

# 兴银兴慧一年持有期混合型证券投资基金

2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人:兴银基金管理有限责任公司

基金托管人:兴业银行股份有限公司

报告送出日期:2023 年 03 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据基金合同规定，于2023年3月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

本报告期自2022年1月1日起至12月31日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	10
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....	15
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	15
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>16</b>
6.1 审计报告基本信息.....	16
6.2 审计报告的基本内容.....	16
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>18</b>
7.1 资产负债表.....	18
7.2 利润表.....	19
7.3 净资产（基金净值）变动表.....	21
7.4 报表附注.....	22
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>63</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	63
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	63
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	64
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	67
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	68

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	69
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	69
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	69
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	69
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	69
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	69
8.12 投资组合报告附注.....	70
<b>§ 9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>71</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	71
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	71
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	72
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产 品情况.....	72
<b>§ 10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>72</b>
<b>§ 11 重大事件揭示.....</b>	<b>72</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	72
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	73
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	73
11.4 基金投资策略的改变.....	73
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	73
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	73
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	73
11.8 其他重大事件.....	76
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>78</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	79
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	79
<b>§ 13 备查文件目录.....</b>	<b>79</b>
13.1 备查文件目录.....	79
13.2 存放地点.....	79
13.3 查阅方式.....	79

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	兴银兴慧一年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	兴银兴慧一年持有混合	
基金主代码	013676	
基金运作方式	契约型开放式 本基金对每份基金份额设置一年的最短持有期限，即：自基金合同生效日（对认购份额而言，下同）或基金份额申购确认日（对申购份额而言，下同）至该日一年后的年度对日的前一日期限内，投资者不能提出赎回申请；最短持有期限之后，投资者可以提出赎回申请。对日为非工作日的，顺延至下一工作日。若该月实际不存在对日的，则顺延至下一工作日。	
基金合同生效日	2021 年 10 月 26 日	
基金管理人	兴银基金管理有限责任公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,265,017,714.82 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	兴银兴慧一年持有混合 A	兴银兴慧一年持有混合 C
下属分级基金的交易代码	013676	013677
报告期末下属分级基金的份额总额	808,430,466.87 份	456,587,247.95 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，力争获得长期稳定的投资收益。	
投资策略	本基金采取稳健的大类资产配置策略，通过宏观策略研究，综合考虑宏观经济、国家财政政策、货币政策、产业政策以及市场流动性等方面的因素，对相关资产类别的周期位置和进行动态跟踪，根据各类资产的性价比决定大类资产配置比例。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×30%+中债综合指数收益率×70%	
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期风险与预期收益水平理论上高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。	
下属分级基金的风险收益特征	风险收益特征同上。	风险收益特征同上。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称		兴银基金管理有限责任公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵建兴	龚小武
	联系电话	86-21-20296318	021-52629999-212056
	电子邮箱	zjx@hffunds.cn	gongxiaowu@cib.com.cn
客户服务电话		40000-96326	95561
传真		86-21-68630069	021-62159217
注册地址		平潭综合实验区金井湾商务营运中心 6 号楼 11 层 03-3 房	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦
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	上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼
邮政编码		200120	200120
法定代表人		张贵云	吕家进

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.hffunds.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市南京西路 1266 号恒隆广场 2 期 16 楼
注册登记机构	兴银基金管理有限责任公司	上海市浦东新区滨江大道 5129 号陆家嘴滨江中心 N1 幢三层、五层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022 年		2021 年 10 月 26 日（基金合同生效日）-2021 年 12 月 31 日	
	兴银兴慧一年持有混合 A	兴银兴慧一年持有混合 C	兴银兴慧一年持有混合 A	兴银兴慧一年持有混合 C
本期已实现收益	-3,289,425.53	-2,664,334.52	9,066,555.95	4,905,925.43
本期利润	-19,407,342.53	-12,138,850.38	27,475,409.39	15,219,064.52
加权平均基金份额本期利润	-0.0153	-0.0167	0.0207	0.0205

本期加权平均净值利润率	-1.52%	-1.67%	2.05%	2.04%
本期基金份额净值增长率	-1.42%	-1.53%	2.06%	2.05%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2022 年末		2021 年末	
期末可供分配利润	4,641,257.77	2,079,246.89	9,112,315.23	5,051,183.61
期末可供分配基金份额利润	0.0057	0.0046	0.0068	0.0066
期末基金资产净值	813,346,615.25	458,822,354.70	1,364,089,000.81	776,779,681.35
期末基金份额净值	1.0061	1.0049	1.0206	1.0205
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2022 年末		2021 年末	
基金份额累计净值增长率	0.61%	0.49%	2.06%	2.05%

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

#### 兴银兴慧一年持有混合 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
过去三个月	0.94%	0.23%	0.21%	0.37%	0.73%	-0.14%
过去六个月	-0.72%	0.22%	-4.07%	0.32%	3.35%	-0.10%
过去一年	-1.42%	0.24%	-6.32%	0.38%	4.90%	-0.14%
自基金合同生效起至今	0.61%	0.23%	-5.90%	0.36%	6.51%	-0.13%

#### 兴银兴慧一年持有混合 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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

		②		④		
过去三个月	0.91%	0.23%	0.21%	0.37%	0.70%	-0.14%
过去六个月	-0.77%	0.22%	-4.07%	0.32%	3.30%	-0.10%
过去一年	-1.53%	0.24%	-6.32%	0.38%	4.79%	-0.14%
自基金合同生效起至今	0.49%	0.23%	-5.90%	0.36%	6.39%	-0.13%

注：1、本基金成立于 2021 年 10 月 26 日；2、比较基准：沪深 300 指数收益率\*30%+中债综合指数收益率\*70%。

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年10月26日-2022年12月31日)

