

兴银创业板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31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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	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)	14
6.1 资产负债表	14
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	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	62
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	62
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	62
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	62
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	62
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63

7.12 投资组合报告附注	63
§ 8 基金份额持有人信息	64
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	64
§ 9 开放式基金份额变动	64
§ 10 重大事件揭示	65
10.1 基金份额持有人大会决议	65
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
10.4 基金投资策略的改变	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	65
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	65
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	66
10.8 其他重大事件	67
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	67
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	67
§ 12 备查文件目录	67
12.1 备查文件目录	67
12.2 存放地点	67
12.3 查阅方式	68

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴银创业板综合指数增强型证券投资基金	
基金简称	兴银创业板综合指数增强	
基金主代码	026692	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026 年 03 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	
报告期末基金份额总额	362,840,658.43 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	兴银创业板综合指数增强 A	兴银创业板综合指数增强 C
下属分级基金的交易代码	026692	026693
报告期末下属分级基金的份 额总额	64,784,343.46 份	298,056,314.97 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。本基金主要投资于创业板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	创业板综合指数收益率 $\times$ 95%+银行人民币活期存款利率（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。	
	兴银创业板综合指数增强 A	兴银创业板综合指数增强 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	证券时报
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31日（基金合同生效日）-2026年06月30日）	
	兴银创业板综合指数增强 A	兴银创业板综合指数增强 C
本期已实现收益	6,295,183.31	29,295,298.14
本期利润	9,521,260.97	45,388,658.58
加权平均基金份额本期利润	0.0768	0.0796
本期加权平均净值利润率	7.43%	7.70%
本期基金份额净值增长率	8.98%	8.92%

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	3,894,127.29	17,758,090.01
期末可供分配基金份额利润	0.0601	0.0596
期末基金资产净值	70,600,153.10	324,653,512.36
期末基金份额净值	1.0898	1.0892
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	8.98%	8.92%

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

兴银创业板综合指数增强 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	8.98%	1.34%	23.45%	1.85%	-14.47%	-0.51%
自基金合同生效起至今	8.98%	1.33%	20.70%	1.87%	-11.72%	-0.54%

兴银创业板综合指数增强 C 净值表现

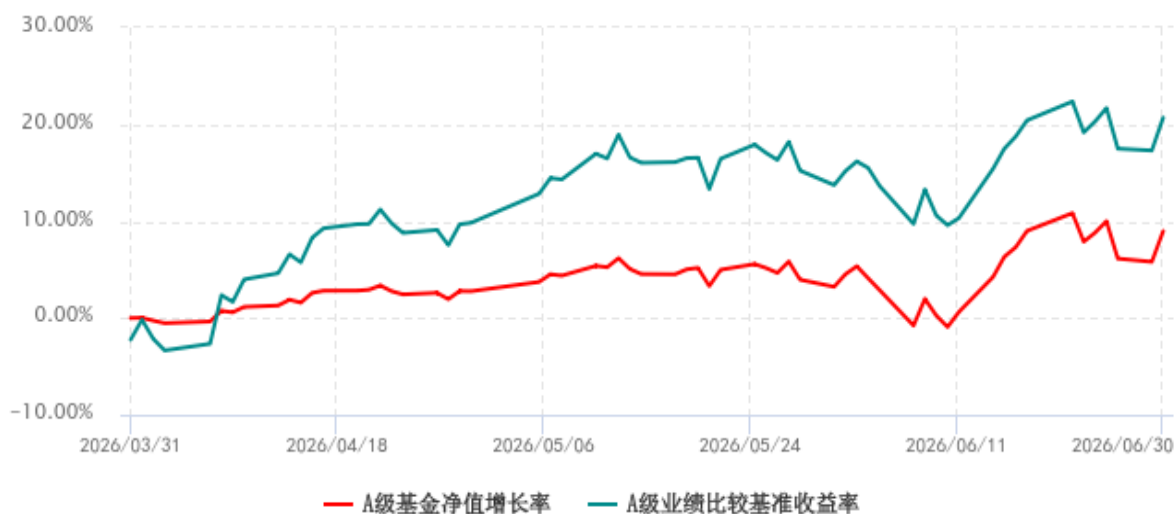
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	8.92%	1.34%	23.45%	1.85%	-14.53%	-0.51%
自基金合同生效起至今	8.92%	1.33%	20.70%	1.87%	-11.78%	-0.54%

