -11,050,870.58 | 7,829,320.06    | -3,221,550.52 |
| 其中：基金申购款       | 4,527,482.70   | -3,235,563.76   | 1,291,918.94  |
| 基金赎回款          | -15,578,353.28 | 11,064,883.82   | -4,513,469.46 |
| 本期已分配利润        | -              | -               | -             |
| 本期末            | 150,404,390.22 | -109,571,225.13 | 40,833,165.09 |

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期                      |
|-----------|-------------------------|
|           | 2023年01月01日至2023年06月30日 |
| 活期存款利息收入  | 41,923.65               |
| 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 | 12,377.44               |
| 其他        | 878.25                  |
| 合计        | 55,179.34               |

#### 6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期                      |
|----|-------------------------|
|    | 2023年01月01日至2023年06月30日 |
|    |                         |



|            |                  |
|------------|------------------|
| 卖出股票成交总额   | 1,345,765,706.53 |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,323,150,056.82 |
| 减：交易费用     | 3,498,941.19     |
| 买卖股票差价收入   | 19,116,708.52    |

#### 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

单位：人民币元

| 项目                           | 本期                      |
|------------------------------|-------------------------|
|                              | 2023年01月01日至2023年06月30日 |
| 债券投资收益——利息收入                 | 88,449.32               |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -85,105.00              |
| 债券投资收益——赎回差价收入               | -                       |
| 债券投资收益——申购差价收入               | -                       |
| 合计                           | 3,344.32                |

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期                      |
|------------------------|-------------------------|
|                        | 2023年01月01日至2023年06月30日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 10,332,000.00           |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 10,084,930.00           |
| 减：应计利息总额               | 332,000.00              |
| 减：交易费用                 | 175.00                  |
| 买卖债券差价收入               | -85,105.00              |

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期末未持有资产支持证券投资收益。

### 6.4.7.13 衍生工具收益

#### 6.4.7.13.1 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--买卖权证差价收入。

#### 6.4.7.13.2 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--其他投资收益。

### 6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2023年01月01日至2023年06月30日 |
|-------------|-------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 844,234.04                    |
| 基金投资产生的股利收益 | -                             |
| 合计          | 844,234.04                    |

### 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2023年01月01日至2023年06月30日 |
|------------------------|-------------------------------|
| 1.交易性金融资产              | 1,246,976.96                  |
| ——股票投资                 | 1,139,946.96                  |
| ——债券投资                 | 107,030.00                    |
| ——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 | 1,246,976.96 |
|----|--------------|

#### 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期                      |
|---------|-------------------------|
|         | 2023年01月01日至2023年06月30日 |
| 基金赎回费收入 | 14,049.54               |
| 合计      | 14,049.54               |

#### 6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期内未发生信用减值损失。

#### 6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期                      |
|-------|-------------------------|
|       | 2023年01月01日至2023年06月30日 |
| 审计费用  | 24,795.19               |
| 信息披露费 | 59,507.37               |
| 汇划手续费 | 10,623.24               |
| 帐户维护费 | 9,000.00                |
| 合计    | 103,925.80              |

### 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，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露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

本报告期间存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 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               |
|--------------------------|-----------------------|
| 兴业基金管理有限公司(以下简称"兴业基金")   | 基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构 |
| 中国银行股份有限公司(以下简称"中国银行")   | 基金托管人、基金销售机构          |
| 兴业银行股份有限公司(以下简称"兴业银行")   | 基金管理人的控股股东、基金销售机构     |
| 中海集团投资有限公司               | 基金管理人的股东              |
| 兴业财富资产管理有限公司(以下简称"兴业财富") | 基金管理人控制的公司            |

注：下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未通过关联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

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

##### 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 | 上年度可比期间 |
|----|----|---------|
|----|----|---------|

|                 | 2023年01月01日至2023年06月30日 | 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  | 1,342,920.84            | 1,567,794.02            |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 876,877.34              | 627,809.78              |

注：支付基金管理人兴业基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值\*1.50%÷当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2023年01月01日至2023年06月30日 | 上年度可比期间<br>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 | 223,820.11                    | 261,298.96                         |

注：支付基金托管人中国银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值\*0.25%÷当年天数。

#### 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

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

本基金本报告期及上年度可比期间内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

本基金本报告期末及上年度末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<br>2023年01月01日至2023年06月30日 | 上年度可比期间<br>2022年01月01日至2022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    |
|------------|---------------|-----------|--------------|-----------|
| 中国银行股份有限公司 | 27,623,666.67 | 41,923.65 | 3,480,850.79 | 27,942.03 |

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业或协议利率计算。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期间及上年度可比期间未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期间及上年度可比期间未发生其他关联方交易事项。

#### 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

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023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 |
| 688486               | 龙迅股份 | 2023-02-10 | 1-6个月（含） | 科创板打新限售 | 64.76 | 105.13 | 888      | 57,506.88 | 93,355.44 | -  |
| 688603               | 天承科技 | 2023-06-30 | 1个月内（含）  | 新股未上市   | 55.00 | 55.00  | 750      | 41,250.00 | 41,250.00 | -  |
| 301261               | 恒工精密 | 2023-06-29 | 1个月内（含）  | 新股未上市   | 36.90 | 36.90  | 1,039    | 38,339.10 | 38,339.10 | -  |
| 301202               | 朗威股份 | 2023-06-2  | 1个月内（含）  | 新股未上    | 25.82 | 25.82  | 1,437    | 37,103.34 | 37,103.34 | -  |

|        |      |            |          |         |        |        |       |           |           |   |
|--------|------|------------|----------|---------|--------|--------|-------|-----------|-----------|---|
|        |      | 8          |          | 市       |        |        |       |           |           |   |
| 001286 | 陕西能源 | 2023-03-31 | 1-6个月(含) | 新股锁定    | 9.60   | 9.41   | 3,767 | 36,163.20 | 35,447.47 | - |
| 688249 | 晶合集成 | 2023-04-24 | 1-6个月(含) | 科创板打新限售 | 19.86  | 18.06  | 803   | 15,947.58 | 14,502.18 | - |
| 301293 | 三博脑科 | 2023-04-25 | 1-6个月(含) | 创业板打新限售 | 29.60  | 71.42  | 180   | 5,328.00  | 12,855.60 | - |
| 688472 | 阿特斯  | 2023-06-02 | 1-6个月(含) | 科创板打新限售 | 11.10  | 17.04  | 661   | 7,337.10  | 11,263.44 | - |
| 301325 | 曼恩斯特 | 2023-05-04 | 1-6个月(含) | 创业板打新限售 | 76.80  | 107.95 | 100   | 7,680.00  | 10,795.00 | - |
| 688361 | 中科飞测 | 2023-05-12 | 1-6个月(含) | 科创板打新限售 | 23.60  | 64.67  | 143   | 3,374.80  | 9,247.81  | - |
| 688629 | 华丰科技 | 2023-06-16 | 1-6个月(含) | 科创板打新限售 | 9.26   | 18.59  | 482   | 4,463.32  | 8,960.38  | - |
| 301358 | 湖南裕能 | 2023-02-01 | 1-6个月(含) | 创业板打新限售 | 23.77  | 42.89  | 199   | 4,730.23  | 8,535.11  | - |
| 688531 | 日联科技 | 2023-03-2  | 1-6个月(含) | 科创板打    | 152.38 | 135.97 | 58    | 8,838.04  | 7,886.26  | - |

|        |      |            |          |         |       |       |     |          |          |   |
|--------|------|------------|----------|---------|-------|-------|-----|----------|----------|---|
|        |      | 4          |          | 新限售     |       |       |     |          |          |   |
| 301260 | 格力博  | 2023-01-20 | 1-6个月(含) | 创业板打新限售 | 30.85 | 23.63 | 319 | 9,841.15 | 7,537.97 | - |
| 688146 | 中船特气 | 2023-04-13 | 1-6个月(含) | 科创板打新限售 | 36.15 | 38.13 | 175 | 6,326.25 | 6,672.75 | - |
| 301408 | 华人健康 | 2023-02-22 | 1-6个月(含) | 创业板打新限售 | 16.24 | 16.95 | 386 | 6,268.64 | 6,542.70 | - |
| 301429 | 森泰股份 | 2023-04-10 | 1-6个月(含) | 创业板打新限售 | 28.75 | 21.02 | 311 | 8,941.25 | 6,537.22 | - |
| 688543 | 国科军工 | 2023-06-14 | 1-6个月(含) | 科创板打新限售 | 43.67 | 53.05 | 123 | 5,371.41 | 6,525.15 | - |
| 301382 | 蜂助手  | 2023-05-09 | 1-6个月(含) | 创业板打新限售 | 23.80 | 32.84 | 196 | 4,664.80 | 6,436.64 | - |
| 301387 | 光大同创 | 2023-04-10 | 1-6个月(含) | 创业板打新限售 | 58.32 | 45.36 | 137 | 7,989.84 | 6,214.32 | - |
| 688334 | 西高院  | 2023-06-09 | 1-6个月(含) | 科创板打新限售 | 14.16 | 16.21 | 375 | 5,310.00 | 6,078.75 | - |