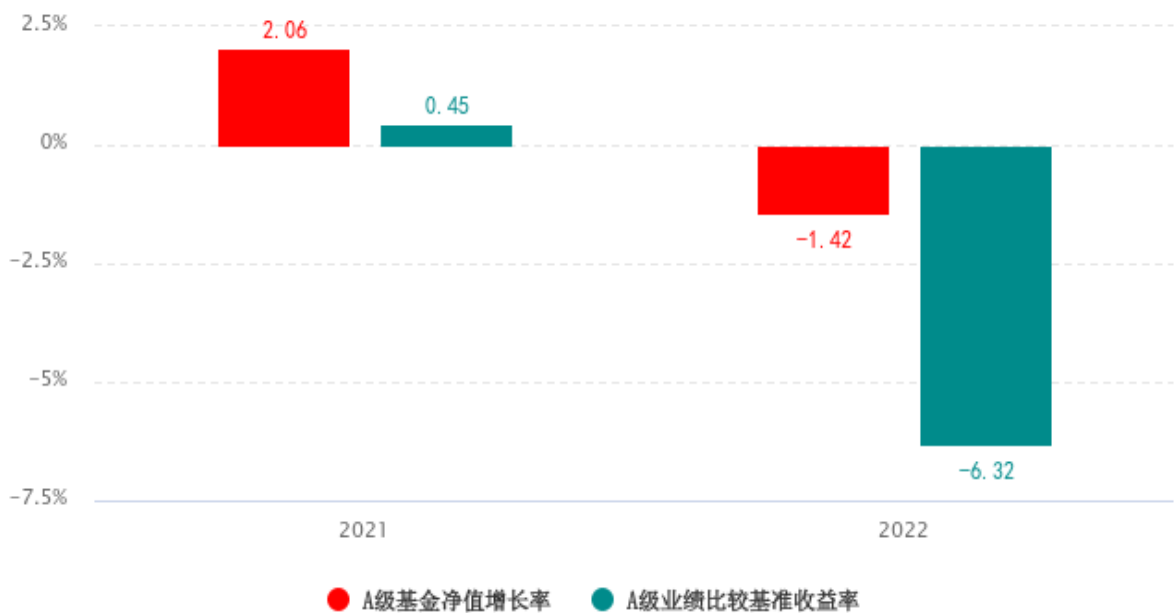


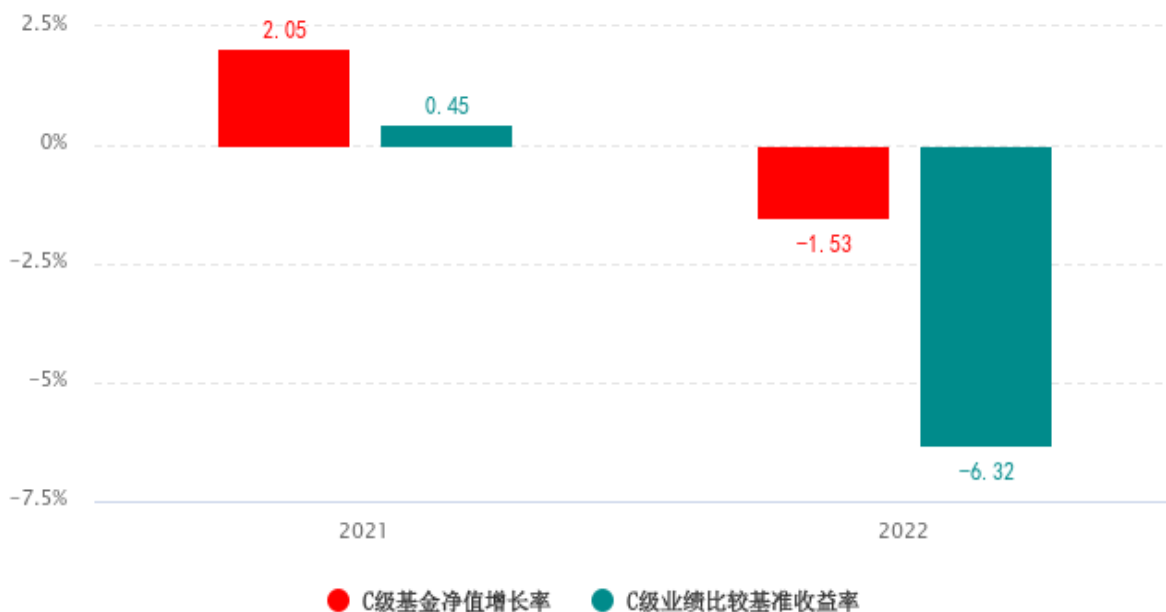
C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年10月26日-2022年12月31日)



注：1、本基金成立于 2021 年 10 月 26 日；2、比较基准：沪深 300 指数收益率\*30%+中债综合指数收益率\*70%。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





注：1、本基金成立于 2021 年 10 月 26 日；2、比较基准：沪深 300 指数收益率\*30%+中债综合指数收益率\*70%。

### 3.3 其他指标

注：无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金自成立日以来未进行过利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

兴银基金管理有限责任公司，注册地为福建省平潭综合实验区，公司主要办公场所位于上海市浦东新区。公司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，本公司共管理基金 47 只。

#### 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		
袁作栋	本基金的基金经理、公司多元资产投资部副总经理（主持工作）	2021-10-26	-	10年	硕士研究生。历任中兴通讯股份有限公司硬件工程师、商务总监，浙商基金管理有限公司投资研究部行业研究员，华夏久盈资产管理有限责任公司权益投资中心高级研究员（独立管理账户）。2019年6月加入兴银基金管理有限责任公司任行业研究员，现任兴银基金多元资产投资部副总经理（主持工作），兼任权益投资部基金经理。

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。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情形，无须披露该项。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人制定了公平交易管理的制度，并根据法律法规及监管规定结合实践予以修订完善。本基金管理人主要从研究的公平、决策的公平、交易的公平、公平交易的监控评估、公平交易的报告和信息披露等方面对公平交易行为进行规范，从而达到保证本基金管理人管理的不同投资组

合得到公平对待、保护投资者合法权益的目的。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人按照法律法规关于公平交易的相关规定，严格执行公司公平交易管理制度，加强了对所管理的不同投资组合间交易价差的分析，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。

##### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金管理人制定了异常交易监控管理的制度，并根据法律法规及监管规定结合实践予以修订完善。本报告期内，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年是逆水行舟的一年，我们坚持住均衡配置+高性价比资产的方法论，经受住了市场大幅度下行的考验。

股票投资方面。

消费领域是我们投资的第一大方向，食品股是我们重要的投资方向。食品工业化带来的速冻食品和预制菜领域巨大的发展空间，让我们坚定持有相关的龙头公司。啤酒和低端白酒都是我们看好的低价产品品质升级的方向，但是啤酒公司前期涨幅较大，从市值的角度而言，性价比开始变得一般，低端白酒公司的空间仍然具有吸引力，因此我们减少了啤酒的持仓，增加了低端白酒的持仓。家电领域做了一些调整，仍然持有产品周期上行的高端家电和品牌小家电，增加了白电龙头公司的持仓，主要原因是从 PB-ROE 的角度来看，公司的性价比已经开始具有吸引力。我们的中药持仓，12 月份回调幅度有些大，主要原因是部分资金在炒作中药对于疫情是否有效的短期主题，我们买入的理由是中期成长逻辑：品牌 OTC 放量和配方颗粒困境反转，当前的估值还比较便宜，因此我们继续持有。

科技领域，我们主要投资方向是军工和计算机，因为前几个月涨幅比较大，相关个股的性价比在持续变差，因此我们降低了科技领域的持仓，最后两个月，这两个行业回调幅度都比较大。到了年底，我们展望 2023 年发现计算机的性价比开始逐步显露，但是具体的投资标的还需要进一步的斟酌。军工处于不是很贵，但是也不便宜的状态下，因此我们的策略是持有。12 月份我们也更新了一下半导体、消费电子等领域的估值模型，发现性价比还不是很好，因此没有相关的投资。

周期和制造业领域，我们继续持有周期底部的重卡，石化等，随着地产保交房一系列政策的推出，重卡表现优秀。石化板块分化较大，我们发现估值和基本面匹配程度较好的个股韧性更好，这也让我们反思，如何在个股选择和研究的时候思考的更深刻，研究的更细致，对性价比的把握更准确。我们还有一些有色新材料，化工新材料，表现相对正常，其中性价比突出的个股，反弹的力度

也最大。

金融领域我们重点投资了财富管理型券商和一些零售型银行。地产的三支箭有助于活下来的地产公司继续活着，地产公司的流动性风险得到了很大的改善，这对于前期受到地产敞口冲击的银行而言，是一个重大的边际改善。我们考虑未来继续增加零售型银行的持仓。

债券投资方面。

可转债市场是我们观点变化比较大的方向，我们重点跟踪的一些转债标的，绝对价格已经下跌到了 110 元以下，开始进入到我们的射程。但是转债市场的流动性较小，我们只能慢慢买。我们还需要继续观察，银行理财产品等转债的投资者是否有进一步抛售的可能性，我们希望在下跌过程中，逐步地增加可转债仓位。

我们在利率债上的防守动作使得过去一段时间债券市场的回调对我们影响比较小，当利率的波动区间开始到 2.8% 以上，我们在观察，未来一段时间利率上行的相对极限位置在哪里，我们会择机配置。

经过市场的 V 型考验，我们更坚信我们投资框架的健壮性，同时让我们意识到，“高性价比”的标准很简单，用好这个标准却需要持续耐心细致的工作以及不断地自我反思，这也构成了我们自身的竞争优势。《周期》让我们对于市场的 Beta 有了更深刻的理解，我们将更坚定地在市场底部增加权益仓位，在市场相对高位降低权益仓位，为持有人提供更好的投资体验。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴银兴慧一年持有混合 A 基金份额净值为 1.0061 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.42%，同期业绩比较基准收益率为-6.32%；截至报告期末兴银兴慧一年持有混合 C 基金份额净值为 1.0049 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.53%，同期业绩比较基准收益率为-6.32%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，2023 年的宏观经济大概率表现比 2022 年要好。2022 年，我们的宏观经济遭受了疫情、俄乌冲突带来的能源危机以及美联储大幅度加息的三重冲击，全年 GDP 仍然完成了 120 万亿左右，显示出我们的经济具有超强的韧性。2023 年，疫情对经济冲击在减弱；俄乌冲突带来的能源错配已经消化完毕，石油价格已经跌回到冲突之前的水平；美国通胀得到控制，美联储进一步加息的空间相对较小。这些要素的改善都指示着 2023 年宏观环境要好于 2022 年。

从资产配置的角度而言，我们坚定的认为权益市场最具有性价比。权益市场的周期位置处于历史的底部，2023 年边际改善有利于市场情绪的修复。利率市场仍然需要等待合适的性价比，可转债开始进入到我们重点配置的阶段。

消费领域仍然是我们最看好的方向。受到阳达峰的影响，11 月份的社零数据很差，单月下滑的 5.9%，导致全年社零累计同比增速下滑 0.1%。展望 2023 年，消费总量数据大概率比 2022 年要好，只是复苏的幅度还有待进一步观察。中国的社零数据在 40 万亿以上，是全球第二大市场，在这个巨大的市场中，很容易产生各种结构性机会。我们秉承轻整体，重结构的投资方式，相信只要上市公司能够提供满足消费者需求的好产品，都有很好的机会。我们的挖掘的重心在消费品品牌

化、低价产品品质升级、消费品创新以及食品工业化。

以数字经济为代表的科技领域，是我们看好的第二大方向。一方面国家政策基于安全需求，需要补短板。同时，数字经济也是后地产时代宏观经济重要的增长点。内循环中，数字经济包含数字产业化以及产业数字化，都有着巨大的成长空间。外循环中，当前我国已经是全球第一大货物出口国，但是在服务贸易出口方面，尤其是数字经济的贸易出口方面，还有巨大的提升空间。

