

兴银上证综合指数增强型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:兴银基金管理有限责任公司

基金托管人:兴业银行股份有限公司

报告送出日期:2026 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年08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2026年03月23日起至2026年06月30日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 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	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	66
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	68
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	68
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	68
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	68
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	68
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	68
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	68

7.12 投资组合报告附注	68
§ 8 基金份额持有人信息	69
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	70
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	70
§ 9 开放式基金份额变动	70
§ 10 重大事件揭示	70
10.1 基金份额持有人大会决议	71
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	71
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	71
10.4 基金投资策略的改变	71
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	71
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	71
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	71
10.8 其他重大事件	72
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	72
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	72
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	72
§ 12 备查文件目录	73
12.1 备查文件目录	73
12.2 存放地点	73
12.3 查阅方式	73

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴银上证综合指数增强型证券投资基金	
基金简称	兴银上证综合指数增强	
基金主代码	026823	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026 年 03 月 23 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	158,451,679.16 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	兴银上证综合指数增强 A	兴银上证综合指数增强 C
下属分级基金的交易代码	026823	026824
报告期末下属分级基金的份额总额	33,678,604.57 份	124,773,074.59 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型基金，在力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年化跟踪误差不超过 7.75%的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力求实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。	
投资策略	本基金为指数增强型基金，采取定量方法进行组合管理，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年化跟踪误差不超过 7.75%的基础上，追求获得超越业绩比较基准的回报。本基金主要投资于上证综合指数的成份股及备选成份股，为了获得超越业绩比较基准的投资回报，可以在被动跟踪指数的基础上进行一些优化调整，如在一定幅度内减少或增强成份股的权重、替换或者增加一些非成份股。	
业绩比较基准	上证综合指数收益率 $\times$ 95%+银行人民币活期存款基准利率（税后） $\times$ 5%	
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平理论上高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数增强型基金，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。	
	兴银上证综合指数增强 A	兴银上证综合指数增强 C
下属分级基金的风险收益特征	风险收益特征同上	风险收益特征同上

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		兴银基金管理有限责任公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张庄波	冯萌
	联系电话	86-21-20296383	021-52629999-213310
	电子邮箱	zhangzb@hffunds.cn	fengmeng@cib.com.cn
客户服务电话		40000-96326	95561
传真		86-21-68630069	021-62159217
注册地址		福建省泉州市丰泽区滨海街102号厦门银行泉州分行大厦19楼1908	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		易勇	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	中国证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.hffunds.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人和基金托管人办公场所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026年03月23日（基金合同生效日）-2026年06月30日）	
	兴银上证综合指数增强 A	兴银上证综合指数增强 C
本期已实现收益	821,355.40	3,427,510.42
本期利润	349,086.89	2,389,839.26
加权平均基金份额本期利润	0.0069	0.0115
本期加权平均净值利润率	0.68%	1.15%
本期基金份额净值增长率	-0.91%	-0.94%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	-307,977.05	-1,175,057.23
期末可供分配基金份额利润	-0.0091	-0.0094
期末基金资产净值	33,370,627.52	123,598,017.36
期末基金份额净值	0.9909	0.9906
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	-0.91%	-0.94%

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

兴银上证综合指数增强 A 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-1.32%	0.79%	4.96%	0.89%	-6.28%	-0.10%
自基金合同生效起至今	-0.91%	0.75%	3.32%	1.00%	-4.23%	-0.25%

兴银上证综合指数增强 C 净值表现

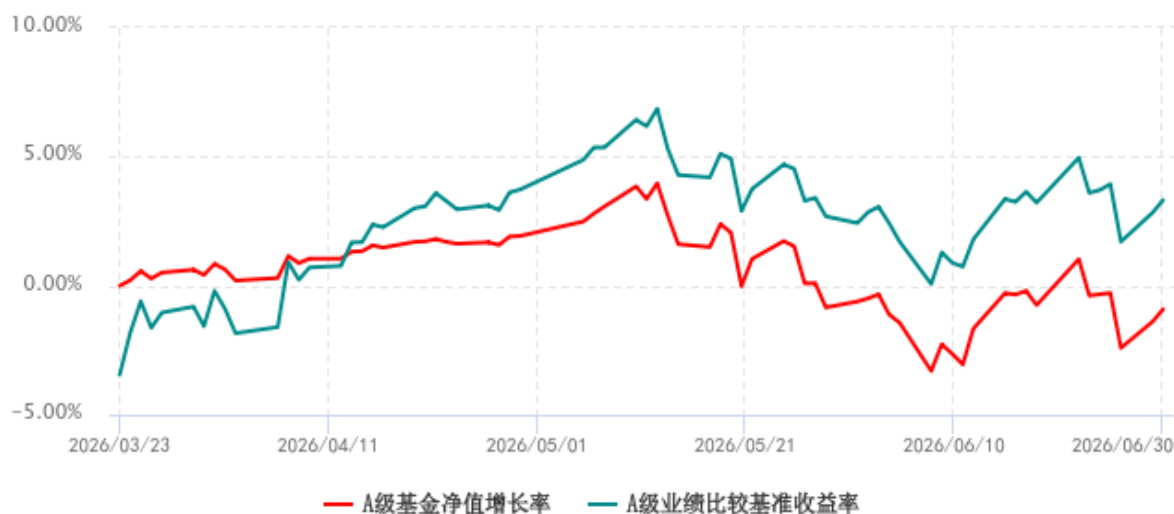
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-1.35%	0.79%	4.96%	0.89%	-6.31%	-0.10%
自基金合同生效起至今	-0.94%	0.75%	3.32%	1.00%	-4.26%	-0.25%

注：1、本基金成立于 2026 年 3 月 23 日；

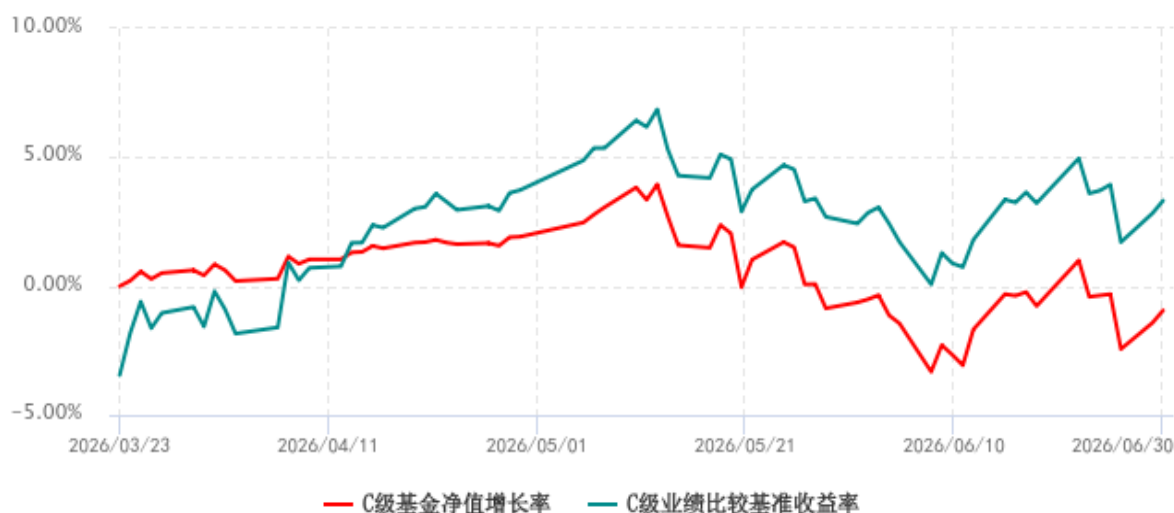
2、比较基准：上证综合指数收益率×95%+银行人民币活期存款基准利率（税后）×5%。

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

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
(2026年03月23日-2026年06月30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
(2026年03月23日-2026年06月30日)



注：1、本基金成立于 2026 年 3 月 23 日；
2、比较基准：上证综合指数收益率 $\times$ 95%+银行人民币活期存款基准利率（税后） $\times$ 5%；
3、按基金合同约定，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同的有关规定。本报告期末基金处于建仓期内。

3.3 其他指标

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

兴银基金管理有限责任公司，注册地为福建省泉州市丰泽区，公司主要办公场所位于上海市浦东新区。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，华福证券股份有限公司出资比例为 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 72 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		
翁子晨	本基金的基金经理	2026-03-23	-	5 年	硕士研究生，FRM（金融风险管理师），具有基金从业资格。历任致诚卓远（珠海）投资管理合伙企业（有限合伙）研究员、华兴证券有限公司研究员、成都朋锦仲阳投资管理中心（有限合伙）研究员。2023 年 3 月加入兴银基金管理有限责任公司，历任指数与量化投资部研究员、基金经理助理，现任指数与量化投资部团队主管、基金经理。

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

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人按照法律法规关于公平交易的相关规定，严格执行公司公平交易管理制度，加强了对所管理的不同投资组合向交易价差的分析，确保公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，A 股市场呈现较为明显的结构性分化特征，人工智能算力、半导体、光通信及高端制造等科技成长方向阶段性表现较为突出，部分时段市场交投较为活跃，为宽基量化策略挖掘个股层面的超额收益提供了一定条件。与此同时，二季度以来，市场上涨更多集中于部分景气度较高的行业和强势个股，不同行业及个股之间的表现差异有所扩大，对量化策略适应行业轮动、风格切换及交易拥挤等市场变化的能力提出了更高要求。

报告期内，不同量化产品的业绩表现有所分化。部分偏重科技成长风格的产品取得了相对较好的阶段性表现；部分注重均衡配置的产品，在市场风格较为集中的阶段，超额收益出现一定波动；部分风格暴露相对较高的策略，在市场快速切换过程中面临一定的回撤压力。公开资料显示，截至 2026 年 6 月 30 日，万得全 A 等权指数上半年收益率为-1.37%，科技成长类指数同期表现相对较强，反映出报告期内市场风格分化较为明显。

在上述市场环境下，传统多因子策略所采用的分散化投资方式，以及部分偏逆向交易的高频策略特征，阶段性面临一定的超额收益获取压力。本基金模型的超额收益在二季度中后段也出现了一定回撤。经过对因子表现、策略特征及市场环境综合分析，我们认为，当前市场分化程度处于相对较高水平，后续市场风格存在逐步再平衡的可能，但其演变节奏和幅度仍具有不确定性。基于此，本基金继续坚持因子均衡和组合分散的多因子选股框架，同时结合市场情况，在对风险控制模型进行升级的同时避免引入主观风格判断，持续加强超额收益回撤管理。

2026 年上半年，在策略构建方面，本基金继续坚持风险控制与风格相对均衡的投资理念，基于 Barra 多因子模型，对市值、行业、估值、波动率及流动性等主要风险因子敞口进行持续监测和约束，尽量避免组合收益过度依赖某一类市场风格。面对科技成长主线表现较强、行业间分化有所扩大的市场环境，本基金在保持对业绩比较基准有效跟踪的基础上，根据市场风险特征调整和完善风险控制模型约束，避免主观风格暴露，使超额收益更多来源于个股选择。在追求长期超额收益的过程中，本基金注重控制超额收益波动，努力改善组合的风险调整后收益表现，降低短期追逐市场