|        |      |            |          |         |       |       |     |          |          |   |
|--------|------|------------|----------|---------|-------|-------|-----|----------|----------|---|
| 688552 | 航天南湖 | 2023-05-08 | 1-6个月(含) | 科创板打新限售 | 21.17 | 23.50 | 253 | 5,356.01 | 5,945.50 | - |
| 688620 | 安凯微  | 2023-06-15 | 1-6个月(含) | 科创板打新限售 | 10.68 | 12.34 | 470 | 5,019.60 | 5,799.80 | - |
| 688535 | 华海诚科 | 2023-03-28 | 1-6个月(含) | 科创板打新限售 | 35.00 | 51.23 | 108 | 3,780.00 | 5,532.84 | - |
| 301332 | 德尔玛  | 2023-05-09 | 1-6个月(含) | 创业板打新限售 | 14.81 | 13.73 | 394 | 5,835.14 | 5,409.62 | - |
| 688433 | 华曙高科 | 2023-04-07 | 1-6个月(含) | 科创板打新限售 | 26.66 | 31.50 | 167 | 4,452.22 | 5,260.50 | - |
| 301305 | 朗坤环境 | 2023-05-15 | 1-6个月(含) | 创业板打新限售 | 25.25 | 19.69 | 260 | 6,565.00 | 5,119.40 | - |
| 301428 | 世纪恒通 | 2023-05-10 | 1-6个月(含) | 创业板打新限售 | 26.35 | 30.60 | 161 | 4,242.35 | 4,926.60 | - |
| 301373 | 凌玮科技 | 2023-01-20 | 1-6个月(含) | 创业板打新限售 | 33.73 | 31.85 | 152 | 5,126.96 | 4,841.20 | - |
| 688429 | 时创能源 | 2023-06-2  | 1-6个月(含) | 科创板打    | 19.20 | 25.53 | 189 | 3,628.80 | 4,825.17 | - |

|        |      |            |          |         |        |        |     |          |          |   |
|--------|------|------------|----------|---------|--------|--------|-----|----------|----------|---|
|        |      | 0          |          | 新限售     |        |        |     |          |          |   |
| 688570 | 天玛智控 | 2023-05-29 | 1-6个月(含) | 科创板打新限售 | 30.26  | 25.33  | 189 | 5,719.14 | 4,787.37 | - |
| 301157 | 华塑科技 | 2023-03-01 | 1-6个月(含) | 创业板打新限售 | 56.50  | 52.93  | 90  | 5,085.00 | 4,763.70 | - |
| 688603 | 天承科技 | 2023-06-30 | -        | 科创板打新限售 | 55.00  | 55.00  | 84  | 4,620.00 | 4,620.00 | - |
| 688581 | 安杰思  | 2023-05-12 | 1-6个月(含) | 科创板打新限售 | 125.80 | 118.03 | 39  | 4,906.20 | 4,603.17 | - |
| 301246 | 宏源药业 | 2023-03-10 | 1-6个月(含) | 创业板打新限售 | 50.00  | 30.71  | 149 | 7,450.00 | 4,575.79 | - |
| 301281 | 科源制药 | 2023-03-28 | 1-6个月(含) | 创业板打新限售 | 31.59  | 25.10  | 179 | 5,655.04 | 4,492.90 | - |
| 688631 | 莱斯信息 | 2023-06-19 | 1-6个月(含) | 科创板打新限售 | 25.28  | 29.87  | 148 | 3,741.44 | 4,420.76 | - |
| 301322 | 绿通科技 | 2023-02-27 | 1-6个月(含) | 创业板打新限售 | 87.41  | 53.24  | 81  | 7,079.94 | 4,312.44 | - |

|        |      |            |          |         |       |       |     |          |          |   |
|--------|------|------------|----------|---------|-------|-------|-----|----------|----------|---|
| 301261 | 恒工精密 | 2023-06-29 | -        | 创业板打新限售 | 36.90 | 36.90 | 116 | 4,280.40 | 4,280.40 | - |
| 301386 | 未来电器 | 2023-03-21 | 1-6个月(含) | 创业板打新限售 | 29.99 | 23.79 | 179 | 5,368.21 | 4,258.41 | - |
| 301202 | 朗威股份 | 2023-06-28 | -        | 创业板打新限售 | 25.82 | 25.82 | 160 | 4,131.20 | 4,131.20 | - |
| 601061 | 中信金属 | 2023-03-30 | 1-6个月(含) | 新股锁定    | 6.58  | 7.58  | 528 | 3,474.24 | 4,002.24 | - |
| 301337 | 亚华电子 | 2023-05-16 | 1-6个月(含) | 创业板打新限售 | 32.60 | 30.37 | 131 | 4,270.60 | 3,978.47 | - |
| 688479 | 友车科技 | 2023-05-04 | 1-6个月(含) | 科创板打新限售 | 33.99 | 29.49 | 128 | 4,350.72 | 3,774.72 | - |
| 301439 | 泓淋电力 | 2023-03-10 | 1-6个月(含) | 创业板打新限售 | 19.99 | 16.90 | 215 | 4,297.85 | 3,633.50 | - |
| 603135 | 中重科技 | 2023-03-29 | 1-6个月(含) | 新股锁定    | 17.80 | 17.89 | 180 | 3,204.00 | 3,220.20 | - |
| 601065 | 江盐集团 | 2023-03-31 | 1-6个月(含) | 新股锁定    | 10.36 | 11.84 | 205 | 2,123.80 | 2,427.20 | - |
| 601133 | 柏诚   | 2023-03-31 | 1-6个月    | 新股      | 11.66 | 12.26 | 186 | 2,168.76 | 2,280.36 | - |

|            | 股份       | 1                  | (含)          | 锁定                  |       |       |     |              |              |   |
|------------|----------|--------------------|--------------|---------------------|-------|-------|-----|--------------|--------------|---|
| 6031<br>37 | 恒尚<br>节能 | 2023<br>-04-1<br>0 | 1-6个月<br>(含) | 新股<br>锁定            | 15.90 | 17.09 | 133 | 2,11<br>4.70 | 2,27<br>2.97 | - |
| 3013<br>45 | 涛涛<br>车业 | 2023<br>-03-1<br>0 | 1-6个月<br>(含) | 创业<br>板打<br>新限<br>售 | 73.45 | 46.64 | 47  | 3,45<br>2.15 | 2,19<br>2.08 | - |
| 0012<br>82 | 三联<br>锻造 | 2023<br>-05-1<br>5 | 1-6个月<br>(含) | 新股<br>锁定            | 27.93 | 33.03 | 64  | 1,78<br>7.52 | 2,11<br>3.92 | - |
| 0013<br>28 | 登康<br>口腔 | 2023<br>-03-2<br>9 | 1-6个月<br>(含) | 新股<br>锁定            | 20.68 | 25.49 | 81  | 1,67<br>5.08 | 2,06<br>4.69 | - |
| 0013<br>24 | 长青<br>科技 | 2023<br>-05-1<br>2 | 1-6个月<br>(含) | 新股<br>锁定            | 18.88 | 19.60 | 80  | 1,51<br>0.40 | 1,56<br>8.00 | - |
| 0013<br>60 | 南矿<br>集团 | 2023<br>-03-3<br>1 | 1-6个月<br>(含) | 新股<br>锁定            | 15.38 | 14.87 | 100 | 1,53<br>8.00 | 1,48<br>7.00 | - |
| 6031<br>25 | 常青<br>科技 | 2023<br>-03-3<br>0 | 1-6个月<br>(含) | 新股<br>锁定            | 25.98 | 24.53 | 60  | 1,55<br>8.80 | 1,47<br>1.80 | - |
| 0013<br>67 | 海森<br>药业 | 2023<br>-03-3<br>0 | 1-6个月<br>(含) | 新股<br>锁定            | 44.48 | 39.48 | 33  | 1,46<br>7.84 | 1,30<br>2.84 | - |

注：对于流通受限期内发生权益分派的股票，上表列示的认购价格为实际认购价格除权后的价格。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 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从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

### 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面临的与本基金所投资金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金基金管理人从事风险管理的主要目标是在有效控制上述风险的前提下，通过对各类市场影响因素分析以及投资组合积极主动管理，力争获得超过业绩比较基准的长期稳定收益，使本基金在风险和收益之间取得最佳平衡。

本基金基金管理人按照"自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工"的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。本基金基金管理人建立的风险管理体系由三层风险防范等级构成：

一级风险防范是指公司董事会层面对公司的风险进行的预防和控制。董事会下设审计与风险管理委员会，负责公司审计风险的控制、管理、监督和评价；对公司经营的合法、合规性进行监控和检查，对经营活动进行审计。

二级风险防范是指公司内部控制与风险管理委员会、投资决策委员会和风险管理部层次对公司风险进行的预防和控制。管理层下设内部控制与风险管理委员会，对公司在经营管理和基金运作中的风险进行研究、分析与评估，制定相应风险控制制度并监督其执行，全面、及时、有效地防范公司经营过程中可能面临的各类风险。