周期领域和金融领域，目前都处在景气周期的下行阶段，但是过去 2 年，市场通过大幅度的下跌也充分反应了很多景气下行，我们小心地在估值底部逐渐建立仓位，在估值合理的范围内，我们会淡化短期的交易。

虽然理智告诉我们，A 股是目前性价比最好的资产，但是市场的涨涨跌跌还是会影响我们的情绪。安下心来做研究是排遣压力的好手段，当我们仔细研究优秀公司的竞争优势和发展战略之时，他们乐观向上、努力拼搏的精神鼓舞了我们，坚信明天会更好！

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，不断健全完善内控机制，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行，推动公司的合规文化和内部控制机制的完善与优化。本基金管理人主要监察稽核工作如下：

(1) 加强公司和基金日常运作的合规审核。做好在新基金产品开发、新投资品种、及其他创新业务中法律、合规及风险控制方面的支持，坚持定期对投资、研究、交易、核算、销售等各项业务实施事前、事中、事后的合规性审核，确保基金运作的诚信和合法合规性符合监管要求。

(2) 深入重点专项稽核工作。本基金管理人进一步梳理业务模式、主要监管规则、潜在风险点等，全面、深入地对关键业务领域进行专项稽核，内容涵盖相关业务领域的各个重要环节的内部控制与风险防范，促进制度规章及时更新，优化操作流程，提升业务线合规管理及风控意识。

(3) 持续规范对投资研究交易特定岗位的通讯管理。对投资研究交易特定岗位通讯工具在交易时间集中管理，并定期或不定期对网络即时通讯记录、电话录音等进行抽查，有效地防范了各种形式的利益输送行为。

(4) 强化法规学习，开展内控培训，促进合规文化建设。本基金管理人及时根据新颁布的法律法规开展合规宣传培训工作，通过专题培训、律师讲座、合规期刊等多种形式进一步加强内部合规培训力度，深化基金从业人员合规风险意识，提升职业道德素养，营造良好合规氛围，促进公司稳定健康地发展。

(5) 完成各种定期报告及临时公告的信息披露工作。按照法规要求，做好旗下各支基金的信息披露工作，做到信息披露的真实、完整、准确、及时。

在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，完善内控制度，提高工作水平，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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运营保障部的公司领导担任，成员由基金事务部、风险管理部、合规稽核部、研究发展部、投资管理部门(视会议议题内容选择相关投资方向部门)部门负责人或其指定人员组成。估值小组成员具备应有的经验、专业胜任能力和独立性，分工明确，在上市公司研究和估值、基金投资、投资品种所属行业的专业研究、估值政策、估值流程和程序、基金的风险控制与绩效评估、会计政策与基金核算以及相关事项的合法合规性审核和监督等各个方面具备专业能力。估值小组严格按照工作流程诚实守信、勤勉尽责地讨论和决策估值事项。日常估值项目由基金事务部严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定执行。当经济环境和证券市场发生重大变化时，针对特殊估值工作，按照以下工作流程进行：由公司估值小组依据行业协会提供的估值模型和行业做法选定与当时市场经济环境相适应的估值方法并征求托管行、会计师事务所的相关意见，由基金事务部做出提示，对其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响是否在 0.25% 以上进行测算，并对确认产生影响的品种根据前述估值模型、估值流程计算，提供相关投资品种的公允价值以进行估值处理，待清算人员复核后，将估值结果反馈基金经理，并提交公司估值小组。其他特殊情形，可由基金经理主动做出提示，并由研究员提供研究报告，交估值小组审议，同时按流程对外公布。

#### 2、基金经理参与或决定估值的程度

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

#### 3、本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

#### 4、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息

无。

### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行利润分配，符合法律法规的规定及《基金合同》的约定。

### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

### 4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2300402 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	兴银兴慧一年持有期混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的兴银兴慧一年持有期混合型证券投资基金（以下简称“兴银兴慧一年持有基金”）财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表、2022 年度的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则（以下简称“企业会计准则”）、《资产管理产品相关会计处理规定》及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“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编制，公允反映了兴银兴慧一年持有基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责

	任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于兴银兴慧一年持有基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	兴银兴慧一年持有基金管理人兴银基金管理有限责任公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括兴银兴慧一年持有基金 2022 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人管理层负责按照企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及财务报表附注 7.4.2 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编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估兴银兴慧一年持有基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非兴银兴慧一年持有基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。基金管理人治理层负责监督兴银兴慧一年持有基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（3）评价基金管理人管理层

	选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时, 根据获取的审计证据, 就可能对兴银兴慧一年持有基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性, 审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露; 如果披露不充分, 我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而, 未来的事项或情况可能导致兴银兴慧一年持有基金不能持续经营。(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容, 并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通, 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	黄小熠	欧梦澈
会计师事务所的地址	上海市南京西路 1266 号恒隆广场 2 期 16 楼	
审计报告日期	2023-03-29	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体: 兴银兴慧一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日: 2022 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>			
银行存款	7.4.7.1	9,471,913.73	25,313,801.78
结算备付金		62,547,836.75	33,695,642.61
存出保证金		140,246.02	85,306.55
交易性金融资产	7.4.7.2	844,978,536.56	2,003,782,319.48
其中: 股票投资		303,548,579.08	322,762,337.78
基金投资		-	-
债券投资		541,429,957.48	1,681,019,981.70
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	359,898,945.02	80,000,000.00
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		6,262,220.71	-
应收股利		-	-
应收申购款		33.97	1,963,718.86
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	14,002,228.04
资产总计		1,283,299,732.76	2,158,843,017.32
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		5,436,202.52	15,037,896.28
应付赎回款		3,817,050.16	-
应付管理人报酬		1,127,569.10	1,785,659.71
应付托管费		225,513.84	357,131.93
应付销售服务费		40,839.53	63,973.60
应付投资顾问费		-	-
应交税费		125.68	11.16
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	483,461.98	729,662.48
负债合计		11,130,762.81	17,974,335.16
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	1,265,017,714.82	2,097,721,858.75
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	7,151,255.13	43,146,823.41
净资产合计		1,272,168,969.95	2,140,868,682.16
负债和净资产总计		1,283,299,732.76	2,158,843,017.32

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额总额 1,265,017,714.82 份。其中兴银兴慧一年持有混合 A 基金份额净值 1.0061 元，基金份额总额 808,430,466.87 份；兴银兴慧一年持有混合 C 基金份额净值 1.0049 元，基金份额总额 456,587,247.95 份。

## 7.2 利润表

会计主体：兴银兴慧一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 10 月 26 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-6,457,741.75	48,390,541.14
1. 利息收入		6,904,714.48	8,371,543.52
其中：存款利息收入	7.4.7.9	817,641.92	490,706.90
债券利息收入		-	5,620,890.56
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		6,087,072.56	2,259,946.06
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		12,229,976.63	11,297,005.09
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-31,208,534.65	11,241,163.31
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	38,503,745.80	55,841.78
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	4,934,765.48	-
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）	7.4.7.16	-25,592,432.86	28,721,992.53
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		25,088,451.16	5,696,067.23
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	20,126,307.57	3,778,240.66
2. 托管费	7.4.10.2.2	4,025,261.41	755,648.13
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	731,468.88	135,110.61
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		43.30	1.67
8. 其他费用	7.4.7.18	205,370.00	1,027,066.16
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-31,546,192.91	42,694,473.91
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-31,546,192.91	42,694,473.91
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-31,546,192.91	42,694,473.91

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：兴银兴慧一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 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）	2,097,721,858.75	-	43,146,823.41	2,140,868,682.16
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）	2,097,721,858.75	-	43,146,823.41	2,140,868,682.16
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-832,704,143.93	-	-35,995,568.28	-868,699,712.21
（一）、综合收益总额	-	-	31,546,192.91	-31,546,192.91
（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）	-832,704,143.93	-	-4,449,375.37	-837,153,519.30
其中：1. 基金申购款	30,443,923.10	-	394,999.26	30,838,922.36
2. 基金赎回款	-863,148,067.03	-	-4,844,374.63	-867,992,441.66
（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）	1,265,017,714.82	-	7,151,255.13	1,272,168,969.95
项 目	上年度可比期间 2021 年 10 月 26 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 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	2,067,152,784.91	-	-	2,067,152,784.91

金净值)				
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）	2,067,152,784.91	-	-	2,067,152,784.91
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	30,569,073.84	-	43,146,823.41	73,715,897.25
（一）、综合收益总额	-	-	42,694,473.91	42,694,473.91
（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）	30,569,073.84	-	452,349.50	31,021,423.34
其中：1. 基金申购款	30,569,073.84	-	452,349.50	31,021,423.34
2. 基金赎回款	-	-	-	-
（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）	2,097,721,858.75	-	43,146,823.41	2,140,868,682.16