风格可能带来的回撤风险。

在策略研发方面，我们持续跟踪境内外量化投资领域的发展趋势，依托现有的数据和计算基础设施，不断完善涵盖基本面因子、高频价量信号及另类数据的多维因子体系。通过机器学习等方法开展因子评估、动态加权和组合优化研究，持续检验不同因子在各类市场环境下的有效性和稳健性，努力拓展超额收益来源并提升模型的适应能力。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴银上证综合指数增强 A 基金份额净值为 0.9909 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.91%，同期业绩比较基准收益率为 3.32%；截至报告期末兴银上证综合指数增强 C 基金份额净值为 0.9906 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.94%，同期业绩比较基准收益率为 3.32%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，本基金将继续发挥量化模型在组合构建、风险管理和个股选择等方面的作用，重视回撤及超额收益波动管理，努力提升长期风险调整后收益表现。对于本基金及其业绩比较基准所覆盖的成长风格上市公司，我们将持续关注其基本面变化、估值水平和产业发展趋势，并根据模型信号及风险控制要求审慎开展投资运作。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

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

2、基金经理参与或决定估值的程度

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

3、本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

4、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息。

无。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行利润分配，符合法律法规的规定及《基金合同》的约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人根据自身能够获取的数据和信息，认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：兴银上证综合指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	2,675,817.35
结算备付金		16,667,168.71
存出保证金		1,399,605.60
交易性金融资产	6.4.7.2	136,985,163.64
其中：股票投资		136,985,163.64
基金投资		—
债券投资		—
资产支持证券投资		—
贵金属投资		—
其他投资		—
衍生金融资产	6.4.7.3	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—
应收清算款		—
应收股利		—
应收申购款		786,178.86
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.5	—
资产总计		158,513,934.16
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日
负 债：		
短期借款		—
交易性金融负债		—
衍生金融负债	6.4.7.3	—
卖出回购金融资产款		—
应付清算款		—
应付赎回款		1,334,016.88
应付管理人报酬		108,074.89
应付托管费		13,509.37
应付销售服务费		10,626.64
应付投资顾问费		—
应交税费		8,638.98
应付利润		—
递延所得税负债		—
其他负债	6.4.7.6	70,422.52
负债合计		1,545,289.28

净资产：		
实收基金	6.4.7.7	158,451,679.16
未分配利润	6.4.7.8	-1,483,034.28
净资产合计		156,968,644.88
负债和净资产总计		158,513,934.16

注：1、报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 158,451,679.16 份。其中兴银上证综合指数增强 A 基金份额净值 0.9909 元，基金份额总额 33,678,604.57 份；兴银上证综合指数增强 C 基金份额净值 0.9906 元，基金份额总额 124,773,074.59 份。

2、本基金于 2026 年 03 月 23 日成立，本财务报表的实际编制期间为 2026 年 03 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日止。

6.2 利润表

会计主体：兴银上证综合指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 03 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 03 月 23 日（基金合同 生效日）至 2026 年 06 月 30 日
一、营业总收入		3,502,142.20
1. 利息收入		73,461.78
其中：存款利息收入	6.4.7.9	73,461.78
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）		4,918,220.35
其中：股票投资收益	6.4.7.10	3,113,723.87
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-
衍生工具收益	6.4.7.14	581,843.12
股利收益	6.4.7.15	1,222,653.36
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-1,509,939.67
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	20,399.74
减：二、营业总支出		763,216.05
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	566,644.52
2. 托管费	6.4.10.2.2	70,830.58

3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	56,937.16
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. 18	-
7. 税金及附加		2,110.79
8. 其他费用	6. 4. 7. 19	66,693.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,738,926.15
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,738,926.15
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		2,738,926.15

6.3 净资产变动表

会计主体：兴银上证综合指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 03 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2026 年 03 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	356,530,612.94	-	356,530,612.94
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-198,078,933.78	-1,483,034.28	-199,561,968.06
（一）、综合收益总额	-	2,738,926.15	2,738,926.15
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-198,078,933.78	-4,221,960.43	-202,300,894.21
其中：1. 基金申购款	29,496,011.27	-28,901.24	29,467,110.03
2. 基金赎回款	-227,574,945.05	-4,193,059.19	-231,768,004.24
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	158,451,679.16	-1,483,034.28	156,968,644.88

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：

易勇

刘钊

崔可

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

兴银上证综合指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可(2026)187号注册募集。《兴银上证综合指数增强型证券投资基金基金合同》于2026年3月23日正式生效。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,本基金首次募集规模为人民币356,530,612.94份基金份额。本基金的基金管理人为兴银基金管理有限责任公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》相关规定以及《兴银上证综合指数增强型证券投资基金基金合同》等法律文件约定,本基金投资于标的指数成份股及备选成份股(含存托凭证,下同)、除标的指数成份股及备选成份股以外的其他股票(包括主板、创业板以及其他经中国证监会允许发行上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、公开发行的次级债等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、衍生工具(包括国债期货、股指期货、股票期权)、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)。本基金可根据法律法规的规定参与融资、转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为:投资于股票(含存托凭证)的资产比例不低于基金资产的80%,投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%;每个交易日日终,在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,本基金应当保持不低于基金资产净值5%的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年以内的政府债券。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为:上证综合指数收益率 $\times$ 95%+银行人民币活期存款基准利率(税后) $\times$ 5%。

6.4.2 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》(以下合称“企业会计准则”)的要求,同时亦按照中国证券投资基金业协会(以下简称“基金业协会”)颁布的《公开募集证券投资基金信息披露XBRL模板第3号——年度报告和中期报告》、《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注6.4.2中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求,真实、完整地反映了本基金2026年6月30日的

财务状况、自 2026 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间为自 2026 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 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。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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，参考类似投资品种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。

6.4.4.5 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，参考类似投资品种的现

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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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净资产比例计算的金额。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净资产比例计算的金额。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。

6.4.4.9 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其变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其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。

6.4.4.10 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。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

根据《基金合同》，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。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.14 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，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《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所

得税政策有关问题的通知》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税〔2008〕1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税〔2016〕36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税〔2016〕46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税〔2016〕70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税〔2016〕140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税〔2017〕2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税〔2017〕56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税〔2017〕90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税〔2023〕39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税〔2025〕4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税〔2026〕10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，免征增值税；对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。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对本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，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

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

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

e) 对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本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附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
活期存款	2,675,817.35
等于：本金	2,675,512.38
加：应计利息	304.97
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	2,675,817.35

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 06 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		138,504,564.27	-	136,985,163.64	-1,519,400.63
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	138,504,564.27	-	136,985,163.64	-1,519,400.63

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	11,653,600.00	-	-	-
——股指期货	11,653,600.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	11,653,600.00	-	-	-

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

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2607	IF2607	5	7,383,000.00	7,380.00
IH2607	IH2607	1	886,380.00	-240.00
IM2609	IM2609	2	3,394,000.00	2,640.00
合计				9,780.00
减：可抵销期货暂收款				9,780.00
净额				0.00

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金于本报告期末未持有任何买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

注：本基金于本报告期末未持有任何其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	65,493.00
其他应付	4,929.52
合计	70,422.52

6.4.7.7 实收基金

兴银上证综合指数增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026 年 03 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	65,495,170.14	65,495,170.14
本期申购	1,247,702.01	1,247,702.01
本期赎回（以“-”号填列）	-33,064,267.58	-33,064,267.58
本期末	33,678,604.57	33,678,604.57

兴银上证综合指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026 年 03 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	291,035,442.80	291,035,442.80
本期申购	28,248,309.26	28,248,309.26
本期赎回（以“-”号填列）	-194,510,677.47	-194,510,677.47
本期末	124,773,074.59	124,773,074.59

注：此处申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

兴银上证综合指数增强 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	821,355.40	-472,268.51	349,086.89
本期基金份额交易产生的变动数	-409,021.10	-248,042.84	-657,063.94
其中：基金申购款	17,066.56	-11,762.31	5,304.25
基金赎回款	-426,087.66	-236,280.53	-662,368.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	412,334.30	-720,311.35	-307,977.05

兴银上证综合指数增强 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	3,427,510.42	-1,037,671.16	2,389,839.26
本期基金份额交易产生的变动数	-1,934,578.84	-1,630,317.65	-3,564,896.49
其中：基金申购款	397,049.25	-431,254.74	-34,205.49
基金赎回款	-2,331,628.09	-1,199,062.91	-3,530,691.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,492,931.58	-2,667,988.81	-1,175,057.23

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 03 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	52,642.98
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	20,818.80
其他	-
合计	73,461.78

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 03 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	349,502,051.99
减：卖出股票成本总额	345,989,136.18

减：交易费用	399,191.94
买卖股票差价收入	3,113,723.87

6.4.7.10.2 股票投资收益——证券出借差价收入

注：基金在本报告期无股票投资证券出借差价收入。

6.4.7.11 债券投资收益

注：本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

注：本基金在本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

注：本基金在本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金在本报告期内无衍生工具收益买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 03 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
股指期货投资收益	603,920.00
减：其他衍生工具收益应缴纳增值税	17,589.91
减：交易费用	4,486.97
合计	581,843.12

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 03 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,222,653.36
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	1,222,653.36

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2026 年 03 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-1,519,400.63
——股票投资	-1,519,400.63
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	9,780.00
——权证投资	-
——期货投资	9,780.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	319.04
合计	-1,509,939.67

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 03 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	20,399.74
合计	20,399.74

6.4.7.18 信用减值损失

注：本基金在本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 03 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	12,676.00
信息披露费	52,817.00
证券出借违约金	-
证券账户开户费	1,200.00
合计	66,693.00

6.4.7.20 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

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

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期末不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
兴银基金管理有限责任公司(以下简称“兴银基金”)	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司(以下简称“兴业银行”)	基金托管人、基金销售机构
华福证券股份有限公司(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“兴瀚资管”)	基金管理人的子公司

注：本基金与关联方的所有交易均是在正常业务中按照一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2026 年 03 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华福证券	833,995,752.44	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 03 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华福证券	216,844.53	100.00%	0.00	0.00%

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。

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 2026 年 03 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	566,644.52
其中：应支付销售机构的客户维护费	281,798.12
应支付基金管理人的净管理费	284,846.40

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 03 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	70,830.58

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

$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方 名称	本期 2026 年 03 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴银上证综合指数增强 A	兴银上证综合指数增强 C	合计
兴业银行	-	15,552.28	15,552.28
华福证券	-	39,506.98	39,506.98
合计	-	55,059.26	55,059.26

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.20%，销售服务费计提的计算公式如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内与关联方未进行银行间同业市场债券（含回购）的交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：本基金在本报告期内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。