三级风险防范是指公司各部门对自身业务工作风险进行的自我检查和控制。公司各部门根据经营计划、业务规则及部门具体情况，制定本部门业务流程及风险控制措施。

针对金融工具所面临的相关风险，本基金基金管理人主要通过定性与定量分析相结合的方法进行管理，即依据定性分析以判断风险损失的严重程度及同类风险损失的发生频度，凭借定量分析以确定风险损失的限度及相应的置信程度，进而及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，以确保将风险控制在可承受范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金所投资证券的发行人出现违约或拒绝支付到期利息、本金，或基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任等，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金基金管理人建立了较为完善的信用风险管理流程，通过对信用债券发行人基本面调研分析，结合流动性、信用利差、信用评级、违约风险等方面的综合评估结果，选取具有价格优势和套利机会的优质信用债券产品进行投资。

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。本基金通过对银行间同业市场交易对手进行信用评估，以控制相应的信

用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，投资于一家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基金管理人旗下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%。本基金的交易所交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手，并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。除国债、央行票据、政策性金融债外，本基金报告期末及上年度末未持有按信用评级列示的债券。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易相对不活跃导致基金投资资产无法以适当价格及时变现，进而无法应对债务到期偿付或投资者赎回款按时支付的风险。

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，有效保障基金持有人利益。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本报告期内，基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理。本基金所持大部分证券在证券交易所上市或银行间同业市场交易，不存在具有重大流动性风险的投资品种。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度，对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

截止本报告期末及上年度末，本基金无重大流动性风险。

### 6.4.13.4 市场风险

市场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、结算备付金及债券投资等。利率敏感性金融工具均面临

由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金基金管理人主要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<br>2023年0<br>6月30<br>日 | 1年以内          | 1-5年 | 5年以上 | 不计息            | 合计             |
|----------------------------|---------------|------|------|----------------|----------------|
| 资产                         |               |      |      |                |                |
| 银行存款                       | 27,623,666.67 | -    | -    | -              | 27,623,666.67  |
| 结算备付金                      | 1,917,245.51  | -    | -    | -              | 1,917,245.51   |
| 存出保证金                      | 123,739.66    | -    | -    | -              | 123,739.66     |
| 交易性金融资产                    | 10,160,128.77 | -    | -    | 141,943,322.99 | 152,103,451.76 |
| 应收申购款                      | -             | -    | -    | 10,976.18      | 10,976.18      |
| 资产总计                       | 39,824,780.61 | -    | -    | 141,954,299.17 | 181,779,079.78 |
| 负债                         |               |      |      |                |                |
| 应付清算款                      | -             | -    | -    | 5,584,238.54   | 5,584,238.54   |
| 应付赎回款                      | -             | -    | -    | 35,789.15      | 35,789.15      |
| 应付管理人报酬                    | -             | -    | -    | 218,224.06     | 218,224.06     |
| 应付托管费                      | -             | -    | -    | 36,370.72      | 36,370.72      |
| 其他负债                       | -             | -    | -    | 1,389,853.28   | 1,389,853.28   |
| 负债总计                       | -             | -    | -    | 7,264,475.75   | 7,264,475.75   |
| 利率敏感度缺口                    | 39,824,780.61 | -    | -    | 134,689,823.42 | 174,514,604.03 |
| 上年度末                       | 1年以内          | 1-5年 | 5年以上 | 不计息            | 合计             |

|                         |               |   |   |                |                |
|-------------------------|---------------|---|---|----------------|----------------|
| 2022 年 1<br>2 月 31<br>日 |               |   |   |                |                |
| 资产                      |               |   |   |                |                |
| 银行存款                    | 10,822,531.06 | - | - | -              | 10,822,531.06  |
| 结算备<br>付金               | 1,575,909.16  | - | - | -              | 1,575,909.16   |
| 存出保<br>证金               | 99,744.67     | - | - | -              | 99,744.67      |
| 交易性<br>金融资<br>产         | 10,329,452.05 | - | - | 149,827,255.78 | 160,156,707.83 |
| 应收清<br>算款               | -             | - | - | 4,922,222.22   | 4,922,222.22   |
| 应收申<br>购款               | -             | - | - | 74,056.68      | 74,056.68      |
| 资产总<br>计                | 22,827,636.94 | - | - | 154,823,534.68 | 177,651,171.62 |
| 负债                      |               |   |   |                |                |
| 应付清<br>算款               | -             | - | - | 7,973,764.78   | 7,973,764.78   |
| 应付赎<br>回款               | -             | - | - | 85,387.02      | 85,387.02      |
| 应付管<br>理人报<br>酬         | -             | - | - | 218,538.03     | 218,538.03     |
| 应付托<br>管费               | -             | - | - | 36,422.99      | 36,422.99      |
| 其他负<br>债                | -             | - | - | 1,054,894.97   | 1,054,894.97   |
| 负债总<br>计                | -             | - | - | 9,369,007.79   | 9,369,007.79   |
| 利率敏<br>感度缺<br>口         | 22,827,636.94 | - | - | 145,454,526.89 | 168,282,163.83 |

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|    |                    |                    |
|----|--------------------|--------------------|
| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                    |
| 假设 | 利率曲线平行移动           |                    |
| 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<br>2023年06月30日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|  | 市场利率上升25个基点 | -1,911.54          | -417.09             |
|  | 市场利率下降25个基点 | 1,916.60           | 418.13              |

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险可来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项，也可来源于市场整体波动。

本基金基金管理人在构建和管理投资组合过程中，通过对宏观经济情况及政策分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金基金管理人定期结合宏观及微观环境变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行动态修正，以主动应对可能发生的其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，基金管理人对本基金所持仓证券价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量，以测试本基金所面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2023年06月30日 |                          | 上年度末<br>2022年12月31日 |                          |
|--------------|--------------------|--------------------------|---------------------|--------------------------|
|              | 公允价值               | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | 141,943,322.99     | 81.34                    | 149,827,255.78      | 89.03                    |
| 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            | 141,943,322.99 | 81.34 | 149,827,255.78 | 89.03 |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除股票价格以外的其他市场变量保持不变 |                             |                     |
|----|--------------------|-----------------------------|---------------------|
| 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<br>2023年06月30日          | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|    | 股票价格上升5%           | 7,097,166.15                | 7,491,362.79        |
|    | 股票价格下降5%           | -7,097,166.15               | -7,491,362.79       |

#### 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的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：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<br>2023年06月30日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|---------------|--------------------|---------------------|
| 第一层次          | 141,426,539.60     | 148,171,132.32      |

|      |                |                |
|------|----------------|----------------|
| 第二层次 | 10,289,852.81  | 11,771,511.24  |
| 第三层次 | 387,059.35     | 214,064.27     |
| 合计   | 152,103,451.76 | 160,156,707.83 |

#### 6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金于本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 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资产和负债主要包括货币资金、应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相等。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目     | 金额             | 占基金总资产的比例(%) |
|----|--------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资   | 141,943,322.99 | 78.09        |
|    | 其中：股票  | 141,943,322.99 | 78.09        |
| 2  | 基金投资   | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资 | 10,160,128.77  | 5.59         |
|    | 其中：债券  | 10,160,128.77  | 5.59         |
|    | 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      | 29,540,912.18  | 16.25  |
| 8 | 其他各项资产            | 134,715.84     | 0.07   |
| 9 | 合计                | 181,779,079.78 | 100.00 |

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 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         | 4,006,575.00   | 2.30         |
| B  | 采矿业              | 1,006,815.00   | 0.58         |
| C  | 制造业              | 104,395,116.35 | 59.82        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 4,097,327.47   | 2.35         |
| E  | 建筑业              | 1,320,441.33   | 0.76         |
| F  | 批发和零售业           | 62,344.94      | 0.04         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 6,227,746.00   | 3.57         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 3,700,356.15   | 2.12         |
| J  | 金融业              | 5,566,108.00   | 3.19         |
| K  | 房地产业             | 2,856,176.00   | 1.64         |
| L  | 租赁和商务服务业         | -              | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 9,906.75       | 0.01         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 5,119.40       | 0.00         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -            |
| P  | 教育               | -              | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | 12,855.60      | 0.01         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 8,676,435.00   | 4.97         |
| S  | 综合               | -              | -            |
|    | 合计               | 141,943,322.99 | 81.34        |