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

赵建兴

刘钊

崔可

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

兴银兴慧一年持有期混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于核准兴银兴慧一年持有期混合型证券投资基金注册的批复》(证监可〔2021〕2868号文)的核准,由兴银基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法规和《兴银兴慧一年持有期混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2021年10月26日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。首次设立募集规模为2,067,152,784.91份基金份额。本基金的基金管理人为兴证全球基金管理有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司(以下简称“兴业银行”)。

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《兴银兴慧一年持有期混合型证券投资基金基金合同》等法律文件约定,本基金的投资范围为具

有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会核准发行或注册并上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、金融债、公司债、企业债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金对股票及存托凭证的投资比例占基金资产的 0-40%，本基金投资于同业存单的比例不高于基金资产的 20%；每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的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；国债期货、股指期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×30%+中债综合指数收益率×70%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金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和《资产管理产品相关会计处理规定》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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》及附注 7.4.2 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 2022 年 12 月 31 日的财务状况、2022 年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

除下文 7.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资等。

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

##### (b) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b) 后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

- 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限(包括考虑续约选择权)。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内(若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期)可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持

的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似金融工具的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产款在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损

益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费【和销售服务费】在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产款在资金实际占用期间按实际利率法逐日确认为利息支出。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

基金收益分配原则为：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准。若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。A 类基金份额和 C 类基金份额之间由于收取费用的不同，将导致在可供分配利润上有所不同；同一类别每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配的有关业务规则进行调整，并及时公告。法律法规或监管机构另有规定的，基金管理人在履行适当程序后，将对上述基金收益分配政策进行调整。

#### 7.4.4.12 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。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、

回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

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

###### (a) 新金融工具准则

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

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

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

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

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

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

###### (i) 金融工具的分类影响

以摊余成本计量的金融资产：

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收利息，对应的账面价值分别为人民币 25,313,801.78 元、33,695,642.61 元、85,306.55 元、80,000,000.00 元、14,002,228.04 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金和买入返售金融资产，对应的账面价值分别为人民币 25,315,702.68 元、33,712,321.91 元、85,348.79 元和 80,008,841.10 元。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币 2,003,782,319.48 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币 2,017,757,083.98 元。

以摊余成本计量的金融负债：

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为应付交易费用、其他负债，对应的账面价值分别为人民币 534,062.48 元、195,600.00 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为其他负债，对应的账面价值分别为人民币 729,662.48 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等对应的应计利息余额均列示在应收利息或应付利息科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则，将上述应计利息分别转入银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等科目项下列示，无期初留存收益影响。

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

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

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策

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

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

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

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

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

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

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

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得, 由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起, 对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额: 持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的, 暂减按 50% 计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股, 解禁后取得的股息、红利收入, 按照上述规定计算纳税, 持股时间自解禁日起计算; 解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入

个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，其股息红利所得暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。

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

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	9,471,913.73	25,313,801.78
等于：本金	9,459,286.27	25,313,801.78
加：应计利息	12,627.46	-
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	9,471,913.73	25,313,801.78

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	300,615,336.99	-	303,548,579.08	2,933,242.09
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	202,506,788.13	1,888,016.92	203,979,062.42	-415,742.63
交易所市场				

	银行间市场	334,947,939.79	1,890,895.06	337,450,895.06	612,060.21
	合计	537,454,727.92	3,778,911.98	541,429,957.48	196,317.58
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		838,070,064.91	3,778,911.98	844,978,536.56	3,129,559.67
项目		上年度末 2021 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		296,935,801.20	-	322,762,337.78	25,826,536.58
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	461,936,215.75	-	462,437,981.70	501,765.95
	银行间市场	1,216,188,310.00	-	1,218,582,000.00	2,393,690.00
	合计	1,678,124,525.75	-	1,681,019,981.70	2,895,455.95
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,975,060,326.95	-	2,003,782,319.48	28,721,992.53

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	359,898,945.02	-
银行间市场	-	-
合计	359,898,945.02	-
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	80,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	80,000,000.00	-

##### 7.4.7.4.2 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通过买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	14,002,228.04
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	14,002,228.04

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	198.46	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	181,213.52	534,062.48
其中：交易所市场	176,278.52	529,374.98
银行间市场	4,725.00	4,687.50
银行汇划费	210.00	-
应付利息	-	-
预提费用-审计费	22,750.00	42,500.00
预提费用-信息披露费	270,000.00	150,000.00
预提费用-账户维护费	9,300	3,100.00
合计	483,461.98	729,662.48

#### 7.4.7.7 实收基金

##### 兴银兴慧一年持有混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,336,510,049.38	1,336,510,049.38
本期申购	15,638,348.09	15,638,348.09
本期赎回（以“-”号填列）	-543,717,930.60	-543,717,930.60
本期末	808,430,466.87	808,430,466.87

##### 兴银兴慧一年持有混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	761,211,809.37	761,211,809.37
本期申购	14,805,575.01	14,805,575.01
本期赎回 (以“-”号填列)	-319,430,136.43	-319,430,136.43
本期末	456,587,247.95	456,587,247.95

注：本期申购含红利再投、转换入份(金)额，本期赎回含转换出份(金)额。

#### 7.4.7.8 未分配利润

##### 兴银兴慧一年持有混合 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
本期期初	9,112,315.23	18,466,636.20	27,578,951.43
本期利润	-3,289,425.53	-16,117,917.00	-19,407,342.53
本期基金份额交易产生的变动数	-1,181,631.93	-2,073,828.59	-3,255,460.52
其中：基金申购款	119,039.11	93,306.45	212,345.56
基金赎回款	-1,300,671.04	-2,167,135.04	-3,467,806.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,641,257.77	274,890.61	4,916,148.38

##### 兴银兴慧一年持有混合 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
本期期初	5,051,183.61	10,516,688.37	15,567,871.98
本期利润	-2,664,334.52	-9,474,515.86	-12,138,850.38
本期基金份额交易产生的变动数	-307,602.20	-886,312.65	-1,193,914.85
其中：基金申购款	103,003.79	79,649.91	182,653.70
基金赎回款	-410,605.99	-965,962.56	-1,376,568.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,079,246.89	155,859.86	2,235,106.75

## 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 10 月 26 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	207,191.35	78,660.62
定期存款利息收入	123,500.00	342,222.22
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	484,025.65	69,661.79
其他	2,924.92	162.27
合计	817,641.92	490,706.90

注：其他存款利息收入为交易保证金利息收入。

## 7.4.7.10 股票投资收益

## 7.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 10 月 26 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	738,788,537.07	220,794,542.49
减：卖出股票成本总额	767,964,913.51	209,553,379.18
减：交易费用	2,032,158.21	-
买卖股票差价收入	-31,208,534.65	11,241,163.31

## 7.4.7.10.2 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金在本报告期内无股票投资证券出借差价收入。

## 7.4.7.11 债券投资收益

## 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 10 月 26 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	35,132,879.46	-
债券投资收益——买卖债券 （债转股及债券到期兑付）差 价收入	3,370,866.34	55,841.78
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	38,503,745.80	55,841.78
----	---------------	-----------

注：交易性金融资产为债券投资的，其按票面利率计算的利息在“本期财务报表”投资收益“项目列报和披露，在上年度可比期间财务报表”利息收入“项目列报和披露。

#### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 10 月 26 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期 兑付）成交总额	1,942,083,252.40	692,088.98
减：卖出债券（债转股及债券 到期兑付）成本总额	1,918,991,676.10	635,624.98
减：应计利息总额	19,711,229.93	622.22
减：交易费用	9,480.03	-
买卖债券差价收入	3,370,866.34	55,841.78

#### 7.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

#### 7.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.13 贵金属投资收益

##### 7.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.13.2 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 7.4.7.13.3 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

**7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

**7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

**7.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 10 月 26 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	4,934,765.48	-
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	4,934,765.48	-

**7.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 10 月 26 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-25,592,432.86	28,721,992.53
——股票投资	-22,893,294.49	25,826,536.58
——债券投资	-2,699,138.37	2,895,455.95
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——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	-25,592,432.86	28,721,992.53

**7.4.7.17 其他收入**

注：本基金在本报告期内无其他收入。

**7.4.7.18 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 10 月 26 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
审计费用	45,500.00	42,500.00
信息披露费	120,000.00	150,000.00
证券出借违约金	-	-
上交所查询费	1,200.00	-
银行汇划费	2,670.00	1,400.00
账户维护费	36,000.00	3,100.00
交易费用	-	830,066.16
合计	205,370.00	1,027,066.16