注：1、本基金成立于 2026 年 3 月 31 日；

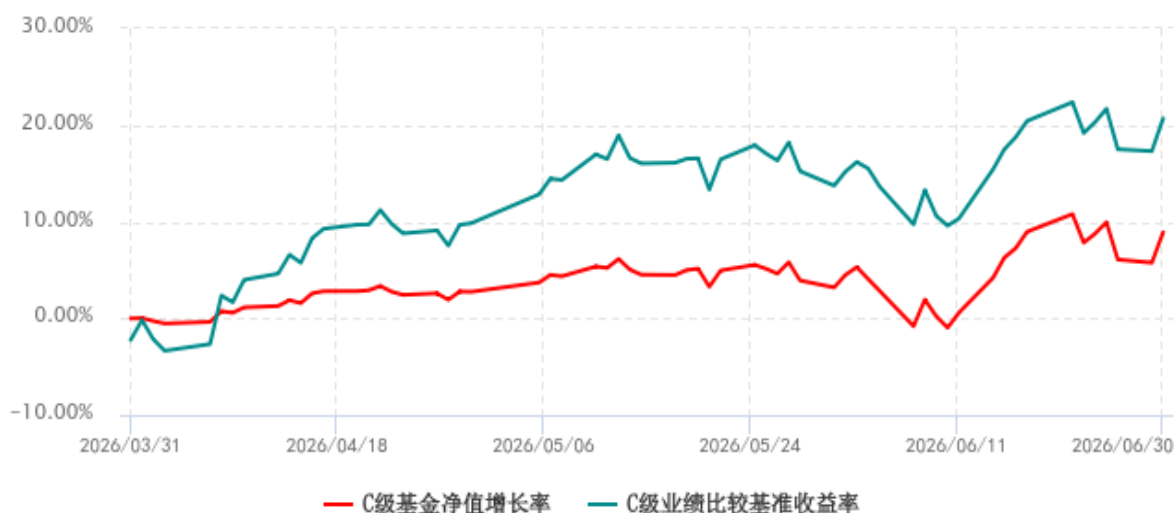
2、比较基准：创业板综合指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。

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

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31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31日-2026年06月30日)



注：1、本基金成立于 2026 年 3 月 31 日；
2、比较基准：创业板综合指数收益率 $\times$ 95%+银行人民币活期存款利率（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、公司指数与量化投资部副总经理（主持工作）	2026-03-31	-	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。
林学晨	本基金的基金经理	2026-03-31	-	12 年	硕士研究生，特许金融分析师（CFA），具有基金从业资格。曾任湘财证券研究所金融工程分析师。2015 年 7 月加入兴银基金管理有限责任公司，历任中央交易室衍生品交易员、衍生品业务部投资经理助理、投资经理；现任指数与量化投资部副总经理（主持工作）、基金经理。

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

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人按照法律法规关于公平交易的相关规定，严格执行公司公平交易管理制度，加强了对所管理的不同投资组合间向交易价差的分析，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。在市场风格分化较为剧烈的情况下，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

截至报告期末兴银创业板综合指数增强 A 基金份额净值为 1.0898 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 8.98%，同期业绩比较基准收益率为 20.70%；截至报告期末兴银创业板综合指数增强 C 基金份额净值为 1.0892 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 8.92%，同期业绩比较基准收益率为 20.70%。

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

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：兴银创业板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	1,052,033.64
结算备付金		26,943,629.27
存出保证金		845,654.40
交易性金融资产	6.4.7.2	368,775,201.76
其中：股票投资		368,775,201.76
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		1,186,401.34
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.5	—
资产总计		398,802,920.41
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		3,040,481.90
应付管理人报酬		335,786.07
应付托管费		41,973.26

应付销售服务费		69,014.00
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	61,999.72
负债合计		3,549,254.95
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	362,840,658.43
未分配利润	6.4.7.8	32,413,007.03
净资产合计		395,253,665.46
负债和净资产总计		398,802,920.41

注：1、报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 362,840,658.43 份。其中兴银创业板综合指数增强 A 基金份额净值 1.0898 元，基金份额总额 64,784,343.46 份；兴银创业板综合指数增强 C 基金份额净值 1.0892 元，基金份额总额 298,056,314.97 份。