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)   | 公允价值(元)      | 占基金资产<br>净值比例<br>(%) |
|----|--------|------|---------|--------------|----------------------|
| 1  | 603486 | 科沃斯  | 71,500  | 5,560,555.00 | 3.19                 |
| 2  | 600977 | 中国电影 | 370,400 | 5,204,120.00 | 2.98                 |
| 3  | 600031 | 三一重工 | 279,700 | 4,651,411.00 | 2.67                 |
| 4  | 002475 | 立讯精密 | 141,600 | 4,594,920.00 | 2.63                 |
| 5  | 601233 | 桐昆股份 | 336,300 | 4,455,975.00 | 2.55                 |
| 6  | 688169 | 石头科技 | 11,074  | 3,551,210.32 | 2.03                 |
| 7  | 603225 | 新凤鸣  | 319,600 | 3,531,580.00 | 2.02                 |
| 8  | 300413 | 芒果超媒 | 101,500 | 3,472,315.00 | 1.99                 |
| 9  | 002223 | 鱼跃医疗 | 91,200  | 3,282,288.00 | 1.88                 |
| 10 | 300674 | 宇信科技 | 182,600 | 3,228,368.00 | 1.85                 |
| 11 | 600905 | 三峡能源 | 554,400 | 2,977,128.00 | 1.71                 |
| 12 | 601658 | 邮储银行 | 601,200 | 2,939,868.00 | 1.68                 |
| 13 | 600887 | 伊利股份 | 103,600 | 2,933,952.00 | 1.68                 |
| 14 | 600519 | 贵州茅台 | 1,700   | 2,874,700.00 | 1.65                 |
| 15 | 001979 | 招商蛇口 | 219,200 | 2,856,176.00 | 1.64                 |
| 16 | 002271 | 东方雨虹 | 104,600 | 2,851,396.00 | 1.63                 |
| 17 | 002293 | 罗莱生活 | 240,300 | 2,763,450.00 | 1.58                 |
| 18 | 000739 | 普洛药业 | 153,800 | 2,728,412.00 | 1.56                 |
| 19 | 601318 | 中国平安 | 56,600  | 2,626,240.00 | 1.50                 |
| 20 | 603501 | 韦尔股份 | 25,870  | 2,536,294.80 | 1.45                 |
| 21 | 688363 | 华熙生物 | 28,443  | 2,535,977.88 | 1.45                 |
| 22 | 601111 | 中国国航 | 302,900 | 2,495,896.00 | 1.43                 |
| 23 | 000998 | 隆平高科 | 160,000 | 2,456,000.00 | 1.41                 |
| 24 | 603899 | 晨光股份 | 53,800  | 2,401,632.00 | 1.38                 |
| 25 | 300750 | 宁德时代 | 10,497  | 2,401,608.63 | 1.38                 |

|    |        |       |         |              |      |
|----|--------|-------|---------|--------------|------|
| 26 | 600004 | 白云机场  | 151,600 | 2,173,944.00 | 1.25 |
| 27 | 002252 | 上海莱士  | 271,000 | 2,035,210.00 | 1.17 |
| 28 | 002557 | 洽洽食品  | 47,900  | 1,990,245.00 | 1.14 |
| 29 | 600745 | 闻泰科技  | 37,400  | 1,828,860.00 | 1.05 |
| 30 | 600893 | 航发动力  | 42,600  | 1,800,276.00 | 1.03 |
| 31 | 002572 | 索菲亚   | 98,900  | 1,722,838.00 | 0.99 |
| 32 | 300014 | 亿纬锂能  | 27,400  | 1,657,700.00 | 0.95 |
| 33 | 688116 | 天奈科技  | 35,433  | 1,621,059.75 | 0.93 |
| 34 | 603816 | 顾家家居  | 41,300  | 1,575,595.00 | 0.90 |
| 35 | 600009 | 上海机场  | 34,300  | 1,557,906.00 | 0.89 |
| 36 | 300498 | 温氏股份  | 84,500  | 1,550,575.00 | 0.89 |
| 37 | 002705 | 新宝股份  | 84,800  | 1,528,944.00 | 0.88 |
| 38 | 002100 | 天康生物  | 178,500 | 1,472,625.00 | 0.84 |
| 39 | 002078 | 太阳纸业  | 133,500 | 1,427,115.00 | 0.82 |
| 40 | 000951 | 中国重汽  | 78,500  | 1,322,725.00 | 0.76 |
| 41 | 601390 | 中国中铁  | 173,600 | 1,315,888.00 | 0.75 |
| 42 | 002327 | 富安娜   | 155,400 | 1,308,468.00 | 0.75 |
| 43 | 002050 | 三花智控  | 42,700  | 1,292,102.00 | 0.74 |
| 44 | 000768 | 中航西飞  | 47,100  | 1,259,925.00 | 0.72 |
| 45 | 300763 | 锦浪科技  | 12,000  | 1,249,200.00 | 0.72 |
| 46 | 000858 | 五粮液   | 7,600   | 1,243,132.00 | 0.71 |
| 47 | 000100 | TCL科技 | 299,200 | 1,178,848.00 | 0.68 |
| 48 | 002567 | 唐人神   | 177,100 | 1,177,715.00 | 0.67 |
| 49 | 000725 | 京东方 A | 285,400 | 1,167,286.00 | 0.67 |
| 50 | 002385 | 大北农   | 176,000 | 1,161,600.00 | 0.67 |
| 51 | 601238 | 广汽集团  | 109,000 | 1,135,780.00 | 0.65 |
| 52 | 300702 | 天宇股份  | 45,000  | 1,092,150.00 | 0.63 |
| 53 | 601139 | 深圳燃气  | 148,800 | 1,084,752.00 | 0.62 |
| 54 | 603986 | 兆易创新  | 10,000  | 1,062,500.00 | 0.61 |
| 55 | 002709 | 天赐材料  | 25,700  | 1,058,583.00 | 0.61 |
| 56 | 300408 | 三环集团  | 35,500  | 1,041,925.00 | 0.60 |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 57 | 300776 | 帝尔激光 | 15,600  | 1,012,440.00 | 0.58 |
| 58 | 688063 | 派能科技 | 4,844   | 960,323.00   | 0.55 |
| 59 | 688348 | 昱能科技 | 5,000   | 939,150.00   | 0.54 |
| 60 | 600399 | 抚顺特钢 | 88,400  | 901,680.00   | 0.52 |
| 61 | 002025 | 航天电器 | 14,000  | 893,200.00   | 0.51 |
| 62 | 601958 | 金钼股份 | 80,100  | 893,115.00   | 0.51 |
| 63 | 688981 | 中芯国际 | 17,338  | 875,915.76   | 0.50 |
| 64 | 300593 | 新雷能  | 35,900  | 822,469.00   | 0.47 |
| 65 | 002241 | 歌尔股份 | 46,000  | 816,500.00   | 0.47 |
| 66 | 002916 | 深南电路 | 10,000  | 753,700.00   | 0.43 |
| 67 | 603517 | 绝味食品 | 19,900  | 739,285.00   | 0.42 |
| 68 | 603345 | 安井食品 | 4,500   | 660,600.00   | 0.38 |
| 69 | 300919 | 中伟股份 | 10,000  | 602,500.00   | 0.35 |
| 70 | 002600 | 领益智造 | 86,600  | 598,406.00   | 0.34 |
| 71 | 002984 | 森麒麟  | 18,000  | 566,280.00   | 0.32 |
| 72 | 603228 | 景旺电子 | 20,080  | 515,052.00   | 0.30 |
| 73 | 600567 | 山鹰国际 | 200,000 | 458,000.00   | 0.26 |
| 74 | 603337 | 杰克股份 | 20,000  | 380,800.00   | 0.22 |
| 75 | 002938 | 鹏鼎控股 | 15,000  | 364,350.00   | 0.21 |
| 76 | 000636 | 风华高科 | 20,000  | 306,800.00   | 0.18 |
| 77 | 002212 | 天融信  | 30,000  | 291,000.00   | 0.17 |
| 78 | 300223 | 北京君正 | 2,000   | 176,620.00   | 0.10 |
| 79 | 688017 | 绿的谐波 | 1,000   | 162,400.00   | 0.09 |
| 80 | 300308 | 中际旭创 | 1,000   | 147,450.00   | 0.08 |
| 81 | 601899 | 紫金矿业 | 10,000  | 113,700.00   | 0.07 |
| 82 | 688486 | 龙迅股份 | 888     | 93,355.44    | 0.05 |
| 83 | 301195 | 北路智控 | 1,672   | 77,848.32    | 0.04 |
| 84 | 688429 | 时创能源 | 1,887   | 53,982.27    | 0.03 |
| 85 | 300037 | 新宙邦  | 1,000   | 51,890.00    | 0.03 |
| 86 | 603939 | 益丰药房 | 1,400   | 51,800.00    | 0.03 |
| 87 | 688631 | 莱斯信息 | 1,472   | 47,530.20    | 0.03 |