注：上期可比期间利润表中“交易费用”合并填列在“其他费用”项目中。

#### 7.4.7.19 分部报告

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

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

##### 7.4.9.1 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。

##### 7.4.9.2 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
国脉科技股份有限公司	基金管理人的股东
华福证券有限责任公司(以下简称“华福证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
上海兴瀚资产管理有限公司(以下简称“上海兴瀚”)	基金管理人的全资子公司
兴银基金管理有限责任公司(以下简称“兴银基金”)	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司(以下简称“兴业银行”)	基金托管人、基金销售机构

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 10 月 26 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华福证券	86,371,770.76	5.88%	372,644,356.26	51.48%

## 7.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

## 7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 10 月 26 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
华福证券	-	-	292,998,567.14	63.25%

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

## 7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 10 月 26 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
华福证券	566,000,000.00	0.82%	7,330,200,000.00	60.70%

## 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华福证券	63,161.82	5.88%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2021 年 10 月 26 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月			

	31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华福证券	272,516.11	51.48%	272,516.11	51.48%

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用华福证券证券交易专用交易单元 进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还从华福证券获得证券研究综合服务。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 10 月 26 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	20,126,307.57	3,778,240.66
其中：支付销售机构的客户维护费	10,030,963.64	1,911,490.83

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 10 月 26 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,025,261.41	755,648.13

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末。

##### 7.4.10.2.3 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 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴银兴慧一年持有混合 A	兴银兴慧一年持有混合 C	合计
兴业银行	-	569,892.96	569,892.96
华福证券	-	157,149.35	157,149.35
合计	-	727,042.31	727,042.31
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 10 月 26 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴银兴慧一年持有混合 A	兴银兴慧一年持有混合 C	合计
华福证券	-	30,904.84	30,904.84
兴业银行	-	103,469.46	103,469.46
合计	-	134,374.30	134,374.30

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 0.10%。销售服务费计提的计算公式如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间与关联方未进行银行间同业市场债券（含回购）的交易。

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

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间内均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间内均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

##### 兴银兴慧一年持有混合 A

份额单位：份

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 10 月 26 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

基金合同生效日（2021 年 10 月 26 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	99,259.68	-
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	99,259.68	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.01%	-

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

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。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 10 月 26 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	9,471,913.73	207,191.35	25,313,801.78	420,882.84

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况——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。

#### 7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名	成功认购日	受限期	流通受	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

	称			限类型						
688353	华盛锂电	2022年07月06日	6个月	科创板新股锁定	98.35	63.86	4,358	428,609.30	278,301.88	-
688401	路维光电	2022年08月10日	6个月	科创板新股锁定	25.08	41.55	4,947	124,070.76	205,547.85	-
688132	邦彦技术股份	2022年09月16日	6个月	科创板新股锁定	28.88	22.80	4,844	139,894.72	110,443.20	-
301267	华夏眼科	2022年10月26日	6个月	创业板新股锁定	50.88	66.20	1,006	51,185.28	66,597.20	-
301095	广立微	2022年07月28日	6个月	创业板新股锁定	58.00	86.49	740	42,920.00	64,002.60	-
301308	江波龙	2022年07月27日	6个月	创业板新股锁	55.67	56.72	819	45,593.73	46,453.68	-

				定						
301327	华宝新能	2022年09月08日	6个月	创业板新股锁定	237.50	176.97	242	57,475.00	42,826.74	-
301239	普瑞眼科	2022年06月22日	6个月	创业板新股锁定	33.65	69.68	575	19,348.75	40,066.00	-
301367	怡和嘉业	2022年10月21日	6个月	创业板新股锁定	119.88	175.78	223	26,733.24	39,198.94	-
301165	锐捷网络	2022年11月14日	6个月	创业板新股锁定	32.38	31.61	1,077	34,873.26	34,043.97	-
301356	天振股份	2022年11月03日	6个月	创业板新股锁定	63.00	43.33	614	38,682.00	26,604.62	-
301389	隆扬电子	2022年10月18日	6个月	创业板新股锁定	22.50	17.16	1,269	28,552.50	21,776.04	-
301330	熵	2022	6个月	创	43.32	31.31	694	30,064.08	21,729.14	-

	基 科 技	年 08 月 10 日		业 板 新 股 锁 定						
301152	天 力 锂 能	2022 年 08 月 19 日	6 个月	创 业 板 新 股 锁 定	57.00	46.64	433	24,681.00	20,195.12	-
301391	卡 莱 特	2022 年 11 月 24 日	6 个月	创 业 板 新 股 锁 定	96.00	80.97	247	23,712.00	19,999.59	-
301171	易 点 天 下	2022 年 08 月 10 日	6 个月	创 业 板 新 股 锁 定	18.18	17.72	985	17,907.30	17,454.20	-
301363	美 好 医 疗	2022 年 09 月 28 日	6 个月	创 业 板 新 股 锁 定	30.66	37.85	445	13,643.70	16,843.25	-
301115	建 科 股 份	2022 年 08 月 23 日	6 个月	创 业 板 新 股 锁 定	42.05	24.04	685	28,804.25	16,467.40	-
301223	中 荣 股	2022 年 10 月 13	6 个月	创 业 板	26.28	18.13	815	21,418.20	14,775.95	-

	份	日		新股 锁定						
301121	紫 建 电 子	2022 年 08 月 01 日	6 个月	创 业 板 新 股 锁 定	61.07	49.77	290	17,710.30	14,433.30	-
301139	元 道 通 信	2022 年 06 月 30 日	6 个月	创 业 板 新 股 锁 定	38.46	25.31	566	21,768.36	14,325.46	-
301339	通 行 宝	2022 年 09 月 02 日	6 个月	创 业 板 新 股 锁 定	18.78	15.59	913	17,146.14	14,233.67	-
301335	天 元 宠 物	2022 年 11 月 11 日	6 个月	创 业 板 新 股 锁 定	49.98	33.82	420	20,991.60	14,204.40	-
301377	鼎 泰 高 科	2022 年 11 月 11 日	6 个月	创 业 板 新 股 锁 定	22.88	17.63	770	17,617.60	13,575.10	-
301311	昆 船 智 能	2022 年 11 月 23 日	6 个月	创 业 板 新 股	13.88	15.86	832	11,548.16	13,195.52	-

				锁定						
301230	泓博医药	2022年10月21日	6个月	创业板新股锁定	40.00	48.32	269	10,760.00	12,998.08	-
301338	凯格精机	2022年08月08日	6个月	创业板新股锁定	46.33	48.99	257	11,906.81	12,590.43	-
301280	珠城科技	2022年12月19日	6个月	创业板新股锁定	67.40	44.80	279	18,804.60	12,499.20	-
301365	矩阵股份	2022年11月14日	6个月	创业板新股锁定	34.72	23.87	516	17,915.52	12,316.92	-
301290	东星医疗	2022年11月23日	6个月	创业板新股锁定	44.09	35.13	330	14,549.70	11,592.90	-
301132	满坤科技	2022年08月03日	6个月	创业板新股锁定	26.80	24.48	468	12,542.40	11,456.64	-

301277	新天地	2022年11月09日	6个月	创业板新股锁定	27.00	25.78	439	11,853.00	11,317.42	-
301379	天山电子	2022年10月19日	6个月	创业板新股锁定	31.51	24.63	449	14,147.99	11,058.87	-
301282	金禄电子	2022年08月18日	6个月	创业板新股锁定	30.38	25.25	434	13,184.92	10,958.50	-
301306	西测测试	2022年07月19日	6个月	创业板新股锁定	43.23	42.29	255	11,023.65	10,783.95	-
301273	瑞晨环保	2022年10月11日	6个月	创业板新股锁定	37.89	37.79	277	10,495.53	10,467.83	-
301265	华新环保	2022年12月08日	6个月	创业板新股锁定	13.28	11.40	819	10,876.32	9,336.60	-
301176	逸豪	2022年09	6个月	创业	23.88	16.89	544	12,990.72	9,188.16	-

	新材	月 21 日		板新股锁定						
301318	维海德	2022 年 08 月 03 日	6 个月	创业板新股锁定	64.68	41.74	206	13,324.08	8,598.44	-
301227	森鹰窗业	2022 年 09 月 16 日	6 个月	创业板新股锁定	38.25	29.49	284	10,863.00	8,375.16	-
301326	捷邦科技	2022 年 09 月 09 日	6 个月	创业板新股锁定	51.72	36.62	227	11,740.44	8,312.74	-
301197	工大科雅	2022 年 07 月 29 日	6 个月	创业板新股锁定	25.50	20.08	380	9,690.00	7,630.40	-
301161	唯万密封	2022 年 09 月 06 日	6 个月	创业板新股锁定	18.66	21.73	346	6,456.36	7,518.58	-
301398	星源卓镁	2022 年 12 月 08 日	6 个月	创业板新	34.40	28.94	255	8,772.00	7,379.70	-