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

注：本基金在本报告期内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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的管理人在本报告期内未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末未持有本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2026 年 03 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	2,675,817.35	52,642.98

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及创业板股票需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601369	陕鼓动力	2026-06-29	重大事项停牌	9.05	2026-07-13	-	2,000	17,373.00	18,100.00	-

688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事项停牌	832.00	2026-07-13	-	500	375,178.00	416,000.00	-
--------	------	------------	--------	--------	------------	---	-----	------------	------------	---

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无因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

截止本报告期末，本基金无因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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末未持有除国债、政策性金融债、央行票据及地方政府债以外的需按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末未持有需按短期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

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。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末未持有需按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末未持有需按长期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末未持有需按长期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券在证券交易所上市或可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 06 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	2,675,817.35	-	-	-	-	-	2,675,817.35
结算备付金	16,667,168	-	-	-	-	-	16,667,168

	. 71						6 , 6 6 7 , 1 6 8 . 7 1
存出保证金	1, 399, 605. 60	-	-	-	-	-	1 , 3 9 9 , 6 0 5 . 6 0
交易性金融资 产	-	-	-	-	-	136, 985, 163. 64	1 3 6 , 9 8 5 , 1 6 3 . 6 4
应收申购款	-	-	-	-	-	786, 178. 86	7 8 6 , 1 7

							8 . 8 6
资产总计	20,742,591 .66	-	-	-	-	137, 771, 342. 50	1 5 8 , 5 1 3 , 9 3 4 . 1 6
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,33 4,01 6.88	1 , 3 3 4 , 0 1 6 . 8 8
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	108, 074. 89	1 0 8 , 0 7 4 . 8 9
应付托管费	-	-	-	-	-	13,5 09.3 7	1 3 ,

							5 0 9 . 3 7
应付销售服务费	-	-	-	-	-	10,626.64	1 0 , 6 2 6 . 6 4
应交税费	-	-	-	-	-	8,638.98	8 , 6 3 8 . 9 8
其他负债	-	-	-	-	-	70,422.52	7 0 , 4 2 2 . 5 2
负债总计	-	-	-	-	-	1,545,289.28	1 , 5 4 5 , 2 8 9 . 2 8

利率敏感度缺口	20,742,591.66	-	-	-	-	136,226,053.22	156,968,644.88
---------	---------------	---	---	---	---	----------------	----------------

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除利率之外的其他市场变量保持不变；	
	该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券与可交换债券。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)
		本期末 2026 年 06 月 30 日

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

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 2026 年 06 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)

交易性金融资产—股票投资	136,985,163.64	87.27
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—
其他	—	—
合计	136,985,163.64	87.27

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	以沪深 300 指数为基准衡量其他价格风险，且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 2026 年 06 月 30 日
	沪深 300 指数上涨 5%	6,020,354.05
	沪深 300 指数下跌 5%	-6,020,354.05

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

- 第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；
- 第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；
- 第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 06 月 30 日
第一层次	136,551,063.64
第二层次	434,100.00
第三层次	—
合计	136,985,163.64

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

于本报告期间，本基金无公允价值所属层次间的重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2025 年 12 月 31 日：

无)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2026 年 6 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	136,985,163.64	86.42
	其中：股票	136,985,163.64	86.42
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	19,342,986.06	12.20
8	其他各项资产	2,185,784.46	1.38
9	合计	158,513,934.16	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	59,180.00	0.04
B	采矿业	10,991,960.20	7.00
C	制造业	59,537,355.38	37.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,422,308.00	2.82
E	建筑业	2,264,027.00	1.44
F	批发和零售业	700,682.00	0.45
G	交通运输、仓储和邮政业	3,255,633.00	2.07

H	住宿和餐饮业	19,789.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,303,319.52	4.65
J	金融业	27,200,061.00	17.33
K	房地产业	470,504.00	0.30
L	租赁和商务服务业	404,044.00	0.26
M	科学研究和技术服务业	1,089,771.00	0.69
N	水利、环境和公共设施管理业	372,238.00	0.24
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	13,552.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	121,877.00	0.08
S	综合	301,558.00	0.19
	合计	118,527,859.10	75.51

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	82,400.00	0.05
C	制造业	15,403,948.54	9.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	456,630.00	0.29
E	建筑业	177,350.00	0.11
F	批发和零售业	312,330.00	0.20
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,474,464.00	0.94
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	183,297.00	0.12
M	科学研究和技术服务业	280,159.00	0.18
N	水利、环境和公共设施管理业	86,726.00	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	18,457,304.54	11.76

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	601288	农业银行	695,900	4,224,113.00	2.69
2	601398	工商银行	587,500	4,153,625.00	2.65
3	600519	贵州茅台	2,800	3,319,372.00	2.11
4	601138	工业富联	43,200	3,116,880.00	1.99
5	601857	中国石油	352,400	3,058,832.00	1.95
6	601988	中国银行	518,900	2,968,108.00	1.89
7	688256	寒武纪	1,445	2,305,569.75	1.47
8	688041	海光信息	5,047	1,868,904.10	1.19
9	601628	中国人寿	45,000	1,590,750.00	1.01
10	600036	招商银行	44,800	1,590,400.00	1.01
11	601088	中国神华	39,700	1,549,888.00	0.99
12	600900	长江电力	52,900	1,400,263.00	0.89
13	603986	兆易创新	1,500	1,222,500.00	0.78
14	601899	紫金矿业	44,500	1,118,730.00	0.71
15	601318	中国平安	23,000	1,098,020.00	0.70
16	601658	邮储银行	215,300	1,061,429.00	0.68
17	688012	中微公司	2,100	983,850.00	0.63
18	600028	中国石化	208,800	931,248.00	0.59
19	600183	生益科技	5,300	919,020.00	0.59
20	601728	中国电信	166,700	865,173.00	0.55
21	688008	澜起科技	2,616	810,698.40	0.52
22	600030	中信证券	26,200	752,726.00	0.48
23	601328	交通银行	113,900	732,377.00	0.47
24	600276	恒瑞医药	13,500	702,540.00	0.45
25	688981	中芯国际	4,220	670,220.40	0.43
26	603259	药明康德	5,300	659,903.00	0.42
27	603993	洛阳钼业	37,300	654,615.00	0.42
28	600176	中国巨石	8,500	619,480.00	0.39
29	600000	浦发银行	70,900	610,449.00	0.39
30	601998	中信银行	86,800	601,524.00	0.38
31	600487	亨通光电	5,300	579,502.00	0.37
32	600667	太极实业	18,900	551,502.00	0.35
33	601211	国泰海通	29,800	542,360.00	0.35
34	600150	中国船舶	15,974	539,761.46	0.34
35	601319	中国人保	75,000	507,000.00	0.32
36	603256	宏和科技	1,900	504,127.00	0.32
37	688082	盛美上海	1,100	475,200.00	0.30
38	601816	京沪高铁	103,000	466,590.00	0.30
39	600309	万华化学	6,600	451,506.00	0.29

40	600522	中天科技	7,100	430,828.00	0.27
41	601939	建设银行	44,600	429,498.00	0.27
42	688146	中船特气	1,200	419,988.00	0.27
43	600919	江苏银行	38,600	416,108.00	0.27
44	688072	拓荆科技	500	416,000.00	0.27
45	601225	陕西煤业	20,400	415,140.00	0.26
46	601601	中国太保	14,400	410,688.00	0.26
47	688525	佰维存储	800	395,784.00	0.25
48	600584	长电科技	3,800	393,490.00	0.25
49	601066	中信建投	13,500	392,445.00	0.25
50	601985	中国核电	42,800	386,484.00	0.25
51	603288	海天味业	11,600	384,656.00	0.25
52	600406	国电南瑞	16,800	383,880.00	0.24
53	601668	中国建筑	86,400	374,976.00	0.24
54	600111	北方稀土	7,700	369,985.00	0.24
55	688120	华海清科	1,100	354,398.00	0.23
56	601919	中远海控	26,200	347,412.00	0.22
57	600025	华能水电	38,700	344,043.00	0.22
58	603019	中科曙光	3,200	343,136.00	0.22
59	688347	华虹宏力	1,009	339,326.70	0.22
60	688521	芯原股份	893	331,428.02	0.21
61	600999	招商证券	15,400	324,940.00	0.21
62	688702	盛科通信	807	314,721.93	0.20
63	600887	伊利股份	13,100	313,876.00	0.20
64	600989	宝丰能源	15,400	313,082.00	0.20
65	601688	华泰证券	15,100	311,362.00	0.20
66	600362	江西铜业	7,100	307,430.00	0.20
67	688766	普冉股份	400	306,640.00	0.20
68	600031	三一重工	17,600	304,128.00	0.19
69	601100	恒立液压	2,800	301,168.00	0.19
70	688361	中科飞测	700	301,000.00	0.19
71	601872	招商轮船	16,600	291,662.00	0.19
72	600160	巨化股份	5,500	291,555.00	0.19
73	600549	厦门钨业	3,300	281,160.00	0.18
74	600875	东方电气	9,700	279,069.00	0.18
75	605117	德业股份	2,600	276,068.00	0.18
76	601818	光大银行	95,500	275,995.00	0.18
77	600809	山西汾酒	2,500	273,425.00	0.17
78	688396	华润微	2,800	273,140.00	0.17
79	688689	银河微电	4,149	268,523.28	0.17
80	688506	百利天恒	900	264,627.00	0.17
81	601698	中国卫通	8,700	263,175.00	0.17
82	688126	沪硅产业	6,576	262,316.64	0.17

83	601766	中国中车	50,100	260,520.00	0.17
84	600690	海尔智家	12,700	259,207.00	0.17
85	601336	新华保险	4,300	256,538.00	0.16
86	600050	中国联通	64,100	256,400.00	0.16
87	600346	恒力石化	14,400	255,024.00	0.16
88	601009	南京银行	25,600	253,184.00	0.16
89	601229	上海银行	29,000	251,720.00	0.16
90	688172	燕东微	3,000	250,980.00	0.16
91	688249	晶合集成	4,136	244,148.08	0.16
92	600019	宝钢股份	44,600	242,178.00	0.15
93	600760	中航沈飞	5,800	238,380.00	0.15
94	603501	豪威集团	2,500	237,125.00	0.15
95	603659	璞泰来	8,100	234,333.00	0.15
96	600089	特变电工	10,400	234,000.00	0.15
97	600016	民生银行	72,200	232,484.00	0.15
98	601168	西部矿业	8,400	227,976.00	0.15
99	600104	上汽集团	23,300	227,408.00	0.14
100	601898	中煤能源	18,640	227,035.20	0.14
101	688183	生益电子	1,700	225,080.00	0.14
102	601600	中国铝业	27,000	221,940.00	0.14
103	600018	上港集团	47,000	221,840.00	0.14
104	603663	三祥新材	2,300	221,490.00	0.14
105	603296	华勤技术	2,960	219,839.20	0.14
106	688630	芯碁微装	400	219,756.00	0.14
107	600188	兖矿能源	12,200	216,794.00	0.14
108	600905	三峡能源	57,900	214,809.00	0.14
109	600886	国投电力	16,100	214,291.00	0.14
110	688111	金山办公	1,000	213,050.00	0.14
111	601995	中金公司	5,800	209,670.00	0.13
112	601888	中国中免	3,900	209,469.00	0.13
113	601127	赛力斯	3,400	208,250.00	0.13
114	601169	北京银行	42,500	208,250.00	0.13
115	600893	航发动力	5,400	207,036.00	0.13
116	600498	烽火通信	2,800	206,080.00	0.13
117	600015	华夏银行	32,200	205,758.00	0.13
118	601061	中信金属	19,100	205,707.00	0.13
119	600673	东阳光	6,100	204,838.00	0.13
120	600378	昊华科技	2,700	203,526.00	0.13
121	688110	东芯股份	997	203,088.90	0.13
122	600105	永鼎股份	3,000	202,440.00	0.13
123	688777	中控技术	1,700	199,750.00	0.13
124	601012	隆基绿能	15,100	198,112.00	0.13
125	601689	拓普集团	3,500	197,470.00	0.13