|     |        |      |       |           |      |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 88  | 688603 | 天承科技 | 834   | 45,870.00 | 0.03 |
| 89  | 301261 | 恒工精密 | 1,155 | 42,619.50 | 0.02 |
| 90  | 301202 | 朗威股份 | 1,597 | 41,234.54 | 0.02 |
| 91  | 688420 | 美腾科技 | 1,032 | 39,969.36 | 0.02 |
| 92  | 001286 | 陕西能源 | 3,767 | 35,447.47 | 0.02 |
| 93  | 300476 | 胜宏科技 | 1,000 | 24,110.00 | 0.01 |
| 94  | 002463 | 沪电股份 | 1,000 | 20,940.00 | 0.01 |
| 95  | 688256 | 寒武纪  | 100   | 18,800.00 | 0.01 |
| 96  | 688095 | 福昕软件 | 140   | 17,693.20 | 0.01 |
| 97  | 603520 | 司太立  | 1,000 | 16,680.00 | 0.01 |
| 98  | 001324 | 长青科技 | 792   | 16,641.04 | 0.01 |
| 99  | 688249 | 晶合集成 | 803   | 14,502.18 | 0.01 |
| 100 | 301293 | 三博脑科 | 180   | 12,855.60 | 0.01 |
| 101 | 000807 | 云铝股份 | 900   | 11,457.00 | 0.01 |
| 102 | 688472 | 阿特斯  | 661   | 11,263.44 | 0.01 |
| 103 | 301325 | 曼恩斯特 | 100   | 10,795.00 | 0.01 |
| 104 | 603638 | 艾迪精密 | 500   | 10,260.00 | 0.01 |
| 105 | 688361 | 中科飞测 | 143   | 9,247.81  | 0.01 |
| 106 | 688629 | 华丰科技 | 482   | 8,960.38  | 0.01 |
| 107 | 301358 | 湖南裕能 | 199   | 8,535.11  | 0.00 |
| 108 | 688531 | 日联科技 | 58    | 7,886.26  | 0.00 |
| 109 | 301260 | 格力博  | 319   | 7,537.97  | 0.00 |
| 110 | 688146 | 中船特气 | 175   | 6,672.75  | 0.00 |
| 111 | 301408 | 华人健康 | 386   | 6,542.70  | 0.00 |
| 112 | 301429 | 森泰股份 | 311   | 6,537.22  | 0.00 |
| 113 | 688543 | 国科军工 | 123   | 6,525.15  | 0.00 |
| 114 | 301382 | 蜂助手  | 196   | 6,436.64  | 0.00 |
| 115 | 301387 | 光大同创 | 137   | 6,214.32  | 0.00 |
| 116 | 688334 | 西高院  | 375   | 6,078.75  | 0.00 |
| 117 | 688552 | 航天南湖 | 253   | 5,945.50  | 0.00 |
| 118 | 688620 | 安凯微  | 470   | 5,799.80  | 0.00 |



|     |        |      |     |          |      |
|-----|--------|------|-----|----------|------|
| 119 | 688535 | 华海诚科 | 108 | 5,532.84 | 0.00 |
| 120 | 301332 | 德尔玛  | 394 | 5,409.62 | 0.00 |
| 121 | 688433 | 华曙高科 | 167 | 5,260.50 | 0.00 |
| 122 | 688410 | 山外山  | 100 | 5,250.00 | 0.00 |
| 123 | 603658 | 安图生物 | 100 | 5,173.00 | 0.00 |
| 124 | 301305 | 朗坤环境 | 260 | 5,119.40 | 0.00 |
| 125 | 301428 | 世纪恒通 | 161 | 4,926.60 | 0.00 |
| 126 | 301373 | 凌玮科技 | 152 | 4,841.20 | 0.00 |
| 127 | 688570 | 天玛智控 | 189 | 4,787.37 | 0.00 |
| 128 | 301157 | 华塑科技 | 90  | 4,763.70 | 0.00 |
| 129 | 688581 | 安杰思  | 39  | 4,603.17 | 0.00 |
| 130 | 301246 | 宏源药业 | 149 | 4,575.79 | 0.00 |
| 131 | 301281 | 科源制药 | 179 | 4,492.90 | 0.00 |
| 132 | 688002 | 睿创微纳 | 100 | 4,480.00 | 0.00 |
| 133 | 301322 | 绿通科技 | 81  | 4,312.44 | 0.00 |
| 134 | 301386 | 未来电器 | 179 | 4,258.41 | 0.00 |
| 135 | 601061 | 中信金属 | 528 | 4,002.24 | 0.00 |
| 136 | 301337 | 亚华电子 | 131 | 3,978.47 | 0.00 |
| 137 | 300759 | 康龙化成 | 100 | 3,828.00 | 0.00 |
| 138 | 688479 | 友车科技 | 128 | 3,774.72 | 0.00 |
| 139 | 301439 | 泓淋电力 | 215 | 3,633.50 | 0.00 |
| 140 | 603135 | 中重科技 | 180 | 3,220.20 | 0.00 |
| 141 | 601065 | 江盐集团 | 205 | 2,427.20 | 0.00 |
| 142 | 601133 | 柏诚股份 | 186 | 2,280.36 | 0.00 |
| 143 | 603137 | 恒尚节能 | 133 | 2,272.97 | 0.00 |
| 144 | 301345 | 涛涛车业 | 47  | 2,192.08 | 0.00 |
| 145 | 001282 | 三联锻造 | 64  | 2,113.92 | 0.00 |
| 146 | 001328 | 登康口腔 | 81  | 2,064.69 | 0.00 |
| 147 | 001360 | 南矿集团 | 100 | 1,487.00 | 0.00 |
| 148 | 603125 | 常青科技 | 60  | 1,471.80 | 0.00 |
| 149 | 001367 | 海森药业 | 33  | 1,302.84 | 0.00 |

|     |        |      |     |        |      |
|-----|--------|------|-----|--------|------|
| 150 | 600166 | 福田汽车 | 100 | 340.00 | 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  | 601318 | 中国平安 | 21,574,300.25 | 12.82          |
| 2  | 300476 | 胜宏科技 | 20,585,840.00 | 12.23          |
| 3  | 300369 | 绿盟科技 | 19,240,156.39 | 11.43          |
| 4  | 000001 | 平安银行 | 18,505,328.00 | 11.00          |
| 5  | 300674 | 宇信科技 | 17,977,999.84 | 10.68          |
| 6  | 002938 | 鹏鼎控股 | 17,696,407.38 | 10.52          |
| 7  | 300223 | 北京君正 | 16,562,713.53 | 9.84           |
| 8  | 600031 | 三一重工 | 16,299,013.00 | 9.69           |
| 9  | 603228 | 景旺电子 | 15,218,295.89 | 9.04           |
| 10 | 688169 | 石头科技 | 15,174,952.15 | 9.02           |
| 11 | 600183 | 生益科技 | 14,919,334.82 | 8.87           |
| 12 | 603986 | 兆易创新 | 14,012,552.00 | 8.33           |
| 13 | 300413 | 芒果超媒 | 13,977,673.90 | 8.31           |
| 14 | 601233 | 桐昆股份 | 13,781,653.00 | 8.19           |
| 15 | 000636 | 风华高科 | 13,389,734.00 | 7.96           |
| 16 | 688116 | 天奈科技 | 13,376,181.08 | 7.95           |
| 17 | 600703 | 三安光电 | 13,247,545.00 | 7.87           |
| 18 | 002271 | 东方雨虹 | 12,795,096.00 | 7.60           |
| 19 | 002212 | 天融信  | 12,752,934.39 | 7.58           |
| 20 | 603501 | 韦尔股份 | 12,605,977.70 | 7.49           |
| 21 | 002373 | 千方科技 | 12,363,396.28 | 7.35           |
| 22 | 601658 | 邮储银行 | 12,362,446.00 | 7.35           |
| 23 | 002916 | 深南电路 | 12,183,281.37 | 7.24           |
| 24 | 300768 | 迪普科技 | 12,110,247.27 | 7.20           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 25 | 603486 | 科沃斯  | 11,621,895.74 | 6.91 |
| 26 | 688981 | 中芯国际 | 11,179,616.54 | 6.64 |
| 27 | 603232 | 格尔软件 | 11,139,734.34 | 6.62 |
| 28 | 002236 | 大华股份 | 11,118,526.00 | 6.61 |
| 29 | 600887 | 伊利股份 | 10,663,527.85 | 6.34 |
| 30 | 600977 | 中国电影 | 10,643,600.00 | 6.32 |
| 31 | 002705 | 新宝股份 | 10,619,387.00 | 6.31 |
| 32 | 601601 | 中国太保 | 9,894,728.00  | 5.88 |
| 33 | 002475 | 立讯精密 | 9,730,645.28  | 5.78 |
| 34 | 601888 | 中国中免 | 9,615,251.00  | 5.71 |
| 35 | 688012 | 中微公司 | 9,599,659.16  | 5.70 |
| 36 | 688099 | 晶晨股份 | 9,576,187.35  | 5.69 |
| 37 | 002405 | 四维图新 | 9,561,431.40  | 5.68 |
| 38 | 002600 | 领益智造 | 9,420,560.00  | 5.60 |
| 39 | 300308 | 中际旭创 | 9,067,908.00  | 5.39 |
| 40 | 002841 | 视源股份 | 9,009,873.00  | 5.35 |
| 41 | 603225 | 新凤鸣  | 8,843,388.00  | 5.26 |
| 42 | 000858 | 五粮液  | 8,834,088.00  | 5.25 |
| 43 | 300433 | 蓝思科技 | 8,661,856.55  | 5.15 |
| 44 | 600383 | 金地集团 | 8,646,597.01  | 5.14 |
| 45 | 000651 | 格力电器 | 8,597,729.00  | 5.11 |
| 46 | 002230 | 科大讯飞 | 8,565,227.00  | 5.09 |
| 47 | 002008 | 大族激光 | 8,562,377.00  | 5.09 |
| 48 | 600745 | 闻泰科技 | 8,538,738.51  | 5.07 |
| 49 | 002415 | 海康威视 | 8,135,352.00  | 4.83 |
| 50 | 300408 | 三环集团 | 8,101,161.64  | 4.81 |
| 51 | 600036 | 招商银行 | 8,014,968.70  | 4.76 |
| 52 | 601728 | 中国电信 | 7,882,878.00  | 4.68 |
| 53 | 600050 | 中国联通 | 7,830,848.00  | 4.65 |
| 54 | 300502 | 新易盛  | 7,583,435.43  | 4.51 |
| 55 | 300750 | 宁德时代 | 7,511,461.00  | 4.46 |