				股 锁 定						
301313	凡拓数创	2022 年 09 月 22 日	6 个月	创 业 板 新 股 锁 定	25.25	29.14	247	6,236.75	7,197.58	-
301285	鸿日达	2022 年 09 月 21 日	6 个月	创 业 板 新 股 锁 定	14.60	12.60	565	8,249.00	7,119.00	-
301359	东南电子	2022 年 11 月 02 日	6 个月	创 业 板 新 股 锁 定	20.84	19.90	328	6,835.52	6,527.20	-
301388	欣灵电气	2022 年 10 月 26 日	6 个月	创 业 板 新 股 锁 定	25.88	21.60	292	7,556.96	6,307.20	-
301368	丰立智能	2022 年 12 月 07 日	6 个月	创 业 板 新 股 锁 定	22.33	18.52	337	7,525.21	6,241.24	-
301319	唯特偶	2022 年 09 月 22 日	6 个月	创 业 板 新 股 锁 定	47.75	53.27	115	5,491.25	6,126.05	-

301270	汉仪股份	2022年08月19日	6个月	定创业板新股锁定	25.68	28.37	210	5,392.80	5,957.70	-
301309	万得凯	2022年09月08日	6个月	定创业板新股锁定	39.00	24.46	228	8,892.00	5,576.88	-
301233	盛帮股份	2022年06月24日	6个月	定创业板新股锁定	41.52	34.30	158	6,560.16	5,419.40	-
301316	慧博云通	2022年09月29日	6个月	定创业板新股锁定	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88	-

## 7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113664	大元转债	2022年12月06日	1个月	新债未上市	100.00	100.02	810.00	81,000.00	81,019.17	-

## 7.4.12.2 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的股票。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购。

### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

### 7.4.13.2 信用风险

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

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

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有除国债、政策性金融债、央行票据和地方政府债以外的需按短期信通评级列示的债券投资。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

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。

**7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	397,480,000.00
合计	-	397,480,000.00

注：本基金本报告期末未持有需按短期信用评级列示的同业存单投资。

**7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	75,440,062.53	7,167,690.30
AAA 以下	26,510,580.15	51,800.00
未评级	-	-
合计	101,950,642.68	7,219,490.30

注：以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债、央行票据及地方政府债等。

**7.4.13.2.5 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。

**7.4.13.2.6 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。

**7.4.13.3 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，有效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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

#### 7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持大部分证券为依法上市的股票、债券等资产，本报告期末本基金持有的资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 20 22 年	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
------------------------------	------------	-----------	--------------	-------	-------	-----	----

12月31日							
资产							
银行存款	9,471,913.73	-	-	-	-	-	9,471,913.73
结算备付金	62,547,836.75	-	-	-	-	-	62,547,836.75
存出保证金	140,246.02	-	-	-	-	-	140,246.02
交易性金融资产	51,010,479.45	-	370,789,376.27	91,876,426.85	27,753,674.91	303,548,579.08	844,978,536.56
买入返售金融资产	359,898,945.02	-	-	-	-	-	359,898,945.02
应收清算款	-	-	-	-	-	6,262,220.71	6,262,220.71
应收申购	-	-	-	-	-	33.97	33.97

款							
资产总计	483,069,420.97	-	370,789,376.27	91,876,426.85	27,753,674.91	309,810,833.76	1,283,299,732.76
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	5,436,202.52	5,436,202.52
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,817,050.16	3,817,050.16
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,127,569.10	1,127,569.10
应付托管费	-	-	-	-	-	225,513.84	225,513.84
应付销售服务费	-	-	-	-	-	40,839.53	40,839.53
应交税费	-	-	-	-	-	125.68	125.68
其他负债	-	-	-	-	-	483,461.98	483,461.98

负债总计	-	-	-	-	-	11,130,762.81	11,130,762.81
利率敏感度缺口	483,069,420.97	-	370,789,376.27	91,876,426.85	27,753,674.91	298,680,070.95	1,272,168,969.95
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	25,313,801.78	-	-	-	-	-	25,313,801.78
结算备付金	33,695,642.61	-	-	-	-	-	33,695,642.61
存出保证金	85,306.55	-	-	-	-	-	85,306.55
交易性金融资产	4,400,880.00	397,480,000.00	381,420,820.50	894,776,559.40	2,941,721.80	322,762,337.78	2,003,782,319.48

产							
买入返售金融资产	80,000,000.00	-	-	-	-	-	80,000,000.00
其他资产	-	-	-	-	-	14,002,228.04	14,002,228.04
应收申购款	-	-	-	-	-	1,963,718.86	1,963,718.86
资产总计	143,495,630.94	397,480,000.00	381,420,820.50	894,776,559.40	2,941,721.80	338,728,284.68	2,158,843,017.32
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	15,037,896.28	15,037,896.28
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,785,659.71	1,785,659.71
应付托管费	-	-	-	-	-	357,131.93	357,131.93
应	-	-	-	-	-	63,973.60	63,973.60

付销售服务费							
应交税费	-	-	-	-	-	11.16	11.16
其他负债	-	-	-	-	-	729,662.48	729,662.48
负债总计	-	-	-	-	-	17,974,335.16	17,974,335.16
利率敏感度缺口	143,495,630.94	397,480,000.00	381,420,820.50	894,776,559.40	2,941,721.80	320,753,949.52	2,140,868,682.16

#### 7.4.13.4.1.2 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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	-1,795,321.89	-4,279,781.94
	市场利率下降 25 个基点	1,819,317.50	4,303,797.42

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	303,548,579.08	23.86	322,762,337.78	15.08
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	541,429,957.48	42.56	1,681,019,981.70	78.52
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	844,978,536.56	66.42	2,003,782,319.48	93.60

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除下述市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上涨 5%	15,883,924.28	10,197,746.59
	沪深 300 指数下跌 5%	-15,883,924.28	-10,197,746.59

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	344,267,708.10	328,293,204.76
第二层次	499,267,539.99	1,675,489,114.72
第三层次	1,443,288.47	-
合计	844,978,536.56	2,003,782,319.48

## 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

## 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

## 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	3,676,413.78	3,676,413.78
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	2,530,910.60	2,530,910.60
当期利得或损失总额	-	297,785.29	297,785.29
其中：计入损益的利得或损失	-	297,785.29	297,785.29
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,443,288.47	1,443,288.47
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-159,027.85	-159,027.85

## 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系

股票投资	1,443,288.47	平均价格 亚式期权 模型	预期波动率	0.2063- 2.4756	负相关
------	--------------	--------------------	-------	-------------------	-----

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

#### 7.4.14.4 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和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2022 年 12 月 31 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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	303,548,579.08	23.65
	其中：股票	303,548,579.08	23.65
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	541,429,957.48	42.19
	其中：债券	541,429,957.48	42.19
	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	359,898,945.02	28.04
	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	72,019,750.48	5.61
8	其他各项资产	6,402,500.70	0.50
9	合计	1,283,299,732.76	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
----	------	---------	--------------

A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,276,876.00	0.10
C	制造业	207,608,072.18	16.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	23,312,007.60	1.83
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	33,263,204.69	2.61
J	金融业	37,804,245.00	2.97
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	54,639.35	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	110,026.26	0.01
R	文化、体育和娱乐业	119,508.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	303,548,579.08	23.86

### 8.2.2 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。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002705	新宝股份	912,186	15,187,896.90	1.19
2	002120	韵达股份	1,029,200	14,799,896.00	1.16
3	600131	国网信通	985,500	14,743,080.00	1.16
4	600690	海尔智家	597,100	14,605,066.00	1.15
5	603345	安井食品	89,666	14,515,132.08	1.14
6	601456	国联证券	1,215,900	13,678,875.00	1.08
7	688257	新锐股份	312,695	12,220,120.60	0.96
8	000951	中国重汽	791,300	11,742,892.00	0.92
9	600885	宏发股份	299,960	10,021,663.60	0.79
10	600030	中信证券	461,700	9,192,447.00	0.72
11	300034	钢研高纳	200,000	9,168,000.00	0.72
12	000999	华润三九	191,300	8,954,753.00	0.70
13	000729	燕京啤酒	841,700	8,938,854.00	0.70