126	600660	福耀玻璃	3,900	196,716.00	0.13
127	600010	包钢股份	87,100	194,233.00	0.12
128	603806	福斯特	11,400	191,406.00	0.12
129	601633	长城汽车	12,600	190,134.00	0.12
130	601111	中国国航	31,300	189,365.00	0.12
131	600118	中国卫星	2,300	188,715.00	0.12
132	603588	高能环境	9,600	184,320.00	0.12
133	600988	赤峰黄金	7,000	184,240.00	0.12
134	603799	华友钴业	3,800	183,388.00	0.12
135	601006	大秦铁路	39,600	182,556.00	0.12
136	600143	金发科技	11,800	182,310.00	0.12
137	603308	应流股份	3,000	181,200.00	0.12
138	600460	士兰微	3,300	180,378.00	0.11
139	601958	金钼股份	6,400	179,904.00	0.11
140	601881	中国银河	14,300	179,751.00	0.11
141	601699	潞安环能	12,500	178,500.00	0.11
142	600298	安琪酵母	4,900	177,380.00	0.11
143	601868	中国能建	66,300	177,021.00	0.11
144	600489	中金黄金	9,800	176,890.00	0.11
145	603179	新泉股份	3,560	176,754.00	0.11
146	600985	淮北矿业	12,500	175,625.00	0.11
147	601727	上海电气	25,000	175,000.00	0.11
148	688271	联影医疗	1,700	172,091.00	0.11
149	601390	中国中铁	40,900	170,553.00	0.11
150	688469	芯联集成	16,037	170,152.57	0.11
151	603893	瑞芯微	900	169,524.00	0.11
152	603225	新凤鸣	8,600	168,990.00	0.11
153	688629	华丰科技	900	168,759.00	0.11
154	600547	山东黄金	7,300	168,557.00	0.11
155	603979	金诚信	2,800	165,284.00	0.11
156	600011	华能国际	21,700	164,703.00	0.10
157	600795	国电电力	35,200	164,384.00	0.10
158	600941	中国移动	1,900	163,647.00	0.10
159	600938	中国海油	6,000	162,900.00	0.10
160	688313	仕佳光子	875	161,568.75	0.10
161	605499	东鹏饮料	1,300	160,459.00	0.10
162	601669	中国电建	33,900	159,330.00	0.10
163	600282	南钢股份	34,400	157,896.00	0.10
164	603380	易德龙	3,500	157,815.00	0.10
165	688668	鼎通科技	421	157,159.30	0.10
166	688234	天岳先进	900	156,159.00	0.10
167	603876	鼎胜新材	6,000	156,060.00	0.10
168	601231	环旭电子	4,800	155,520.00	0.10

169	603679	华体科技	7,700	155,386.00	0.10
170	688388	嘉元科技	3,482	153,208.00	0.10
171	688409	富创精密	500	153,125.00	0.10
172	603728	鸣志电器	2,500	152,300.00	0.10
173	601179	中国西电	10,100	150,692.00	0.10
174	688378	奥来德	2,397	148,614.00	0.09
175	601399	国机重装	42,400	148,400.00	0.09
176	688167	炬光科技	416	147,351.36	0.09
177	600026	中远海能	8,200	147,108.00	0.09
178	688141	杰华特	958	147,053.00	0.09
179	601838	成都银行	8,300	146,910.00	0.09
180	601677	明泰铝业	8,800	146,080.00	0.09
181	688147	微导纳米	900	145,692.00	0.09
182	600482	中国动力	4,400	144,320.00	0.09
183	600869	远东股份	4,300	143,921.00	0.09
184	601918	新集能源	16,700	143,453.00	0.09
185	688627	精智达	200	143,000.00	0.09
186	688516	奥特维	2,486	142,671.54	0.09
187	600486	扬农化工	2,800	141,960.00	0.09
188	601208	东材科技	2,000	141,580.00	0.09
189	601825	沪农商行	18,900	141,561.00	0.09
190	688036	传音控股	2,400	141,480.00	0.09
191	600688	上海石化	48,200	141,226.00	0.09
192	600595	中孚实业	25,100	141,062.00	0.09
193	688275	万润新能	1,100	140,305.00	0.09
194	601608	中信重工	29,400	140,238.00	0.09
195	600023	浙能电力	26,200	137,812.00	0.09
196	605133	嵘泰股份	3,500	137,795.00	0.09
197	603928	兴业股份	9,300	137,640.00	0.09
198	603228	景旺电子	1,900	137,579.00	0.09
199	603195	公牛集团	3,500	137,025.00	0.09
200	600535	天士力	10,300	136,269.00	0.09
201	603638	艾迪精密	5,800	136,010.00	0.09
202	688181	八亿时空	2,160	135,216.00	0.09
203	600236	桂冠电力	15,400	135,212.00	0.09
204	600958	东方证券	14,300	134,992.00	0.09
205	600062	华润双鹤	8,400	134,736.00	0.09
206	600029	南方航空	25,900	134,162.00	0.09
207	600879	航天电子	6,300	134,127.00	0.09
208	600392	盛和资源	4,500	133,965.00	0.09
209	601186	中国铁建	22,400	133,280.00	0.08
210	688585	上纬新材	800	132,640.00	0.08
211	688620	安凯微	8,149	132,013.80	0.08

212	688556	高测股份	9,929	131,857.12	0.08
213	600039	四川路桥	16,800	131,376.00	0.08
214	601800	中国交建	23,000	131,330.00	0.08
215	600436	片仔癀	1,200	131,136.00	0.08
216	600585	海螺水泥	7,700	130,515.00	0.08
217	605060	联德股份	2,300	130,502.00	0.08
218	601139	深圳燃气	22,800	129,048.00	0.08
219	600339	中油工程	41,900	128,633.00	0.08
220	600717	天津港	32,900	127,981.00	0.08
221	601069	西部黄金	5,800	127,600.00	0.08
222	600267	海正药业	12,600	127,386.00	0.08
223	688387	信科移动	6,412	127,214.08	0.08
224	600509	天富能源	15,000	126,750.00	0.08
225	603992	松霖科技	3,900	126,360.00	0.08
226	688321	微芯生物	4,795	126,252.35	0.08
227	688548	广钢气体	2,411	125,613.10	0.08
228	688779	五矿新能	15,458	125,364.38	0.08
229	688375	国博电子	1,200	125,160.00	0.08
230	688173	希荻微	6,514	124,677.96	0.08
231	603132	金徽股份	8,000	124,640.00	0.08
232	600115	中国东航	32,500	123,825.00	0.08
233	688047	龙芯中科	800	123,736.00	0.08
234	603707	健友股份	17,500	123,725.00	0.08
235	688045	必易微	1,527	123,351.06	0.08
236	601666	平煤股份	17,200	122,980.00	0.08
237	605300	佳禾食品	12,499	121,865.25	0.08
238	603185	弘元绿能	7,300	121,837.00	0.08
239	600320	振华重工	29,400	121,422.00	0.08
240	688020	方邦股份	482	120,307.20	0.08
241	600271	航天信息	18,200	119,756.00	0.08
242	603012	创力集团	14,600	119,720.00	0.08
243	601018	宁波港	36,800	115,920.00	0.07
244	688226	威腾电气	2,700	115,641.00	0.07
245	601360	三六零	13,300	115,577.00	0.07
246	600720	中交设计	23,900	115,198.00	0.07
247	688295	中复神鹰	1,900	115,026.00	0.07
248	605222	起帆电缆	4,900	114,268.00	0.07
249	603660	苏州科达	9,300	113,925.00	0.07
250	603901	永创智能	10,480	113,917.60	0.07
251	600418	江淮汽车	4,400	113,652.00	0.07
252	688327	云从科技	9,109	113,498.14	0.07
253	603156	养元饮品	2,300	112,861.00	0.07
254	600497	驰宏锌锗	9,300	112,623.00	0.07

255	600066	宇通客车	4,200	112,602.00	0.07
256	688505	复旦张江	15,249	112,537.62	0.07
257	605196	华通线缆	4,300	112,230.00	0.07
258	600707	彩虹股份	6,600	111,474.00	0.07
259	603333	福华尚纬	13,800	111,228.00	0.07
260	603599	广信股份	11,600	111,128.00	0.07
261	603260	合盛硅业	2,300	110,998.00	0.07
262	688775	影石创新	800	110,920.00	0.07
263	601901	方正证券	15,400	110,880.00	0.07
264	603367	辰欣药业	8,600	110,338.00	0.07
265	688683	莱尔科技	2,897	109,854.24	0.07
266	603848	好太太	8,000	109,280.00	0.07
267	603626	科森科技	5,900	109,150.00	0.07
268	603929	亚翔集成	400	108,808.00	0.07
269	600009	上海机场	4,700	108,570.00	0.07
270	605376	博迁新材	400	108,520.00	0.07
271	603725	天安新材	9,600	108,480.00	0.07
272	688176	亚虹医药	10,929	108,415.68	0.07
273	688002	睿创微纳	700	108,283.00	0.07
274	605589	圣泉集团	1,700	108,069.00	0.07
275	600966	博汇纸业	22,600	108,028.00	0.07
276	600895	张江高科	2,900	108,025.00	0.07
277	603916	苏博特	7,900	107,914.00	0.07
278	603650	彤程新材	1,100	107,778.00	0.07
279	601126	四方股份	1,700	107,440.00	0.07
280	603127	昭衍新药	2,800	107,016.00	0.07
281	688549	中巨芯	2,900	106,749.00	0.07
282	600096	云天化	3,500	106,400.00	0.07
283	600415	小商品城	10,400	105,664.00	0.07
284	600501	航天晨光	6,700	105,391.00	0.07
285	601788	光大证券	7,300	105,339.00	0.07
286	600123	兰花科创	19,700	105,198.00	0.07
287	603681	永冠新材	4,600	105,110.00	0.07
288	688200	华峰测控	200	105,020.00	0.07
289	600425	青松建化	32,100	104,967.00	0.07
290	688609	九联科技	9,493	104,517.93	0.07
291	688322	奥比中光	800	104,440.00	0.07
292	601968	宝钢包装	26,600	104,272.00	0.07
293	603408	建霖家居	10,800	104,220.00	0.07
294	600308	华泰股份	34,800	104,052.00	0.07
295	603933	睿能科技	4,600	103,730.00	0.07
296	600048	保利发展	22,400	103,712.00	0.07
297	603630	拉芳家化	8,100	103,518.00	0.07