|    |        |       |              |      |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 56 | 300253 | 卫宁健康  | 7,455,933.00 | 4.43 |
| 57 | 603517 | 绝味食品  | 7,335,884.00 | 4.36 |
| 58 | 688200 | 华峰测控  | 6,935,552.56 | 4.12 |
| 59 | 600519 | 贵州茅台  | 6,867,731.00 | 4.08 |
| 60 | 300770 | 新媒股份  | 6,759,687.20 | 4.02 |
| 61 | 300014 | 亿纬锂能  | 6,685,710.00 | 3.97 |
| 62 | 002555 | 三七互娱  | 6,631,419.00 | 3.94 |
| 63 | 688018 | 乐鑫科技  | 6,626,700.24 | 3.94 |
| 64 | 002156 | 通富微电  | 6,602,982.00 | 3.92 |
| 65 | 002371 | 北方华创  | 6,480,181.36 | 3.85 |
| 66 | 603690 | 至纯科技  | 6,477,085.08 | 3.85 |
| 67 | 002402 | 和而泰   | 6,343,843.67 | 3.77 |
| 68 | 600905 | 三峡能源  | 6,338,327.00 | 3.77 |
| 69 | 600570 | 恒生电子  | 6,017,993.30 | 3.58 |
| 70 | 688008 | 澜起科技  | 5,999,059.86 | 3.56 |
| 71 | 601336 | 新华保险  | 5,977,719.00 | 3.55 |
| 72 | 601138 | 工业富联  | 5,907,823.00 | 3.51 |
| 73 | 000100 | TCL科技 | 5,865,737.00 | 3.49 |
| 74 | 601111 | 中国国航  | 5,793,642.00 | 3.44 |
| 75 | 300036 | 超图软件  | 5,777,661.00 | 3.43 |
| 76 | 601688 | 华泰证券  | 5,742,151.79 | 3.41 |
| 77 | 688126 | 沪硅产业  | 5,715,070.84 | 3.40 |
| 78 | 000333 | 美的集团  | 5,639,931.00 | 3.35 |
| 79 | 002532 | 天山铝业  | 5,611,201.00 | 3.33 |
| 80 | 000002 | 万科A   | 5,549,585.00 | 3.30 |
| 81 | 600919 | 江苏银行  | 5,524,675.00 | 3.28 |
| 82 | 688256 | 寒武纪   | 5,493,011.37 | 3.26 |
| 83 | 300687 | 赛意信息  | 5,404,847.00 | 3.21 |
| 84 | 002557 | 洽洽食品  | 5,403,368.03 | 3.21 |
| 85 | 600584 | 长电科技  | 5,374,462.00 | 3.19 |
| 86 | 603885 | 吉祥航空  | 5,253,365.00 | 3.12 |

|     |        |       |              |      |
|-----|--------|-------|--------------|------|
| 87  | 300999 | 金龙鱼   | 5,193,947.00 | 3.09 |
| 88  | 002100 | 天康生物  | 5,162,407.36 | 3.07 |
| 89  | 688201 | 信安世纪  | 5,148,283.87 | 3.06 |
| 90  | 688696 | 极米科技  | 5,107,272.97 | 3.03 |
| 91  | 002984 | 森麒麟   | 5,079,935.90 | 3.02 |
| 92  | 300638 | 广和通   | 5,033,069.50 | 2.99 |
| 93  | 600567 | 山鹰国际  | 5,024,930.00 | 2.99 |
| 94  | 300919 | 中伟股份  | 4,985,133.30 | 2.96 |
| 95  | 601128 | 常熟银行  | 4,872,696.00 | 2.90 |
| 96  | 600030 | 中信证券  | 4,836,663.00 | 2.87 |
| 97  | 688082 | 盛美上海  | 4,832,759.01 | 2.87 |
| 98  | 300866 | 安克创新  | 4,817,512.00 | 2.86 |
| 99  | 300451 | 创业慧康  | 4,774,445.00 | 2.84 |
| 100 | 002567 | 唐人神   | 4,732,251.00 | 2.81 |
| 101 | 688063 | 派能科技  | 4,690,763.80 | 2.79 |
| 102 | 600859 | 王府井   | 4,536,136.99 | 2.70 |
| 103 | 300133 | 华策影视  | 4,501,500.82 | 2.67 |
| 104 | 688363 | 华熙生物  | 4,486,828.48 | 2.67 |
| 105 | 000725 | 京东方 A | 4,453,181.00 | 2.65 |
| 106 | 601186 | 中国铁建  | 4,428,213.00 | 2.63 |
| 107 | 002439 | 启明星辰  | 4,324,628.00 | 2.57 |
| 108 | 000998 | 隆平高科  | 4,316,254.00 | 2.56 |
| 109 | 601528 | 瑞丰银行  | 4,303,089.00 | 2.56 |
| 110 | 000997 | 新大陆   | 4,172,301.00 | 2.48 |
| 111 | 002241 | 歌尔股份  | 4,151,343.00 | 2.47 |
| 112 | 002507 | 涪陵榨菜  | 4,094,981.00 | 2.43 |
| 113 | 600985 | 淮北矿业  | 4,033,737.50 | 2.40 |
| 114 | 600900 | 长江电力  | 3,967,692.00 | 2.36 |
| 115 | 600004 | 白云机场  | 3,961,013.00 | 2.35 |
| 116 | 300911 | 亿田智能  | 3,850,889.00 | 2.29 |
| 117 | 601665 | 齐鲁银行  | 3,839,039.00 | 2.28 |

|     |        |      |              |      |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 118 | 002223 | 鱼跃医疗 | 3,828,962.00 | 2.28 |
| 119 | 600352 | 浙江龙盛 | 3,788,968.00 | 2.25 |
| 120 | 688036 | 传音控股 | 3,788,461.76 | 2.25 |
| 121 | 301097 | 天益医疗 | 3,772,856.00 | 2.24 |
| 122 | 600536 | 中国软件 | 3,760,951.32 | 2.23 |
| 123 | 603799 | 华友钴业 | 3,733,110.00 | 2.22 |
| 124 | 000786 | 北新建材 | 3,725,805.00 | 2.21 |
| 125 | 603186 | 华正新材 | 3,720,154.00 | 2.21 |
| 126 | 001979 | 招商蛇口 | 3,707,614.00 | 2.20 |
| 127 | 002293 | 罗莱生活 | 3,647,521.00 | 2.17 |
| 128 | 300776 | 帝尔激光 | 3,640,084.60 | 2.16 |
| 129 | 601577 | 长沙银行 | 3,635,368.00 | 2.16 |
| 130 | 603313 | 梦百合  | 3,622,925.02 | 2.15 |
| 131 | 603899 | 晨光股份 | 3,621,777.32 | 2.15 |
| 132 | 002572 | 索菲亚  | 3,617,079.00 | 2.15 |
| 133 | 002385 | 大北农  | 3,599,342.00 | 2.14 |
| 134 | 300747 | 锐科激光 | 3,572,218.20 | 2.12 |
| 135 | 600188 | 兖矿能源 | 3,563,530.00 | 2.12 |
| 136 | 601800 | 中国交建 | 3,511,343.00 | 2.09 |
| 137 | 603818 | 曲美家居 | 3,459,558.00 | 2.06 |
| 138 | 688369 | 致远互联 | 3,445,847.83 | 2.05 |
| 139 | 688288 | 鸿泉物联 | 3,396,862.94 | 2.02 |
| 140 | 300659 | 中孚信息 | 3,384,017.00 | 2.01 |
| 141 | 300251 | 光线传媒 | 3,367,273.85 | 2.00 |