14	002101	广东鸿图	409,000	8,863,030.00	0.70
15	300596	利安隆	158,300	8,638,431.00	0.68
16	688066	航天宏图	88,771	7,589,920.50	0.60
17	000776	广发证券	466,800	7,230,732.00	0.57
18	603195	公牛集团	46,800	6,704,568.00	0.53
19	601233	桐昆股份	435,300	6,290,085.00	0.49
20	002991	甘源食品	82,200	6,271,038.00	0.49
21	688239	航宇科技	71,516	5,556,078.04	0.44
22	688030	山石网科	270,445	5,262,859.70	0.41
23	300033	同花顺	46,900	4,624,809.00	0.36
24	605376	博迁新材	98,800	4,587,284.00	0.36
25	300253	卫宁健康	426,400	4,383,392.00	0.34
26	600456	宝钛股份	104,000	4,249,440.00	0.33
27	603786	科博达	62,700	4,127,541.00	0.32
28	002064	华峰化学	582,000	3,957,600.00	0.31
29	000860	顺鑫农业	132,000	3,936,240.00	0.31
30	600399	抚顺特钢	267,000	3,820,770.00	0.30
31	603885	吉祥航空	234,500	3,794,210.00	0.30
32	002352	顺丰控股	62,210	3,593,249.60	0.28
33	000768	中航西飞	132,400	3,369,580.00	0.26
34	603027	千禾味业	157,100	3,264,538.00	0.26
35	601658	邮储银行	666,100	3,077,382.00	0.24
36	000333	美的集团	55,500	2,874,900.00	0.23
37	300811	铂科新材	32,600	2,818,922.00	0.22
38	600893	航发动力	63,500	2,684,780.00	0.21
39	600285	羚锐制药	170,900	2,228,536.00	0.18
40	000921	海信家电	148,600	1,957,062.00	0.15
41	003006	百亚股份	127,300	1,758,013.00	0.14
42	002149	西部材料	88,000	1,446,720.00	0.11
43	600219	南山铝业	439,800	1,438,146.00	0.11
44	601799	星宇股份	10,200	1,299,174.00	0.10
45	600938	中国海油	84,005	1,276,876.00	0.10
46	603997	继峰股份	82,700	1,263,656.00	0.10
47	600933	爱柯迪	68,400	1,245,564.00	0.10
48	000338	潍柴动力	119,700	1,218,546.00	0.10
49	300454	深信服	10,200	1,148,010.00	0.09
50	603043	广州酒家	44,200	1,141,244.00	0.09
51	600428	中远海特	188,700	1,124,652.00	0.09
52	600876	洛阳玻璃	40,800	817,632.00	0.06
53	300408	三环集团	26,600	816,886.00	0.06
54	002138	顺络电子	28,300	740,894.00	0.06
55	603237	五芳斋	11,500	542,225.00	0.04
56	688475	萤石网络	20,526	532,239.18	0.04

57	600346	恒力石化	26,900	417,757.00	0.03
58	688353	华盛锂电	4,358	278,301.88	0.02
59	688401	路维光电	4,947	205,547.85	0.02
60	300251	光线传媒	13,800	119,508.00	0.01
61	688132	邦彦技术	4,844	110,443.20	0.01
62	688525	佰维存储	4,614	74,100.84	0.01
63	301267	华夏眼科	1,052	69,960.26	0.01
64	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.01
65	301095	广立微	740	64,002.60	0.01
66	603757	大元泵业	2,800	54,012.00	0.00
67	301308	江波龙	819	46,453.68	0.00
68	301327	华宝新能	242	42,826.74	0.00
69	301367	怡和嘉业	229	40,516.36	0.00
70	301239	普瑞眼科	575	40,066.00	0.00
71	301165	锐捷网络	1,077	34,043.97	0.00
72	301356	天振股份	632	27,420.38	0.00
73	301391	卡莱特	270	21,966.09	0.00
74	301389	隆扬电子	1,269	21,776.04	0.00
75	301330	熵基科技	694	21,729.14	0.00
76	301152	天力锂能	433	20,195.12	0.00
77	301171	易点天下	985	17,454.20	0.00
78	301363	美好医疗	445	16,843.25	0.00
79	301335	天元宠物	492	16,756.08	0.00
80	301115	建科股份	685	16,467.40	0.00
81	301338	凯格精机	332	16,412.43	0.00
82	301223	中荣股份	815	14,775.95	0.00
83	301311	昆船智能	920	14,755.76	0.00
84	301121	紫建电子	290	14,433.30	0.00
85	301139	元道通信	566	14,325.46	0.00
86	301339	通行宝	913	14,233.67	0.00
87	301230	泓博医药	287	13,959.64	0.00
88	301290	东星医疗	391	13,876.13	0.00
89	301377	鼎泰高科	770	13,575.10	0.00
90	301365	矩阵股份	560	13,428.36	0.00
91	301277	新天地	484	12,616.57	0.00
92	301280	珠城科技	279	12,499.20	0.00
93	301112	信邦智能	399	12,404.91	0.00
94	301132	满坤科技	468	11,456.64	0.00
95	301379	天山电子	449	11,058.87	0.00
96	301282	金禄电子	434	10,958.50	0.00
97	301306	西测测试	255	10,783.95	0.00
98	301273	瑞晨环保	277	10,467.83	0.00
99	301265	华新环保	819	9,336.60	0.00

100	301176	逸豪新材	544	9,188.16	0.00
101	301318	维海德	206	8,598.44	0.00
102	301227	森鹰窗业	284	8,375.16	0.00
103	301326	捷邦科技	227	8,312.74	0.00
104	301197	工大科雅	380	7,630.40	0.00
105	301161	唯万密封	346	7,518.58	0.00
106	301359	东南电子	371	7,474.06	0.00
107	301398	星源卓镁	255	7,379.70	0.00
108	301313	凡拓数创	247	7,197.58	0.00
109	301285	鸿日达	565	7,119.00	0.00
110	301388	欣灵电气	320	6,962.40	0.00
111	301368	丰立智能	337	6,241.24	0.00
112	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
113	301270	汉仪股份	210	5,957.70	0.00
114	301309	万得凯	228	5,576.88	0.00
115	301233	盛帮股份	158	5,419.40	0.00
116	301316	慧博云通	359	5,140.88	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002705	新宝股份	33,490,142.68	1.56
2	600131	国网信通	27,509,554.97	1.28
3	000729	燕京啤酒	24,179,811.00	1.13
4	605338	巴比食品	23,936,531.00	1.12
5	000951	中国重汽	22,459,026.00	1.05
6	600690	海尔智家	21,751,048.00	1.02
7	600030	中信证券	20,914,747.70	0.98
8	002120	韵达股份	20,407,625.00	0.95
9	000776	广发证券	19,129,174.71	0.89
10	002987	京北方	18,037,943.70	0.84
11	002064	华峰化学	15,855,589.52	0.74
12	603345	安井食品	15,525,621.89	0.73
13	601799	星宇股份	15,138,185.00	0.71
14	002078	太阳纸业	15,071,765.12	0.70
15	601456	国联证券	14,617,020.27	0.68
16	000768	中航西飞	14,365,236.00	0.67
17	002101	广东鸿图	13,151,413.00	0.61
18	000002	万科 A	12,710,563.00	0.59
19	601658	邮储银行	12,668,063.00	0.59
20	600885	宏发股份	12,531,796.00	0.59

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600233	圆通速递	40,329,617.42	1.88
2	601985	中国核电	32,362,132.97	1.51
3	000999	华润三九	25,359,829.20	1.18
4	600131	国网信通	23,031,246.00	1.08
5	002705	新宝股份	22,300,009.00	1.04
6	000729	燕京啤酒	21,746,556.00	1.02
7	002557	洽洽食品	21,617,787.00	1.01
8	605338	巴比食品	20,555,269.00	0.96
9	002032	苏泊尔	19,666,651.07	0.92
10	603885	吉祥航空	18,356,298.40	0.86
11	000768	中航西飞	18,154,226.80	0.85
12	000776	广发证券	16,325,815.00	0.76
13	002078	太阳纸业	14,743,674.00	0.69
14	002987	京北方	14,398,216.46	0.67
15	601658	邮储银行	13,976,960.00	0.65
16	002352	顺丰控股	13,552,724.00	0.63
17	000951	中国重汽	13,265,102.20	0.62
18	600085	同仁堂	12,325,179.00	0.58
19	002101	广东鸿图	12,298,670.00	0.57
20	601799	星宇股份	12,076,530.00	0.56

## 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	771,644,449.30
卖出股票收入（成交）总额	738,788,537.07

## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	139,274,428.94	10.95
2	央行票据	-	-
3	金融债券	359,912,091.88	28.29
	其中：政策性金融债	300,204,885.86	23.60
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)	42,243,436.66	3.32

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	541,429,957.48	42.56

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	210322	21 进出 22	2,700,000	272,594,293.15	21.43
2	019663	21 国债 15	700,000	70,584,490.41	5.55
3	019666	22 国债 01	500,000	51,010,479.45	4.01
4	2228050	22 光大银行	400,000	39,786,080.00	3.13
5	018008	国开 1802	218,830	22,461,196.82	1.77

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

## 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风

险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国进出口银行、中国光大银行股份有限公司、国家开发银行、南京银行股份有限公司、重庆银行股份有限公司、杭州联合农村商业银行股份有限公司在编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚。本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。