298	601279	英利汽车	33,900	103,395.00	0.07
299	603285	键邦股份	2,300	103,063.00	0.07
300	600438	通威股份	8,500	102,935.00	0.07
301	603719	良品铺子	11,900	102,935.00	0.07
302	603158	腾龙股份	8,400	102,732.00	0.07
303	600796	钱江生化	22,100	102,544.00	0.07
304	600746	江苏索普	19,600	102,508.00	0.07
305	603511	爱慕股份	8,900	102,350.00	0.07
306	688299	长阳科技	6,106	102,031.26	0.07
307	600590	泰豪科技	10,100	102,010.00	0.06
308	603083	剑桥科技	400	101,948.00	0.06
309	603819	神力股份	8,900	101,905.00	0.06
310	600292	电投水电	8,400	101,136.00	0.06
311	601002	晋亿实业	23,400	101,088.00	0.06
312	605358	立昂微	1,300	100,880.00	0.06
313	688027	国盾量子	200	100,802.00	0.06
314	600233	圆通速递	6,400	100,800.00	0.06
315	688468	科美诊断	17,687	100,639.03	0.06
316	688048	长光华芯	200	100,400.00	0.06
317	601077	渝农商行	16,400	100,204.00	0.06
318	688339	亿华通	5,353	100,101.10	0.06
319	600885	宏发股份	2,900	100,021.00	0.06
320	600909	华安证券	9,000	99,990.00	0.06
321	601916	浙商银行	38,000	99,940.00	0.06
322	600206	有研新材	1,500	99,900.00	0.06
323	688220	翱捷科技	800	99,456.00	0.06
324	600580	卧龙电驱	3,000	99,300.00	0.06
325	600350	山东高速	8,900	99,057.00	0.06
326	600081	东风科技	10,900	98,972.00	0.06
327	600262	北方股份	5,000	98,950.00	0.06
328	600333	长春燃气	19,700	98,894.00	0.06
329	688369	致远互联	4,697	98,683.97	0.06
330	688365	光云科技	6,255	98,641.35	0.06
331	600141	兴发集团	2,100	98,637.00	0.06
332	603381	永臻股份	6,400	98,624.00	0.06
333	603029	天鹅股份	7,000	98,420.00	0.06
334	688030	山石网科	6,232	98,403.28	0.06
335	603970	中农立华	10,200	98,226.00	0.06
336	601877	正泰电器	3,900	97,773.00	0.06
337	603017	中衡设计	9,800	97,510.00	0.06
338	603926	铁流股份	5,500	97,295.00	0.06
339	600805	悦达投资	24,000	96,720.00	0.06
340	603280	南方路机	3,900	96,720.00	0.06

341	603536	惠发食品	12,400	96,596.00	0.06
342	600372	中航机载	8,900	96,565.00	0.06
343	688187	时代电气	1,399	96,055.34	0.06
344	603113	金能科技	23,300	95,996.00	0.06
345	600616	金枫酒业	25,500	95,625.00	0.06
346	603321	梅轮电梯	16,700	95,524.00	0.06
347	601377	兴业证券	15,800	95,432.00	0.06
348	601233	桐昆股份	4,400	95,260.00	0.06
349	605189	富春染织	7,900	95,195.00	0.06
350	603768	常青股份	10,400	94,952.00	0.06
351	601059	信达证券	5,800	93,902.00	0.06
352	600426	华鲁恒升	3,900	93,288.00	0.06
353	688545	兴福电子	700	93,142.00	0.06
354	603178	圣龙股份	6,700	92,795.00	0.06
355	688728	格科微	4,335	91,208.40	0.06
356	600741	华域汽车	5,800	90,016.00	0.06
357	688223	晶科能源	18,707	88,858.25	0.06
358	600803	新奥股份	5,600	88,480.00	0.06
359	688037	芯源微	200	87,810.00	0.06
360	688578	艾力斯	800	87,360.00	0.06
361	600196	复星医药	3,800	85,386.00	0.05
362	688432	有研硅	2,135	85,335.95	0.05
363	601456	国联民生	9,600	84,864.00	0.05
364	600219	南山铝业	21,200	84,588.00	0.05
365	688017	绿的谐波	200	83,572.00	0.05
366	603379	三美股份	1,100	83,479.00	0.05
367	603688	石英股份	1,000	82,610.00	0.05
368	601117	中国化学	11,200	82,320.00	0.05
369	688099	晶晨股份	800	82,320.00	0.05
370	600377	宁沪高速	7,000	80,990.00	0.05
371	600578	京能电力	12,300	79,335.00	0.05
372	600027	华电国际	17,700	78,765.00	0.05
373	600021	上海电力	5,200	78,364.00	0.05
374	601021	春秋航空	1,700	77,486.00	0.05
375	601298	青岛港	9,600	77,280.00	0.05
376	688001	华兴源创	900	77,130.00	0.05
377	601607	上海医药	5,000	77,000.00	0.05
378	603129	春风动力	300	76,740.00	0.05
379	600563	法拉电子	400	76,320.00	0.05
380	601198	东兴证券	5,600	76,104.00	0.05
381	688519	南亚新材	200	76,008.00	0.05
382	601878	浙商证券	8,000	76,000.00	0.05
383	600642	申能股份	8,700	75,951.00	0.05

384	688336	三生国健	1,426	75,720.60	0.05
385	688122	西部超导	1,200	75,372.00	0.05
386	688213	思特威	700	74,949.00	0.05
387	688188	柏楚电子	700	74,690.00	0.05
388	600918	中泰证券	13,700	72,884.00	0.05
389	600570	恒生电子	3,400	72,046.00	0.05
390	603049	中策橡胶	1,600	71,696.00	0.05
391	603629	利通电子	400	71,524.00	0.05
392	688009	中国通号	15,021	71,499.96	0.05
393	600061	国投资本	10,900	71,395.00	0.05
394	603212	赛伍技术	5,800	70,992.00	0.05
395	601618	中国中冶	28,700	70,028.00	0.04
396	605111	新洁能	700	69,398.00	0.04
397	688449	联芸科技	800	69,048.00	0.04
398	600995	南网储能	5,600	68,880.00	0.04
399	688433	华曙高科	800	68,480.00	0.04
400	688127	蓝特光学	700	68,320.00	0.04
401	601555	东吴证券	8,600	68,112.00	0.04
402	600600	青岛啤酒	1,300	67,899.00	0.04
403	688019	安集科技	200	67,892.00	0.04
404	688676	金盘科技	800	67,712.00	0.04
405	603186	华正新材	300	67,590.00	0.04
406	688403	汇成股份	1,700	67,490.00	0.04
407	688362	甬矽电子	700	67,480.00	0.04
408	601108	财通证券	7,800	67,470.00	0.04
409	688472	阿特斯	6,218	67,278.76	0.04
410	601136	首创证券	4,800	66,960.00	0.04
411	600352	浙江龙盛	5,500	66,605.00	0.04
412	603678	火炬电子	800	66,400.00	0.04
413	688303	大全能源	3,762	65,571.66	0.04
414	601216	君正集团	14,700	65,562.00	0.04
415	603699	纽威股份	1,300	65,390.00	0.04
416	603773	沃格光电	400	65,188.00	0.04
417	688331	荣昌生物	500	65,130.00	0.04
418	601238	广汽集团	12,800	65,024.00	0.04
419	600330	天通股份	2,100	64,764.00	0.04
420	601058	赛轮轮胎	5,600	64,568.00	0.04
421	688385	复旦微电	900	64,161.00	0.04
422	600641	先导基电	1,600	63,776.00	0.04
423	600863	华能蒙电	13,500	63,450.00	0.04
424	600845	宝信软件	3,800	63,194.00	0.04
425	603920	世运电路	1,300	62,452.00	0.04
426	688248	南网科技	900	62,262.00	0.04

427	603306	华懋科技	600	62,214.00	0.04
428	688102	斯瑞新材	1,300	61,334.00	0.04
429	603290	斯达半导	400	61,176.00	0.04
430	600259	中稀有有色	600	60,966.00	0.04
431	601665	齐鲁银行	10,400	60,008.00	0.04
432	603618	杭电股份	1,200	59,856.00	0.04
433	603005	晶方科技	1,100	59,257.00	0.04
434	600060	海信视像	2,100	58,527.00	0.04
435	601577	长沙银行	6,700	58,357.00	0.04
436	600968	海油发展	17,500	58,275.00	0.04
437	688411	海博思创	200	58,240.00	0.04
438	600177	雅戈尔	7,700	57,981.00	0.04
439	688065	凯赛生物	1,200	57,420.00	0.04
440	603087	甘李药业	1,000	56,760.00	0.04
441	603392	万泰生物	2,100	56,637.00	0.04
442	600901	江苏金租	9,700	55,775.00	0.04
443	601611	中国核建	5,000	55,750.00	0.04
444	603067	振华股份	1,200	55,548.00	0.04
445	600961	株冶集团	1,700	55,063.00	0.04
446	601162	天风证券	16,200	54,594.00	0.03
447	601808	中海油服	5,000	54,050.00	0.03
448	603606	东方电缆	1,300	53,963.00	0.03
449	688568	中科星图	1,300	53,911.00	0.03
450	603568	伟明环保	3,500	53,830.00	0.03
451	600085	同仁堂	2,300	53,153.00	0.03
452	688503	聚和材料	400	53,080.00	0.03
453	603119	浙江荣泰	800	53,072.00	0.03
454	688400	凌云光	800	52,960.00	0.03
455	600109	国金证券	6,000	52,680.00	0.03
456	600733	北汽蓝谷	10,800	52,596.00	0.03
457	600256	广汇能源	10,500	51,870.00	0.03
458	600839	四川长虹	7,400	51,652.00	0.03
459	600588	用友网络	5,600	51,408.00	0.03
460	603486	科沃斯	1,000	50,750.00	0.03
461	601236	红塔证券	7,400	50,468.00	0.03
462	688097	博众精工	800	50,440.00	0.03
463	603298	杭叉集团	2,100	50,106.00	0.03
464	600699	均胜电子	2,300	49,703.00	0.03
465	603115	海星股份	400	48,988.00	0.03
466	688300	联瑞新材	200	48,880.00	0.03
467	601001	晋控煤业	2,800	48,692.00	0.03
468	688538	和辉光电	18,400	47,840.00	0.03
469	600884	杉杉股份	3,500	47,425.00	0.03