注：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  | 601318 | 中国平安 | 27,318,480.00 | 16.23          |

|    |        |      |               |       |
|----|--------|------|---------------|-------|
| 2  | 000001 | 平安银行 | 23,307,589.00 | 13.85 |
| 3  | 300476 | 胜宏科技 | 20,902,145.40 | 12.42 |
| 4  | 300369 | 绿盟科技 | 20,496,468.46 | 12.18 |
| 5  | 600031 | 三一重工 | 18,102,115.00 | 10.76 |
| 6  | 300223 | 北京君正 | 17,090,028.68 | 10.16 |
| 7  | 002938 | 鹏鼎控股 | 16,966,504.00 | 10.08 |
| 8  | 300674 | 宇信科技 | 16,612,349.40 | 9.87  |
| 9  | 002212 | 天融信  | 16,013,155.73 | 9.52  |
| 10 | 603228 | 景旺电子 | 15,310,373.40 | 9.10  |
| 11 | 603986 | 兆易创新 | 14,834,042.15 | 8.81  |
| 12 | 600183 | 生益科技 | 14,813,331.40 | 8.80  |
| 13 | 300768 | 迪普科技 | 14,541,455.60 | 8.64  |
| 14 | 688116 | 天奈科技 | 13,903,159.43 | 8.26  |
| 15 | 000858 | 五粮液  | 13,788,479.00 | 8.19  |
| 16 | 002373 | 千方科技 | 13,636,016.00 | 8.10  |
| 17 | 600703 | 三安光电 | 13,192,112.42 | 7.84  |
| 18 | 688169 | 石头科技 | 12,946,845.29 | 7.69  |
| 19 | 300413 | 芒果超媒 | 12,774,390.04 | 7.59  |
| 20 | 000636 | 风华高科 | 12,462,424.00 | 7.41  |
| 21 | 601658 | 邮储银行 | 12,185,440.00 | 7.24  |
| 22 | 603501 | 韦尔股份 | 11,853,730.29 | 7.04  |
| 23 | 000651 | 格力电器 | 11,799,901.00 | 7.01  |
| 24 | 300308 | 中际旭创 | 11,771,347.06 | 7.00  |
| 25 | 600036 | 招商银行 | 11,742,837.00 | 6.98  |
| 26 | 002916 | 深南电路 | 11,536,952.00 | 6.86  |
| 27 | 002236 | 大华股份 | 11,194,636.00 | 6.65  |
| 28 | 002230 | 科大讯飞 | 10,869,257.00 | 6.46  |
| 29 | 603232 | 格尔软件 | 10,840,949.00 | 6.44  |
| 30 | 601888 | 中国中免 | 10,778,504.00 | 6.41  |
| 31 | 601688 | 华泰证券 | 10,702,517.00 | 6.36  |
| 32 | 688981 | 中芯国际 | 10,667,900.97 | 6.34  |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 33 | 601233 | 桐昆股份 | 10,548,969.30 | 6.27 |
| 34 | 688012 | 中微公司 | 10,498,986.22 | 6.24 |
| 35 | 300502 | 新易盛  | 10,456,665.60 | 6.21 |
| 36 | 601601 | 中国太保 | 10,227,467.00 | 6.08 |
| 37 | 600887 | 伊利股份 | 9,724,778.00  | 5.78 |
| 38 | 688099 | 晶晨股份 | 9,625,495.08  | 5.72 |
| 39 | 002271 | 东方雨虹 | 9,521,053.00  | 5.66 |
| 40 | 002405 | 四维图新 | 9,469,012.92  | 5.63 |
| 41 | 002600 | 领益智造 | 9,239,026.00  | 5.49 |
| 42 | 002841 | 视源股份 | 8,852,348.00  | 5.26 |
| 43 | 000333 | 美的集团 | 8,850,783.13  | 5.26 |
| 44 | 600745 | 闻泰科技 | 8,813,561.00  | 5.24 |
| 45 | 002705 | 新宝股份 | 8,780,333.24  | 5.22 |
| 46 | 300433 | 蓝思科技 | 8,731,428.40  | 5.19 |
| 47 | 002008 | 大族激光 | 8,577,376.25  | 5.10 |
| 48 | 600383 | 金地集团 | 8,470,137.63  | 5.03 |
| 49 | 002555 | 三七互娱 | 8,134,921.33  | 4.83 |
| 50 | 002415 | 海康威视 | 7,899,115.50  | 4.69 |
| 51 | 600050 | 中国联通 | 7,894,996.00  | 4.69 |
| 52 | 600919 | 江苏银行 | 7,872,212.00  | 4.68 |
| 53 | 601728 | 中国电信 | 7,787,498.92  | 4.63 |
| 54 | 300253 | 卫宁健康 | 7,537,516.20  | 4.48 |
| 55 | 600519 | 贵州茅台 | 7,438,726.00  | 4.42 |
| 56 | 300788 | 中信出版 | 7,265,076.00  | 4.32 |
| 57 | 688126 | 沪硅产业 | 7,216,626.99  | 4.29 |
| 58 | 300770 | 新媒股份 | 7,169,485.02  | 4.26 |
| 59 | 300133 | 华策影视 | 7,068,097.00  | 4.20 |
| 60 | 603517 | 绝味食品 | 6,970,314.00  | 4.14 |
| 61 | 300408 | 三环集团 | 6,931,409.00  | 4.12 |
| 62 | 002156 | 通富微电 | 6,884,766.80  | 4.09 |
| 63 | 300750 | 宁德时代 | 6,864,343.20  | 4.08 |



|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 64 | 002371 | 北方华创 | 6,854,468.49 | 4.07 |
| 65 | 688696 | 极米科技 | 6,815,556.00 | 4.05 |
| 66 | 688018 | 乐鑫科技 | 6,775,769.16 | 4.03 |
| 67 | 688200 | 华峰测控 | 6,749,564.81 | 4.01 |
| 68 | 300036 | 超图软件 | 6,740,582.00 | 4.01 |
| 69 | 601336 | 新华保险 | 6,638,644.00 | 3.94 |
| 70 | 603690 | 至纯科技 | 6,508,811.04 | 3.87 |
| 71 | 603486 | 科沃斯  | 6,382,945.00 | 3.79 |
| 72 | 002402 | 和而泰  | 6,282,504.50 | 3.73 |
| 73 | 601138 | 工业富联 | 6,164,474.00 | 3.66 |
| 74 | 002100 | 天康生物 | 6,155,560.00 | 3.66 |
| 75 | 600570 | 恒生电子 | 5,912,028.20 | 3.51 |
| 76 | 600567 | 山鹰国际 | 5,831,982.00 | 3.47 |
| 77 | 688008 | 澜起科技 | 5,821,434.36 | 3.46 |
| 78 | 600584 | 长电科技 | 5,796,029.46 | 3.44 |
| 79 | 300687 | 赛意信息 | 5,764,741.00 | 3.43 |
| 80 | 002532 | 天山铝业 | 5,674,967.00 | 3.37 |
| 81 | 603225 | 新凤鸣  | 5,609,776.00 | 3.33 |
| 82 | 600977 | 中国电影 | 5,579,999.00 | 3.32 |
| 83 | 688256 | 寒武纪  | 5,526,274.95 | 3.28 |
| 84 | 002567 | 唐人神  | 5,473,651.00 | 3.25 |
| 85 | 000002 | 万科A  | 5,385,768.50 | 3.20 |
| 86 | 603885 | 吉祥航空 | 5,214,594.00 | 3.10 |
| 87 | 002475 | 立讯精密 | 5,111,959.00 | 3.04 |
| 88 | 300014 | 亿纬锂能 | 5,072,715.73 | 3.01 |
| 89 | 300866 | 安克创新 | 5,064,039.00 | 3.01 |
| 90 | 688201 | 信安世纪 | 5,007,399.44 | 2.98 |
| 91 | 300999 | 金龙鱼  | 4,969,294.00 | 2.95 |
| 92 | 600030 | 中信证券 | 4,916,016.00 | 2.92 |
| 93 | 600048 | 保利发展 | 4,913,683.50 | 2.92 |
| 94 | 300037 | 新宙邦  | 4,859,361.00 | 2.89 |

|     |        |       |              |      |
|-----|--------|-------|--------------|------|
| 95  | 300638 | 广和通   | 4,848,779.00 | 2.88 |
| 96  | 688082 | 盛美上海  | 4,846,313.29 | 2.88 |
| 97  | 601128 | 常熟银行  | 4,793,883.00 | 2.85 |
| 98  | 300451 | 创业慧康  | 4,792,575.00 | 2.85 |
| 99  | 600859 | 王府井   | 4,722,288.78 | 2.81 |
| 100 | 300251 | 光线传媒  | 4,669,770.00 | 2.77 |
| 101 | 000100 | TCL科技 | 4,656,924.11 | 2.77 |
| 102 | 000786 | 北新建材  | 4,539,147.00 | 2.70 |
| 103 | 300911 | 亿田智能  | 4,500,684.80 | 2.67 |
| 104 | 601186 | 中国铁建  | 4,484,421.00 | 2.66 |
| 105 | 002984 | 森麒麟   | 4,393,288.34 | 2.61 |
| 106 | 688036 | 传音控股  | 4,289,730.85 | 2.55 |
| 107 | 002439 | 启明星辰  | 4,231,163.00 | 2.51 |
| 108 | 000997 | 新大陆   | 4,230,442.09 | 2.51 |
| 109 | 000725 | 京东方 A | 4,224,273.00 | 2.51 |
| 110 | 601528 | 瑞丰银行  | 4,219,482.00 | 2.51 |
| 111 | 600958 | 东方证券  | 4,182,828.00 | 2.49 |
| 112 | 603799 | 华友钴业  | 4,175,543.00 | 2.48 |
| 113 | 600309 | 万华化学  | 4,091,491.00 | 2.43 |
| 114 | 300919 | 中伟股份  | 4,056,176.60 | 2.41 |
| 115 | 600900 | 长江电力  | 4,020,797.00 | 2.39 |
| 116 | 000807 | 云铝股份  | 3,975,170.00 | 2.36 |
| 117 | 002507 | 涪陵榨菜  | 3,916,410.80 | 2.33 |
| 118 | 600985 | 淮北矿业  | 3,912,879.00 | 2.33 |
| 119 | 600572 | 康恩贝   | 3,864,455.00 | 2.30 |
| 120 | 600893 | 航发动力  | 3,864,079.00 | 2.30 |
| 121 | 300776 | 帝尔激光  | 3,826,388.80 | 2.27 |
| 122 | 601665 | 齐鲁银行  | 3,756,124.00 | 2.23 |
| 123 | 002241 | 歌尔股份  | 3,715,764.00 | 2.21 |
| 124 | 603186 | 华正新材  | 3,698,321.00 | 2.20 |
| 125 | 600352 | 浙江龙盛  | 3,684,078.00 | 2.19 |