2、本基金于 2026 年 03 月 31 日成立，本财务报表的实际编制期间为 2026 年 03 月 31 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：兴银创业板综合指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 03 月 31 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 31 日（基金合同 生效日）至 2026 年 06 月 30 日
一、营业总收入		56,876,294.88
1. 利息收入		234,084.83
其中：存款利息收入	6.4.7.9	234,084.83
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）		37,319,056.45
其中：股票投资收益	6.4.7.10	37,919,504.98
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	-2,273,131.87
股利收益	6.4.7.15	1,672,683.34

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	19, 319, 438. 10
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 17	3, 715. 50
减：二、营业总支出		1, 966, 375. 33
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	1, 430, 446. 20
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	178, 805. 80
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	293, 754. 30
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		169. 31
8. 其他费用	6. 4. 7. 19	63, 199. 72
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		54, 909, 919. 55
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		54, 909, 919. 55
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		54, 909, 919. 55

6.3 净资产变动表

会计主体：兴银创业板综合指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 03 月 31 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 31 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	795, 387, 978. 74	-	795, 387, 978. 74
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-432, 547, 320. 31	32, 413, 007. 03	-400, 134, 313. 28
（一）、综合收益总额	-	54, 909, 919. 55	54, 909, 919. 55
（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）	-432, 547, 320. 31	-22, 496, 912. 52	-455, 044, 232. 83
其中：1. 基金申购款	17, 618, 158. 76	858, 197. 65	18, 476, 356. 41
2. 基金赎回款	-450, 165, 479. 07	-23, 355, 110. 17	-473, 520, 589. 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	362, 840, 658. 43	32, 413, 007. 03	395, 253, 665. 46

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

兴银创业板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〔2025〕2999 号注册募集。《兴银创业板综合指数增强型证券投资基金基金合同》于 2026 年 3 月 31 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 795,387,978.74 份基金份额。本基金的基金管理人为兴银基金管理有限公司,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《兴银创业板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:创业板综合指数收益率 $\times$ 95%+银行人民币活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金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 31 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 31 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	1,052,033.64
等于：本金	1,051,317.30
加：应计利息	716.34
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	1,052,033.64

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	349,610,003.66	-	368,775,201.76	19,165,198.10
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	349,610,003.66	-	368,775,201.76	19,165,198.10

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	6,892,880.00	-	-	-
——股指期货	6,892,880.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	6,892,880.00	-	-	-

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
IC2607	IC2607	2	3,571,280.00	122,320.00
IM2607	IM2607	2	3,475,840.00	31,920.00
合计				154,240.00
减：可抵销期货暂收款				154,240.00
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	61,999.72
合计	61,999.72

6.4.7.7 实收基金**兴银创业板综合指数增强 A**

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 03 月 31 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	142,176,928.52	142,176,928.52
本期申购	2,312,179.20	2,312,179.20
本期赎回（以“-”号填列）	-79,704,764.26	-79,704,764.26
本期末	64,784,343.46	64,784,343.46

兴银创业板综合指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 03 月 31 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	653,211,050.22	653,211,050.22
本期申购	15,305,979.56	15,305,979.56

本期赎回（以“-”号填列）	-370,460,714.81	-370,460,714.81
本期末	298,056,314.97	298,056,314.97

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

兴银创业板综合指数增强 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	6,295,183.31	3,226,077.66	9,521,260.97
本期基金份额交易产生的变动数	-2,401,056.02	-1,304,395.31	-3,705,451.33
其中：基金申购款	106,878.69	30,601.81	137,480.50
基金赎回款	-2,507,934.71	-1,334,997.12	-3,842,931.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,894,127.29	1,921,682.35	5,815,809.64

兴银创业板综合指数增强 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	29,295,298.14	16,093,360.44	45,388,658.58
本期基金份额交易产生的变动数	-11,537,208.13	-7,254,253.06	-18,791,461.19
其中：基金申购款	600,615.12	120,102.03	720,717.15
基金赎回款	-12,137,823.25	-7,374,355.09	-19,512,178.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	17,758,090.01	8,839,107.38	26,597,197.39

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 03 月 31 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	197,099.00
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	36,985.83
其他	-
合计	234,084.83

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 31 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	1,764,320,937.63
减：卖出股票成本总额	1,724,522,225.91
减：交易费用	1,879,206.74
买卖股票差价收入	37,919,504.98