470	603369	今世缘	2,000	47,420.00	0.03
471	600483	福能股份	4,600	46,874.00	0.03
472	688266	泽璟制药	400	46,664.00	0.03
473	600332	白云山	2,300	46,092.00	0.03
474	600732	爱旭股份	3,300	45,705.00	0.03
475	688297	中无人机	1,100	45,705.00	0.03
476	600500	中化国际	5,800	45,414.00	0.03
477	601990	南京证券	6,900	45,333.00	0.03
478	600637	东方明珠	5,400	44,874.00	0.03
479	688778	厦钨新能	800	43,520.00	0.03
480	688368	晶丰明源	200	43,304.00	0.03
481	601636	旗滨集团	4,200	42,966.00	0.03
482	600552	凯盛科技	1,300	42,354.00	0.03
483	600515	海南机场	15,400	42,196.00	0.03
484	600536	中国软件	1,500	42,180.00	0.03
485	600517	国网英大	8,900	41,652.00	0.03
486	600499	科达制造	3,000	41,400.00	0.03
487	688352	颀中科技	1,700	41,106.00	0.03
488	603002	宏昌电子	1,700	41,089.00	0.03
489	605090	九丰能源	1,100	40,887.00	0.03
490	688343	云天励飞	500	40,830.00	0.03
491	600737	中粮糖业	3,300	40,689.00	0.03
492	601615	明阳智能	3,500	40,495.00	0.03
493	603516	淳中科技	300	40,383.00	0.03
494	600562	国睿科技	1,900	40,318.00	0.03
495	688180	君实生物	1,189	40,211.98	0.03
496	601598	中国外运	8,100	40,176.00	0.03
497	601933	永辉超市	13,900	39,476.00	0.03
498	603667	五洲新春	600	39,312.00	0.03
499	603836	海程邦达	4,880	38,552.00	0.02
500	603730	岱美股份	3,400	37,978.00	0.02
501	600862	中航高科	2,100	37,863.00	0.02
502	600114	东睦股份	1,000	37,760.00	0.02
503	600299	安迪苏	4,800	37,680.00	0.02
504	603124	江南新材	200	37,396.00	0.02
505	600398	海澜之家	7,100	37,133.00	0.02
506	601156	东航物流	2,300	37,076.00	0.02
507	603063	禾望电气	700	37,023.00	0.02
508	600663	陆家嘴	5,800	36,424.00	0.02
509	601799	星宇股份	400	36,248.00	0.02
510	600977	中国电影	2,800	36,176.00	0.02
511	601016	节能风电	9,300	36,084.00	0.02
512	603738	泰晶科技	600	36,030.00	0.02

513	603605	珀莱雅	600	35,952.00	0.02
514	603766	隆鑫通用	3,000	35,790.00	0.02
515	601000	唐山港	8,600	35,690.00	0.02
516	688318	财富趋势	500	35,655.00	0.02
517	603198	迎驾贡酒	1,200	35,520.00	0.02
518	600312	平高电气	2,000	35,320.00	0.02
519	600516	方大炭素	5,700	35,169.00	0.02
520	600208	衢州发展	12,400	35,092.00	0.02
521	601155	新城控股	3,400	34,884.00	0.02
522	603301	振德医疗	400	34,864.00	0.02
523	600459	贵研铂业	1,200	34,656.00	0.02
524	600704	物产中大	7,300	34,456.00	0.02
525	600906	财达证券	4,600	34,316.00	0.02
526	688150	莱特光电	500	34,310.00	0.02
527	600153	建发股份	4,300	34,099.00	0.02
528	600575	淮河能源	10,600	33,814.00	0.02
529	603950	长源东谷	400	33,772.00	0.02
530	600871	石化油服	16,600	33,698.00	0.02
531	688005	容百科技	1,100	33,660.00	0.02
532	688709	成都华微	881	33,557.29	0.02
533	688349	三一重能	2,200	33,396.00	0.02
534	688757	胜科纳米	500	33,350.00	0.02
535	688819	天能股份	1,500	33,300.00	0.02
536	600998	九州通	7,100	33,299.00	0.02
537	600166	福田汽车	11,400	33,174.00	0.02
538	603881	数据港	1,320	33,000.00	0.02
539	600323	瀚蓝环境	1,200	32,952.00	0.02
540	603885	吉祥航空	3,200	32,928.00	0.02
541	688006	杭可科技	900	32,895.00	0.02
542	688582	芯动联科	500	32,500.00	0.02
543	600161	天坛生物	2,800	32,424.00	0.02
544	688772	珠海冠宇	1,651	32,409.13	0.02
545	603283	赛腾股份	400	32,392.00	0.02
546	688584	上海合晶	900	32,355.00	0.02
547	603596	伯特利	1,300	32,292.00	0.02
548	600100	同方股份	4,700	32,195.00	0.02
549	603345	安井食品	400	32,076.00	0.02
550	601717	中创智领	2,300	31,993.00	0.02
551	600171	上海贝岭	1,000	31,940.00	0.02
552	600888	新疆众和	2,000	31,780.00	0.02
553	601099	太平洋	9,300	31,341.00	0.02
554	603737	三棵树	1,300	31,330.00	0.02
555	600577	精达股份	3,200	31,296.00	0.02

556	600801	华新建材	2,000	31,200.00	0.02
557	600583	海油工程	6,200	31,186.00	0.02
558	600295	鄂尔多斯	2,900	31,088.00	0.02
559	601118	海南橡胶	6,300	30,996.00	0.02
560	601928	凤凰传媒	3,500	30,765.00	0.02
561	603203	快克智能	400	30,712.00	0.02
562	603236	移远通信	600	30,702.00	0.02
563	600546	山煤国际	2,800	30,604.00	0.02
564	688257	新锐股份	300	30,570.00	0.02
565	603939	益丰药房	1,700	30,566.00	0.02
566	603530	神马电力	600	30,540.00	0.02
567	600685	中船防务	1,200	30,528.00	0.02
568	600550	保变电气	2,600	30,498.00	0.02
569	600038	中直股份	1,200	30,348.00	0.02
570	600596	新安股份	1,900	30,324.00	0.02
571	688475	萤石网络	1,100	30,085.00	0.02
572	600329	达仁堂	800	29,776.00	0.02
573	603338	浙江鼎力	700	29,750.00	0.02
574	601128	常熟银行	5,100	29,682.00	0.02
575	688425	铁建重工	7,325	29,446.50	0.02
576	600126	杭钢股份	4,800	29,424.00	0.02
577	600095	湘财股份	3,900	29,367.00	0.02
578	601137	博威合金	1,300	29,029.00	0.02
579	605289	罗曼股份	200	29,000.00	0.02
580	600132	重庆啤酒	700	28,910.00	0.02
581	600566	济川药业	1,300	28,847.00	0.02
582	600521	华海药业	2,000	28,800.00	0.02
583	600873	梅花生物	3,900	28,665.00	0.02
584	603662	柯力传感	400	28,468.00	0.02
585	601567	三星电气	1,900	28,386.00	0.02
586	600098	广州发展	4,800	28,368.00	0.02
587	688484	南芯科技	500	28,245.00	0.02
588	601963	重庆银行	2,800	28,224.00	0.02
589	600598	北大荒	2,600	28,184.00	0.02
590	600428	中远海特	3,600	28,116.00	0.02
591	600316	洪都航空	1,000	27,940.00	0.02
592	601606	长城军工	1,000	27,490.00	0.02
593	603565	中谷物流	2,800	27,468.00	0.02
594	688278	特宝生物	500	27,200.00	0.02
595	600765	中航重机	2,100	27,132.00	0.02
596	603026	石大胜华	300	26,811.00	0.02
597	600390	五矿资本	5,800	26,448.00	0.02
598	688726	拉普拉斯	500	26,425.00	0.02

599	601133	柏诚股份	600	26,424.00	0.02
600	601020	华钰矿业	1,100	26,389.00	0.02
601	601865	福莱特	2,500	26,275.00	0.02
602	600345	长江通信	400	26,204.00	0.02
603	688523	航天环宇	500	26,200.00	0.02
604	603358	华达科技	600	26,100.00	0.02
605	600511	国药股份	1,000	26,040.00	0.02
606	600970	中材国际	3,600	25,668.00	0.02
607	688563	航材股份	500	25,615.00	0.02
608	688018	乐鑫科技	200	25,584.00	0.02
609	688114	华大智造	500	25,540.00	0.02
610	603341	龙旗科技	600	25,494.00	0.02
611	605198	安德利	400	25,344.00	0.02
612	600967	内蒙一机	2,300	24,955.00	0.02
613	601609	金田股份	2,300	24,840.00	0.02
614	688301	奕瑞科技	200	24,800.00	0.02
615	688166	博瑞医药	708	24,787.08	0.02
616	603899	晨光股份	1,200	24,756.00	0.02
617	600388	龙净环保	1,700	24,735.00	0.02
618	600007	中国国贸	1,300	24,674.00	0.02
619	603816	顾家家居	1,100	24,596.00	0.02
620	605020	永和股份	600	24,432.00	0.02
621	603733	仙鹤股份	900	24,309.00	0.02
622	603833	欧派家居	800	24,088.00	0.02
623	600582	天地科技	5,400	24,030.00	0.02
624	600012	皖通高速	1,500	23,640.00	0.02
625	601997	贵阳银行	4,600	23,598.00	0.02
626	603267	鸿远电子	300	23,244.00	0.01
627	600004	白云机场	3,200	23,232.00	0.01
628	603698	航天工程	600	23,136.00	0.01
629	603826	坤彩科技	900	23,004.00	0.01
630	601975	招商南油	6,100	22,753.00	0.01
631	688561	奇安信	947	22,709.06	0.01
632	601098	中南传媒	2,300	22,632.00	0.01
633	601866	中远海发	10,000	22,100.00	0.01
634	601158	重庆水务	5,700	22,002.00	0.01
635	600131	国网信通	1,500	21,900.00	0.01
636	601187	厦门银行	3,200	21,856.00	0.01
637	603823	百合花	400	21,828.00	0.01
638	603337	杰克科技	600	21,738.00	0.01
639	600848	上海临港	2,900	21,721.00	0.01
640	688390	固德威	200	21,702.00	0.01
641	688055	龙腾光电	3,761	21,663.36	0.01