|     |        |      |              |      |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 126 | 688063 | 派能科技 | 3,683,815.99 | 2.19 |
| 127 | 600536 | 中国软件 | 3,681,962.40 | 2.19 |
| 128 | 301097 | 天益医疗 | 3,647,127.00 | 2.17 |
| 129 | 600188 | 兖矿能源 | 3,589,589.00 | 2.13 |
| 130 | 601800 | 中国交建 | 3,565,461.00 | 2.12 |
| 131 | 688288 | 鸿泉物联 | 3,549,861.17 | 2.11 |
| 132 | 601577 | 长沙银行 | 3,533,426.24 | 2.10 |
| 133 | 300957 | 贝泰妮  | 3,515,463.48 | 2.09 |
| 134 | 603658 | 安图生物 | 3,443,552.00 | 2.05 |
| 135 | 603313 | 梦百合  | 3,437,041.70 | 2.04 |
| 136 | 002410 | 广联达  | 3,421,488.00 | 2.03 |
| 137 | 688111 | 金山办公 | 3,409,261.62 | 2.03 |
| 138 | 300747 | 锐科激光 | 3,406,444.00 | 2.02 |
| 139 | 688369 | 致远互联 | 3,404,841.58 | 2.02 |
| 140 | 600276 | 恒瑞医药 | 3,383,397.00 | 2.01 |

注：卖出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 | 1,314,126,177.07 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,345,765,706.53 |

注：买入股票成本、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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -             | -            |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | 10,160,128.77 | 5.82         |
|    | 其中：政策性金融债 | 10,160,128.77 | 5.82         |

|    |           |               |      |
|----|-----------|---------------|------|
| 4  | 企业债券      | -             | -    |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -    |
| 6  | 中期票据      | -             | -    |
| 7  | 可转债(可交换债) | -             | -    |
| 8  | 同业存单      | -             | -    |
| 9  | 其他        | -             | -    |
| 10 | 合计        | 10,160,128.77 | 5.82 |

### 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称   | 数量（张）   | 公允价值          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 220211 | 22国开11 | 100,000 | 10,160,128.77 | 5.82         |

### 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 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

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的期货合约，并根据对证券市场和期货市场运行趋势的研判，以及对股指期货合约的估值定价，与股票现货资产进行匹配，实现多头或空头的套期保值操作，由此获得股票组合产生的超额收益。本基金在运用股指期货时，将充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征，对冲系统性风险以及特殊情况下的流动性风险，以改善投资组合的风险收益特性。

### 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

本基金投资国债期货,将根据风险管理原则,充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征,在风险可控的前提下,适度参与国债期货投资。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未参与国债期货投资。

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 1) 2023年1月31日鱼跃医疗收到《镇江市市场监督管理局行政处罚决定书》，公司生产销售型号为YX306的指夹式脉搏血氧仪的销售价格上涨幅度明显高于成本增长幅度，镇江市市场监督管理局对公司作出责令改正相关违法行为，并处以270万元罚款的处罚决定。2) 新凤鸣因窗口期回购股票于2022年8月22日收到浙江证监局《关于对新凤鸣集团股份有限公司采取出具警示函措施的决定》。上述证券经研究员出具相关意见，并进行股票入库审批流程，基金管理人经过研究判断，按照相关投资决策流程投资了该股票。除此之外，本基金投资决策程序均符合相关法律法规的要求，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未超出基金合同规定的备选股票库。

### 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 | 123,739.66 |
| 2  | 应收清算款 | -          |
| 3  | 应收股利  | -          |
| 4  | 应收利息  | -          |
| 5  | 应收申购款 | 10,976.18  |
| 6  | 其他应收款 | -          |
| 7  | 待摊费用  | -          |
| 8  | 其他    | -          |
| 9  | 合计    | 134,715.84 |

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 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  |
| 4,699    | 28,448.91 | 0.00  | 0.00%  | 133,681,438.94 | 100.00% |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 持有份额总数（份）  | 占基金总份额比例 |
|------------------|------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 236,738.99 | 0.1771%  |

### 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                             | 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                | 10~50             |

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

|                            |                |
|----------------------------|----------------|
| 基金合同生效日(2016年06月03日)基金份额总额 | 212,527,217.99 |
| 本报告期期初基金份额总额               | 143,837,274.19 |
| 本报告期基金总申购份额                | 4,141,090.13   |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | 14,296,925.38  |
| 本报告期基金拆分变动份额               | -              |
| 本报告期期末基金份额总额               | 133,681,438.94 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 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、2023年4月17日，官恒秋先生离任兴业基金管理有限公司董事长、法定代表人，由叶文煌先生担任公司董事长、法定代表人。详见本公司于2023年4月19日发布的《兴业基金管理有限公司关于董事长变更的公告》。

2、2023年6月9日，胡斌先生离任兴业基金管理有限公司总经理，由董事长叶文煌先生代任公司总经理职务。详见本公司于2023年6月10日发布的《兴业基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。

3、本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、本基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

### 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

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关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 |    |
| 安信证券  | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 长江证券  | 2      | 439,507,495.45 | 16.55%       | 321,415.75 | 16.55%     | -  |
| 光大证券  | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 海通证券  | 2      | 893,489,521.45 | 33.64%       | 653,409.14 | 33.64%     | -  |
| 华安证券  | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 华创证券  | 2      | 219,392,718.40 | 8.26%        | 160,443.34 | 8.26%      | -  |
| 天风证券  | 2      | 649,696,121.77 | 24.46%       | 475,124.22 | 24.46%     | -  |
| 兴业证券  | 2      | 454,159,852.25 | 17.10%       | 332,126.23 | 17.10%     | -  |
| 太平洋证券 | 4      | -              | -            | -          | -          | -  |

①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

- i 资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于3 亿元人民币。
- ii 财务状况良好，经营行为规范，最近一年未因发生重大违规行为而受到有关管理机关处罚。
- iii 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需  
要，并能为本基金提供全面的信息服务。
- iv 投研交综合实力较强。
- v 其他因素(综合能力一般，但在某些特色领域或行业，研究能力、深度和质量在行业领先)。

②券商专用交易单元选择程序：

- i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估



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券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③在上述租用的券商交易单元中，本期无新增交易单元，无剔除交易单元。

### 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

无。

### 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  | 兴业成长动力灵活配置混合型证券投资基金2022年第4季度报告          | 中国证监会规定的媒介 | 2023-01-20 |
| 2  | 兴业成长动力灵活配置混合型证券投资基金 招募说明书（更新）（2023年第1号） | 中国证监会规定的媒介 | 2023-03-03 |
| 3  | 兴业成长动力灵活配置混合型证券投资基金2022年年度报告            | 中国证监会规定的媒介 | 2023-03-31 |
| 4  | 兴业基金管理有限公司关于董事长变更的公告                    | 中国证监会规定的媒介 | 2023-04-19 |
| 5  | 兴业基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金风险评价结果的通知       | 中国证监会规定的媒介 | 2023-04-20 |
| 6  | 兴业成长动力灵活配置混合型证券投资基金2023年第一季度报告          | 中国证监会规定的媒介 | 2023-04-21 |
| 7  | 兴业基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告                | 中国证监会规定的媒介 | 2023-06-10 |
| 8  | 兴业基金管理有限公司关于提醒投资者谨防金融诈骗活动的特别提示公告        | 中国证监会规定的媒介 | 2023-06-29 |

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

兴业成长动力灵活配置混合型证券投资基金于2023年8月19日公告，自2023年8月21日起降低兴业成长动力灵活配置混合型证券投资基金的管理费率及托管费率，其中管理费年费率由1.50%调整为1.20%，托管费年费率由0.25%调整为0.20%，并相应修订《兴业成长动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《兴业成长动力灵活配置混合型证券投资基金托管协议》等法律文件的相关条款。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予兴业成长动力灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件
- (二) 《兴业成长动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- (三) 《兴业成长动力灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- (四) 法律意见书
- (五) 基金管理人业务资格批件和营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件和营业执照
- (七) 中国证监会要求的其他文件

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的住所

### 12.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅。

网站：<http://www.cib-fund.com.cn>

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人兴业基金管理有限公司。

客户服务中心电话 4000095561

兴业基金管理有限公司  
二〇二三年八月三十一日