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 31 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
股指期货投资收益	-2,262,400.00
减：其他衍生工具收益应缴纳增值税	1,410.87
减：交易费用	9,321.00
合计	-2,273,131.87

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 03 月 31 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	1,672,683.34

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	1,672,683.34

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 31 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	19,165,198.10
——股票投资	19,165,198.10
——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	154,240.00
——权证投资	-
——期货投资	154,240.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	19,319,438.10

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 03 月 31 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	3,715.50
合计	3,715.50

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 31 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	11,999.56
信息披露费	50,000.16
证券出借违约金	-
证券账户开户费	1,200.00

合计	63,199.72
----	-----------

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
国脉科技股份有限公司(以下简称“国脉科技”)	基金管理人的股东
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

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期末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：本基金本报告期末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：本基金本报告期末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

注：本基金本报告期末无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 03 月 31 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	1,430,446.20
其中：应支付销售机构的客户维护费	714,976.19
应支付基金管理人的净管理费	715,470.01

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 31 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	178,805.80

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 31 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		
	兴银创业板综合指数增强 A	兴银创业板综合指数增强 C	合计
兴业银行	-	263,929.50	263,929.50
合计	-	263,929.50	263,929.50

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 31 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	1,052,033.64	197,099.00

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
300214	日科化学	2026-06-29	重大事项停牌	10.25	2026-07-13	-	35,100	262,484.07	359,775.00	-

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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度的证券，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	1,052,033.64	-	-	-	-	-	1,052,033.64
结算备付金	26,943,629.27	-	-	-	-	-	26,943,629.27
存出保证金	845,654.40	-	-	-	-	-	845,654.40

							0
交易性金融资产	-	-	-	-	-	368,775,201.76	368,775,201.76
应收申购款	-	-	-	-	-	1,186,401.34	1,186,401.34
资产总计	28,841,317.31	-	-	-	-	369,961,603.10	369,961,603.10
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,040.48	3,040.48

						1.90	0 4 0 , 4 8 1 . 9 0
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	335, 786. 07	3 3 5 , 7 8 6 . 0 7
应付托管费	-	-	-	-	-	41,9 73.2 6	4 1 , 9 7 3 . 2 6
应付销售服务费	-	-	-	-	-	69,0 14.0 0	6 9 , 0 1 4 . 0 0
其他负债	-	-	-	-	-	61,9 99.7 2	6 1 , 9 9 . 7 2

							· 7 2
负债总计	-	-	-	-	-	3, 54 9, 25 4. 95	3 , 5 4 9 , 2 5 4 · 9 5
利率敏感度缺 口	28, 841, 317 . 31	-	-	-	-	366, 412, 348. 15	3 9 5 , 2 5 3 , 6 6 5 · 4 6

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	368,775,201.76	93.30
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	368,775,201.76	93.30

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%	26,663,842.39
	沪深 300 指数下跌 5%	-26,663,842.39

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	368,415,426.76
第二层次	359,775.00
第三层次	—
合计	368,775,201.76

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。

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 2025 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	368,775,201.76	92.47
	其中：股票	368,775,201.76	92.47
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	27,995,662.91	7.02
8	其他各项资产	2,032,055.74	0.51

9	合计	398,802,920.41	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	2,132,395.60	0.54
B	采矿业	238,741.00	0.06
C	制造业	303,570,627.14	76.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	651,612.00	0.16
E	建筑业	323,291.00	0.08
F	批发和零售业	6,574,413.00	1.66
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	30,419,863.78	7.70
J	金融业	8,820,249.00	2.23
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,870,324.00	0.47
M	科学研究和技术服务业	8,430,099.24	2.13
N	水利、环境和公共设施管理业	2,214,229.00	0.56
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	58,395.00	0.01
Q	卫生和社会工作	1,824,452.00	0.46
R	文化、体育和娱乐业	1,646,510.00	0.42
S	综合	-	-
	合计	368,775,201.76	93.30

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

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票投资。

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	300750	宁德时代	88,600	34,820,686.00	8.81
2	300308	中际旭创	23,100	29,337,000.00	7.42
3	300502	新易盛	26,040	15,806,280.00	4.00