642	603226	菲林格尔	400	21,416.00	0.01
643	603936	博敏电子	800	21,368.00	0.01
644	603031	安孚科技	400	21,300.00	0.01
645	600927	永安期货	1,700	21,165.00	0.01
646	600032	浙江新能	3,000	21,150.00	0.01
647	600602	云赛智联	1,300	20,904.00	0.01
648	601228	广州港	7,400	20,868.00	0.01
649	688106	金宏气体	500	20,740.00	0.01
650	600835	上海机电	1,000	20,600.00	0.01
651	603658	安图生物	700	20,314.00	0.01
652	688208	道通科技	800	20,152.00	0.01
653	600008	首创环保	7,400	20,128.00	0.01
654	688192	迪哲医药	500	19,965.00	0.01
655	603011	合锻智能	600	19,848.00	0.01
656	600754	锦江酒店	1,100	19,789.00	0.01
657	600380	健康元	2,100	19,782.00	0.01
658	603078	江化微	400	19,768.00	0.01
659	600343	航天动力	700	19,614.00	0.01
660	600956	新天绿能	2,800	19,572.00	0.01
661	603233	大参林	1,300	19,539.00	0.01
662	603529	爱玛科技	1,000	19,510.00	0.01
663	603000	人民网	1,300	19,227.00	0.01
664	600184	光电股份	600	19,206.00	0.01
665	605389	长龄液压	200	19,200.00	0.01
666	688800	瑞可达	200	19,194.00	0.01
667	600531	豫光金铅	1,300	19,188.00	0.01
668	600151	航天机电	1,700	19,074.00	0.01
669	600435	北方导航	1,700	19,040.00	0.01
670	688169	石头科技	200	18,994.00	0.01
671	601778	晶科科技	4,400	18,920.00	0.01
672	603906	龙蟠科技	700	18,571.00	0.01
673	603355	莱克电气	700	18,466.00	0.01
674	600170	上海建工	8,300	18,426.00	0.01
675	603077	和邦生物	7,900	18,328.00	0.01
676	600820	隧道股份	3,500	18,235.00	0.01
677	601969	海南矿业	2,300	18,193.00	0.01
678	603505	金石资源	900	18,135.00	0.01
679	601369	陕鼓动力	2,000	18,100.00	0.01
680	688363	华熙生物	500	17,885.00	0.01
681	688700	东威科技	200	17,880.00	0.01
682	603997	继峰股份	1,500	17,745.00	0.01
683	600933	爱柯迪	1,200	17,736.00	0.01
684	603025	大豪科技	1,300	17,732.00	0.01

685	600366	宁波韵升	1,200	17,616.00	0.01
686	603858	步长制药	1,200	17,520.00	0.01
687	600063	皖维高新	2,300	17,480.00	0.01
688	600655	豫园股份	4,200	17,262.00	0.01
689	688625	呈和科技	200	16,882.00	0.01
690	601921	浙版传媒	2,500	16,725.00	0.01
691	600458	时代新材	1,000	16,550.00	0.01
692	603786	科博达	400	16,364.00	0.01
693	600057	厦门象屿	3,000	16,260.00	0.01
694	603052	可川科技	200	16,198.00	0.01
695	600739	辽宁成大	1,600	16,176.00	0.01
696	600623	华谊集团	2,000	16,140.00	0.01
697	603601	再升科技	1,300	15,964.00	0.01
698	603171	税友股份	400	15,940.00	0.01
699	600783	鲁信创投	800	15,936.00	0.01
700	600452	涪陵电力	1,700	15,861.00	0.01
701	603305	旭升集团	1,300	15,756.00	0.01
702	600416	湘电股份	1,600	15,680.00	0.01
703	601858	中国科传	900	15,579.00	0.01
704	601702	华峰铝业	1,100	15,510.00	0.01
705	601966	玲珑轮胎	1,500	15,285.00	0.01
706	600338	西藏珠峰	1,000	15,240.00	0.01
707	601326	秦港股份	4,800	15,168.00	0.01
708	600528	中铁工业	2,300	15,157.00	0.01
709	600120	浙江东方	3,500	15,050.00	0.01
710	600959	江苏有线	5,100	14,739.00	0.01
711	600629	华建集团	1,200	14,532.00	0.01
712	600763	通策医疗	400	13,552.00	0.01
713	600490	鹏欣资源	2,300	13,386.00	0.01
714	688380	中微半导	200	13,182.00	0.01
715	603014	威高血净	400	13,092.00	0.01
716	600367	红星发展	200	12,586.00	0.01
717	688708	佳驰科技	200	10,160.00	0.01
718	688281	华秦科技	200	10,046.00	0.01
719	688690	纳微科技	217	9,569.70	0.01
720	688206	概伦电子	200	8,874.00	0.01
721	688182	灿勤科技	200	8,614.00	0.01
722	688158	优刻得	200	7,352.00	0.00
723	688520	神州细胞	200	6,842.00	0.00
724	688100	威胜信息	200	6,118.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	000921	海信家电	25,000	683,000.00	0.44
2	300346	南大光电	1,600	148,240.00	0.09
3	002653	海思科	2,000	132,680.00	0.08
4	000725	京东方 A	15,000	130,200.00	0.08
5	002025	航天电器	1,600	121,952.00	0.08
6	002861	瀛通通讯	5,400	120,312.00	0.08
7	300613	富瀚微	1,500	120,120.00	0.08
8	002558	巨人网络	4,200	115,752.00	0.07
9	002559	亚威股份	9,100	115,661.00	0.07
10	002038	双鹭药业	19,400	115,042.00	0.07
11	002921	联诚精密	4,200	114,828.00	0.07
12	000100	TCL 科技	19,600	114,072.00	0.07
13	002517	恺英网络	6,900	112,125.00	0.07
14	301122	采纳股份	3,800	111,758.00	0.07
15	000050	深天马 A	11,200	110,992.00	0.07
16	300458	全志科技	2,800	110,488.00	0.07
17	002635	安洁科技	5,400	110,430.00	0.07
18	002386	天原股份	17,800	110,360.00	0.07
19	300327	中颖电子	3,400	108,970.00	0.07
20	002587	奥拓电子	13,900	108,559.00	0.07
21	002803	吉宏股份	4,200	108,528.00	0.07
22	300687	赛意信息	3,500	108,500.00	0.07
23	002422	科伦药业	2,800	107,856.00	0.07
24	000959	首钢股份	30,500	107,055.00	0.07
25	300842	帝科股份	1,200	107,004.00	0.07
26	300412	迦南科技	23,400	106,704.00	0.07
27	002833	弘亚数控	5,500	106,095.00	0.07
28	002979	雷赛智能	1,900	105,982.00	0.07
29	002876	三利谱	3,000	105,630.00	0.07
30	002294	信立泰	3,300	105,237.00	0.07
31	002541	鸿路钢构	6,000	103,920.00	0.07
32	002810	山东赫达	4,200	103,740.00	0.07
33	002845	同兴达	6,300	103,320.00	0.07
34	000404	长虹华意	13,100	102,966.00	0.07
35	300022	吉峰科技	13,200	102,564.00	0.07
36	300602	飞荣达	2,000	102,400.00	0.07
37	002001	新和成	3,600	102,312.00	0.07
38	000739	普洛药业	6,100	101,626.00	0.06
39	300006	莱美药业	19,800	101,574.00	0.06
40	002237	恒邦股份	6,900	101,361.00	0.06

41	000026	飞亚达	4,700	101,238.00	0.06
42	002136	安纳达	7,700	100,716.00	0.06
43	002851	麦格米特	600	100,308.00	0.06
44	002841	视源股份	2,900	100,137.00	0.06
45	002064	华峰化学	10,500	99,645.00	0.06
46	300772	运达股份	8,100	99,630.00	0.06
47	002084	海鸥住工	28,500	99,180.00	0.06
48	300404	博济医药	11,300	98,988.00	0.06
49	001314	亿道信息	1,600	98,880.00	0.06
50	300496	中科创达	1,600	98,864.00	0.06
51	002615	哈尔斯	14,300	98,670.00	0.06
52	301358	湖南裕能	1,300	98,631.00	0.06
53	002539	云图控股	8,700	98,484.00	0.06
54	300569	天能重工	20,300	97,846.00	0.06
55	000949	新乡化纤	15,400	97,636.00	0.06
56	300016	北陆药业	12,700	97,409.00	0.06
57	002439	启明星辰	7,700	97,405.00	0.06
58	002271	东方雨虹	8,200	97,334.00	0.06
59	000045	深纺织 A	9,200	96,968.00	0.06
60	002293	罗莱生活	9,800	96,922.00	0.06
61	002923	润都股份	10,200	96,492.00	0.06
62	301265	华新科技	3,500	96,425.00	0.06
63	300339	润和软件	2,500	96,275.00	0.06
64	300454	深信服	1,000	96,200.00	0.06
65	300890	翔丰华	2,900	96,193.00	0.06
66	002449	国星光电	12,400	96,100.00	0.06
67	003021	兆威机电	1,100	96,085.00	0.06
68	301031	中熔电气	800	95,560.00	0.06
69	002090	金智科技	10,800	95,472.00	0.06
70	002391	长青股份	19,500	94,965.00	0.06
71	300856	科思股份	8,900	94,874.00	0.06
72	300067	安诺其	17,500	94,850.00	0.06
73	002829	星网宇达	5,400	94,824.00	0.06
74	001212	中旗新材	2,000	94,760.00	0.06
75	002724	海洋王	19,500	94,575.00	0.06
76	301246	宏源药业	3,500	94,150.00	0.06
77	300306	远方信息	9,700	94,090.00	0.06
78	000932	华菱钢铁	27,100	94,037.00	0.06
79	003038	鑫铂股份	8,300	93,873.00	0.06
80	002152	广电运通	10,000	93,800.00	0.06
81	002641	公元股份	24,300	93,798.00	0.06
82	300855	图南股份	3,000	93,780.00	0.06
83	000421	南京公用	18,900	93,744.00	0.06

84	002037	保利联合	15,000	93,600.00	0.06
85	002242	九阳股份	11,900	93,534.00	0.06
86	002344	海宁皮城	26,700	93,450.00	0.06
87	301206	三元生物	4,200	93,366.00	0.06
88	300904	威力传动	2,300	93,357.00	0.06
89	001266	宏英智能	1,900	93,290.00	0.06
90	001286	陕西能源	9,200	93,288.00	0.06
91	000990	诚志股份	11,400	93,252.00	0.06
92	002274	华昌化工	20,100	93,063.00	0.06
93	300738	奥飞数据	4,600	93,012.00	0.06
94	002877	智能自控	13,200	92,928.00	0.06
95	002111	威海广泰	10,300	92,700.00	0.06
96	000338	潍柴动力	3,400	92,650.00	0.06
97	001283	豪鹏科技	1,890	92,647.80	0.06
98	002396	星网锐捷	4,830	92,591.10	0.06
99	002702	海欣食品	20,800	92,560.00	0.06
100	300034	钢研高纳	5,400	92,556.00	0.06
101	300369	绿盟科技	17,000	92,480.00	0.06
102	000883	湖北能源	21,400	92,448.00	0.06
103	002022	科华生物	20,100	92,058.00	0.06
104	300575	中旗股份	18,700	92,004.00	0.06
105	002531	天顺风能	10,900	91,887.00	0.06
106	002909	集泰股份	18,600	91,884.00	0.06
107	300823	建科智能	6,300	91,854.00	0.06
108	002412	汉森制药	16,700	91,850.00	0.06
109	002922	伊戈尔	2,800	91,840.00	0.06
110	002238	天威视讯	17,000	91,800.00	0.06
111	300407	凯发电气	8,500	91,800.00	0.06
112	300568	星源材质	4,900	91,728.00	0.06
113	300691	联合光电	5,800	91,698.00	0.06
114	000822	山东海化	22,800	91,656.00	0.06
115	002302	西部建设	21,200	91,584.00	0.06
116	300797	钢研纳克	6,900	91,494.00	0.06
117	002408	齐翔腾达	19,500	91,455.00	0.06
118	000790	华神科技	26,200	91,438.00	0.06
119	300031	宝通科技	3,200	91,424.00	0.06
120	300512	中亚股份	13,400	91,388.00	0.06
121	300073	当升科技	1,900	91,276.00	0.06
122	002947	恒铭达	1,200	91,260.00	0.06
123	300933	中辰股份	15,000	91,200.00	0.06
124	301500	飞南资源	3,500	91,175.00	0.06
125	002998	优彩资源	14,000	91,140.00	0.06
126	301041	金百泽	2,700	91,125.00	0.06