除上述主体外，本基金投资的前十名证券发行主体未出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

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

本基金不存在前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情形。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	140,246.02
2	应收清算款	6,262,220.71
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	33.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,402,500.70

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	127022	恒逸转债	11,172,134.09	0.88
2	113056	重银转债	9,993,196.66	0.79
3	110082	宏发转债	9,719,137.85	0.76

4	110059	浦发转债	3,062,882.71	0.24
5	128136	立讯转债	2,990,644.41	0.24
6	113043	财通转债	2,676,777.14	0.21
7	113633	科沃转债	1,372,480.88	0.11
8	128035	大族转债	1,017,427.46	0.08
9	123099	普利转债	157,736.29	0.01

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### § 9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
兴银兴慧一年持有混合 A	8,598	94,025.41	6,619,282.27	0.82%	801,811,184.60	99.18%
兴银兴慧一年持有混合 C	4,602	99,214.96	3,000,844.45	0.66%	453,586,403.50	99.34%
合计	13,200	95,834.68	9,620,126.72	0.76%	1,255,397,588.10	99.24%

#### 9.2 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	兴银兴慧一年持有混合 A	9,938.86	0.00%
	兴银兴慧一年持有混合 C	50,029.99	0.01%
	合计	59,968.85	0.00%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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	兴银兴慧一年持有混合 A	0
	兴银兴慧一年持有混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	兴银兴慧一年持有混合 A	0
	兴银兴慧一年持有混合 C	0
	合计	0

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

注：无。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	兴银兴慧一年持有混合 A	兴银兴慧一年持有混合 C
基金合同生效日（2021 年 10 月 26 日）基金份额总额	1,329,138,168.95	738,014,615.96
本报告期期初基金份额总额	1,336,510,049.38	761,211,809.37
本报告期基金总申购份额	15,638,348.09	14,805,575.01
减：本报告期基金总赎回份额	543,717,930.60	319,430,136.43
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	808,430,466.87	456,587,247.95

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

## 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

(2) 2022 年 2 月 28 日，沈阳女士担任基金管理人副总经理。

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

(4) 报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

## 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自合同生效日（2021 年 10 月 26 日）起聘请毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。本报告期内本基金应付审计费 45500.00 元。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内，基金管理人及其相关高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内，本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东吴证券	2	343,958,940.72	23.40%	251,538.53	23.40%	-
天风证	2	292,025,790.13	19.87%	213,557.61	19.87%	-

券						
东北证 券	2	231,387,606.19	15.74%	169,214.47	15.74%	-
兴业证 券	1	176,471,140.37	12.01%	129,050.75	12.01%	-
中金公 司	2	112,885,272.60	7.68%	82,552.97	7.68%	-
华福证 券	3	86,371,770.76	5.88%	63,161.82	5.88%	-
长江证 券	1	85,711,710.57	5.83%	62,682.80	5.83%	-
粤开证 券	1	66,580,793.00	4.53%	48,691.76	4.53%	-
方正证 券	2	58,066,492.85	3.95%	42,467.93	3.95%	-
东方财 富证券	2	16,304,356.69	1.11%	11,923.00	1.11%	-
东方证 券	2	-	-	-	-	-
东吴证 券	2	-	-	-	-	-
东兴证 券	2	-	-	-	-	-
广发证 券	2	-	-	-	-	-
国盛证 券	2	-	-	-	-	-
海通证 券	2	-	-	-	-	-
国泰君 安证券	2	-	-	-	-	-
华安证 券	3	-	-	-	-	-
华宝证 券	2	-	-	-	-	-
平安证 券	2	-	-	-	-	-
招商证 券	1	-	-	-	-	-
中泰证 券	2	-	-	-	-	-
中投证 券	2	-	-	-	-	-

中信建投证券	1	-	-	-	-	-
--------	---	---	---	---	---	---

注：基金租用证券公司交易单元的选择标准是：

- (1) 内部管理规范、严谨；具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (2) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能够针对基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；
- (3) 能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动资源，协助基金投资；
- (4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。 选择程序：本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选证券公司的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的证券公司。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		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
东吴证券	35,196,677.60	8.47%	16,206,000,000.00	23.37%	-	-	-	-
天风证券	-	-	8,471,000,000.00	12.21%	-	-	-	-
东北证券	8,817,478.42	2.12%	-	-	-	-	-	-
兴业证券	182,764,360.19	43.99%	24,688,000,000.00	35.59%	-	-	-	-
中金公司	8,185,734.26	1.97%	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	566,000,000.00	0.82%	-	-	-	-
长江证券	21,217,292.02	5.11%	18,683,800,000.00	26.94%	-	-	-	-
粤开	1,493,211.13	0.36%	-	-	-	-	-	-

证券									
方正证券	17,318,827.60	4.17%	460,000,000.00	0.66%	-	-	-	-	-
东方财富证券	140,428,270.81	33.80%	284,000,000.00	0.41%	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于旗下基金参与联泰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	2022-01-12
2	兴银兴慧一年持有期混合型证	指定网站	2022-01-24

	券投资基金 2021 年第 4 季度报告		
3	兴银基金管理有限责任公司旗下部分基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报	2022-01-24
4	兴银基金管理有限责任公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、指定网站	2022-01-29
5	关于旗下基金参与中信建投费率优惠活动并开通定期定额投资的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、指定网站	2022-02-15
6	兴银基金管理有限责任公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、指定网站	2022-03-01
7	关于旗下基金在部分代销渠道开通转换、定期定额投资并参与费率优惠活动的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、指定网站	2022-03-31
8	兴银兴慧一年持有期混合型证券投资基金 2021 年年度报告	指定网站	2022-03-21
9	兴银基金管理有限责任公司旗下部分基金 2021 年年度报告提示性公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报	2022-03-21
10	兴银基金管理有限责任公司关于旗下全资子公司自有资金申购公司旗下基金的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报	2022-04-06
11	关于旗下部分基金在华福证券开通基金转换业务的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、指定网站	2022-04-22
12	兴银兴慧一年持有期混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	指定网站	2022-04-22
13	兴银基金管理有限责任公司旗下部分基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报	2022-04-22
14	关于旗下部分基金在安信证券开通转换、定期定额投资并参与费率优惠活动的公告	证券日报、上海证券报、证券时报、指定网站	2022-06-06
15	关于旗下部分基金在广发证券开通基金转换业务的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、指定网站	2022-06-13
16	关于旗下部分基金在兴业银行开通基金转换业务的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、指定网站	2022-06-13
17	兴银基金关于面向特定投资者通过直销柜台认、申购旗下所有基金实施费率优惠的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、指定网站	2022-07-02
18	关于旗下基金参与浦发银行费率优惠活动并开通定期定额投资的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、指定网站	2022-07-07

19	兴银兴慧一年持有期混合型证券投资基金 2022 年第 2 季度报告	指定网站	2022-07-21
20	兴银基金管理有限责任公司旗下部分基金 2022 年第 2 季度报告提示性公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报	2022-07-21
21	兴银基金管理有限责任公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、指定网站	2022-08-26
22	兴银兴慧一年持有期混合型证券投资基金 2022 年中期报告	指定网站	2022-08-31
23	兴银基金管理有限责任公司旗下部分基金 2022 年中期报告提示性公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报	2022-08-31
24	关于旗下基金参与创金启富费率优惠活动并开通定期定额投资的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、指定网站	2022-09-02
25	关于旗下部分基金在兴银基金直销柜台开通基金转换业务的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、指定网站	2022-09-17
26	关于旗下基金参与九州证券费率优惠活动并开通定期定额投资的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、指定网站	2022-09-19
27	兴银兴慧一年持有期混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2022 年第 1 号）、兴银兴慧一年持有期混合型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要（更新）、兴银兴慧一年持有期混合型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要（更新）	指定网站、中数平台	2022-09-28
28	关于旗下基金参与中国银河证券费率优惠活动并开通定期定额投资的公告	中国证券报、证券时报、证券日报、上海证券报、指定网站	2022-10-14
29	兴银兴慧一年持有期混合型证券投资基金 2022 年第 3 季度报告	指定网站	2022-10-26
30	兴银基金管理有限责任公司旗下部分基金 2022 年第 3 季度报告提示性公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报	2022-10-26

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

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

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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予兴银兴慧一年持有期混合型证券投资基金注册的文件
2. 《兴银兴慧一年持有期混合型证券投资基金基金合同》
3. 《兴银兴慧一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》
4. 《兴银兴慧一年持有期混合型证券投资基金托管协议》
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照
6. 报告期内在指定信息披露媒体上公开披露的各项公告

### 13.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处。

### 13.3 查阅方式

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

兴银基金管理有限责任公司

二〇二三年三月三十日