127	000877	天山股份	25,100	91,113.00	0.06
128	002448	中原内配	7,400	91,020.00	0.06
129	002660	茂硕电源	14,000	91,000.00	0.06
130	300598	诚迈科技	3,200	90,880.00	0.06
131	000039	中集集团	11,200	90,832.00	0.06
132	002337	赛象科技	20,500	90,815.00	0.06
133	002154	报喜鸟	25,500	90,780.00	0.06
134	300789	唐源电气	5,100	90,627.00	0.06
135	300590	移为通信	6,300	90,405.00	0.06
136	002392	北京利尔	11,200	90,384.00	0.06
137	300885	海昌新材	3,800	90,326.00	0.06
138	000565	渝三峡 A	15,900	90,312.00	0.06
139	002863	今飞凯达	21,300	90,312.00	0.06
140	002045	国光电器	11,500	90,275.00	0.06
141	300955	嘉亨家化	2,500	90,225.00	0.06
142	301062	上海艾录	15,800	90,218.00	0.06
143	300591	万里马	13,400	90,182.00	0.06
144	000628	高新发展	1,900	90,060.00	0.06
145	002752	昇兴股份	16,300	89,976.00	0.06
146	002010	传化智联	20,100	89,847.00	0.06
147	002054	德美化工	13,500	89,775.00	0.06
148	000951	中国重汽	4,600	89,746.00	0.06
149	300732	设研院	16,100	89,677.00	0.06
150	300447	全信股份	6,000	89,580.00	0.06
151	301510	固高科技	2,800	89,404.00	0.06
152	000027	深圳能源	14,400	89,280.00	0.06
153	300206	理邦仪器	7,300	89,279.00	0.06
154	002545	东方铁塔	5,500	89,210.00	0.06
155	002135	东南网架	13,100	88,949.00	0.06
156	002838	道恩股份	2,900	88,798.00	0.06
157	300681	英搏尔	3,100	88,722.00	0.06
158	300337	银邦股份	7,600	88,616.00	0.06
159	002578	闽发铝业	28,100	88,515.00	0.06
160	300432	富临精工	4,400	88,396.00	0.06
161	002706	良信股份	8,100	88,371.00	0.06
162	000852	石化机械	17,800	88,288.00	0.06
163	002532	天山铝业	8,200	87,986.00	0.06
164	002034	旺能环境	5,800	87,870.00	0.06
165	301516	中远通	6,200	87,730.00	0.06
166	002591	恒大高新	14,300	87,516.00	0.06
167	300919	中伟新材	2,000	87,500.00	0.06
168	300490	华自科技	6,600	87,318.00	0.06
169	000090	天健集团	29,000	87,290.00	0.06

170	002429	兆驰股份	8,400	87,276.00	0.06
171	300504	天邑股份	5,400	87,102.00	0.06
172	300552	万集科技	3,800	86,830.00	0.06
173	300968	格林精密	9,000	86,760.00	0.06
174	300422	博世科	20,600	86,726.00	0.06
175	301121	紫建电子	2,700	86,454.00	0.06
176	301487	盟固利	4,500	86,175.00	0.05
177	300450	先导智能	2,100	85,512.00	0.05
178	300424	航新科技	5,400	84,996.00	0.05
179	001215	千味央厨	2,300	84,870.00	0.05
180	001332	锡装股份	2,100	82,467.00	0.05
181	000426	兴业银锡	2,500	82,400.00	0.05
182	300779	惠城环保	1,600	80,320.00	0.05
183	300872	天阳科技	5,000	79,000.00	0.05
184	300522	世名科技	2,600	62,322.00	0.04
185	002068	黑猫股份	3,800	57,114.00	0.04
186	300861	美畅股份	1,600	40,304.00	0.03
187	003031	中瓷电子	200	36,060.00	0.02
188	002203	海亮股份	1,300	29,705.00	0.02
189	002432	九安医疗	400	28,272.00	0.02
190	002283	天润工业	2,700	26,055.00	0.02
191	002768	国恩股份	144	7,496.64	0.00
192	301051	信濠光电	60	1,164.00	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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入 金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601288	农业银行	8,271,091.99	5.27
2	601398	工商银行	7,707,069.00	4.91
3	601857	中国石油	7,541,230.00	4.80
4	600519	贵州茅台	5,824,774.40	3.71
5	601988	中国银行	5,452,740.00	3.47
6	601628	中国人寿	3,871,697.50	2.47
7	601138	工业富联	3,801,642.00	2.42
8	601088	中国神华	3,398,729.00	2.17
9	601899	紫金矿业	3,315,346.00	2.11
10	601658	邮储银行	3,195,769.00	2.04
11	600036	招商银行	3,069,909.00	1.96
12	600028	中国石化	3,002,288.00	1.91
13	601318	中国平安	2,950,131.00	1.88

14	600900	长江电力	2,827,334.71	1.80
15	601728	中国电信	2,780,960.00	1.77
16	688041	海光信息	2,685,324.25	1.71
17	601225	陕西煤业	2,557,560.00	1.63
18	601998	中信银行	2,318,950.00	1.48
19	601601	中国太保	2,292,572.00	1.46
20	601898	中煤能源	2,244,922.40	1.43

注：本项买入金额均按买入成交金额(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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出 金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601288	农业银行	3,529,618.00	2.25
2	601398	工商银行	3,331,073.00	2.12
3	601857	中国石油	3,018,652.00	1.92
4	601988	中国银行	2,579,859.00	1.64
5	600487	亨通光电	2,464,339.00	1.57
6	601658	邮储银行	2,129,704.00	1.36
7	601225	陕西煤业	2,083,357.00	1.33
8	601628	中国人寿	1,995,892.00	1.27
9	600519	贵州茅台	1,944,906.00	1.24
10	600498	烽火通信	1,851,140.00	1.18
11	601899	紫金矿业	1,844,197.00	1.17
12	601898	中煤能源	1,792,339.00	1.14
13	601728	中国电信	1,788,134.00	1.14
14	601318	中国平安	1,735,172.00	1.11
15	601601	中国太保	1,694,651.00	1.08
16	600028	中国石化	1,645,887.00	1.05
17	601168	西部矿业	1,585,996.00	1.01
18	601088	中国神华	1,560,782.00	0.99
19	688378	奥来德	1,529,370.35	0.97
20	601998	中信银行	1,484,950.88	0.95

注：本项卖出金额均按卖出成交金额(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	484,493,700.45
卖出股票收入（成交）总额	349,502,051.99

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

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包含国债期货，无相关投资政策。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

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

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

无。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,399,605.60
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	786,178.86
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	2,185,784.46

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
兴银上证综合指数增强 A	521	64,642.24	—	—	33,678,604.57	100.00%
兴银上证	2,640	47,262.53	1,480,181.88	1.19%	123,292,892.71	98.81%

综合指数 增强 C						
合计	3,161	50,127.07	1,480,181.88	0.93%	156,971,497.28	99.07%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有 本基金	兴银上证综合指数增强 A	3.00	0.00%
	兴银上证综合指数增强 C	101,002.14	0.08%
	合计	101,005.14	0.06%

注：份额占比为四舍五入后的结果。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投 资和研究部门负责人持有本开 放式基金	兴银上证综合指数增强 A	0
	兴银上证综合指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式 基金	兴银上证综合指数增强 A	0
	兴银上证综合指数增强 C	10~50
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	兴银上证综合指数增强 A	兴银上证综合指数增强 C
基金合同生效日（2026 年 03 月 23 日）基金 份额总额	65,495,170.14	291,035,442.80
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购 份额	1,247,702.01	28,248,309.26
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总 赎回份额	33,064,267.58	194,510,677.47
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	33,678,604.57	124,773,074.59

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 2026 年 5 月 15 日，张庄波担任基金管理人督察长，吴真子不再担任基金管理人督察长。

(2) 报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、公募基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

无。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：报告期内，本基金托管人在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：报告期内，本基金托管人相关从业人员在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	佣金	占当期佣金	

			成交总额的 比例		总量的比例	
华福证 券	2	833,995,752.44	100.00%	216,844.53	100.00%	-

注：基金租用证券公司交易单元的选择标准是：

（一）财务状况良好，经审计的最近一年年报中资产、经营情况需满足下列条件之一：

- 1、总资产 100 亿元以上；
- 2、净资产 20 亿元以上；
- 3、营业收入 10 亿元以上；
- 4、净资本 20 亿元以上。

（二）经营行为规范、合规风控能力较强，近三年内研究、交易业务无重大违法违规记录。

（三）研究团队具备丰富的产业研究经验与资源，能够为基金业务提供较高质量的研究服务。

（四）交易系统完善，交易链路安全、稳健、性能高，可为多种类型机构提供交易服务，能及时响应交易系统需求。

选择程序是：公司对拟选择参与证券交易的证券公司开展尽职调查，对其财务状况、经营行为、合规风控、研究服务、交易服务等进行评估，并出具证券公司参与证券交易准入评估报告。证券公司准入评估事项经审批后，办理协议签署等事宜。

本报告期内本基金租用证券公司交易单元变更情况如下：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	兴银上证综合指数增强型证券投资基金基金份额发售公告	证监会规定报刊和网站	2026-02-11
2	兴银上证综合指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	证监会规定报刊和网站	2026-03-24
3	兴银上证综合指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	证监会规定报刊和网站	2026-04-28
4	兴银基金管理有限责任公司关于督察长变更的公告	证监会规定报刊和网站	2026-05-16

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期内单一投资者持有基金份额比例未出现超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予基金募集注册的文件
2. 《兴银上证综合指数增强型证券投资基金基金合同》
3. 《兴银上证综合指数增强型证券投资基金托管协议》
4. 《兴银上证综合指数增强型证券投资基金招募说明书》
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照
6. 报告期内在指定信息披露媒体上公开披露的各项公告
7. 中国证监会规定的其他备查文件

12.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处。

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。投资者对本报告书如有疑问，可拨打客服电话（40000-96326）咨询本基金管理人。

兴银基金管理有限责任公司

二〇二六年八月三十一日