4	300394	天孚通信	22,420	6,786,085.60	1.72
5	300408	三环集团	38,450	6,417,305.00	1.62
6	300476	胜宏科技	17,800	6,166,454.00	1.56
7	300059	东方财富	275,200	5,608,576.00	1.42
8	300433	蓝思科技	102,100	5,478,686.00	1.39
9	300274	阳光电源	32,600	5,184,052.00	1.31
10	301308	江波龙	5,800	4,082,040.00	1.03
11	300604	长川科技	9,900	3,380,058.00	0.86
12	300857	协创数据	9,900	3,365,010.00	0.85
13	300760	迈瑞医疗	24,600	3,341,418.00	0.85
14	300124	汇川技术	49,000	3,250,170.00	0.82
15	301200	大族数控	8,600	3,101,590.00	0.78
16	300014	亿纬锂能	42,700	2,776,781.00	0.70
17	300590	移为通信	192,900	2,768,115.00	0.70
18	300442	润泽科技	33,100	2,749,617.00	0.70
19	300475	香农芯创	9,100	2,730,000.00	0.69
20	301165	锐捷网络	26,820	2,157,669.00	0.55
21	300033	同花顺	8,800	2,120,800.00	0.54
22	300223	北京君正	8,500	2,115,650.00	0.54
23	300757	罗博特科	3,300	2,042,700.00	0.52
24	300136	信维通信	16,500	1,967,625.00	0.50
25	300620	光库科技	4,900	1,853,180.00	0.47
26	300285	国瓷材料	17,000	1,754,060.00	0.44
27	300661	圣邦股份	11,900	1,707,412.00	0.43
28	300373	扬杰科技	10,700	1,682,361.00	0.43
29	300666	江丰电子	4,400	1,621,840.00	0.41
30	301217	铜冠铜箔	9,400	1,551,658.00	0.39
31	300450	先导智能	38,103	1,551,554.16	0.39
32	300054	鼎龙股份	14,600	1,547,162.00	0.39
33	300548	长芯博创	5,400	1,501,200.00	0.38
34	300316	晶盛机电	24,300	1,467,720.00	0.37
35	300498	温氏股份	117,250	1,444,520.00	0.37
36	301358	湖南裕能	18,800	1,426,356.00	0.36
37	300567	精测电子	4,400	1,397,440.00	0.35
38	300395	菲利华	10,100	1,350,673.00	0.34
39	300390	天华新能	13,900	1,299,789.00	0.33
40	301526	国际复材	27,700	1,292,759.00	0.33
41	300015	爱尔眼科	155,700	1,286,082.00	0.33
42	301269	华大九天	10,700	1,277,794.00	0.32
43	300672	国科微	4,100	1,209,500.00	0.31
44	300346	南大光电	12,800	1,185,920.00	0.30
45	300803	指南针	11,900	1,090,873.00	0.28
46	300919	中伟新材	24,400	1,067,500.00	0.27

47	301511	德福科技	7,300	1,050,105.00	0.27
48	301377	鼎泰高科	1,900	1,046,710.00	0.26
49	300751	迈为股份	3,700	1,045,102.00	0.26
50	300115	长盈精密	36,800	1,028,192.00	0.26
51	300236	上海新阳	7,800	1,025,700.00	0.26
52	300870	欧陆通	2,900	1,002,501.00	0.25
53	300037	新宙邦	10,400	965,640.00	0.24
54	300782	卓胜微	8,666	949,620.28	0.24
55	300432	富临精工	47,200	948,248.00	0.24
56	300438	鹏辉能源	11,400	944,490.00	0.24
57	300024	机器人	47,600	920,108.00	0.23
58	300058	蓝色光标	66,400	913,664.00	0.23
59	300207	欣旺达	48,100	913,419.00	0.23
60	300570	太辰光	3,700	912,827.00	0.23
61	300418	昆仑万维	22,400	904,064.00	0.23
62	300458	全志科技	22,720	896,531.20	0.23
63	301396	宏景科技	2,700	895,320.00	0.23
64	300972	万辰集团	5,100	884,391.00	0.22
65	300017	网宿科技	67,100	872,971.00	0.22
66	300339	润和软件	22,178	854,074.78	0.22
67	300763	锦浪科技	9,400	849,290.00	0.21
68	300454	深信服	8,600	827,320.00	0.21
69	300489	光智科技	2,600	811,070.00	0.21
70	300456	赛微电子	18,300	777,201.00	0.20
71	300759	康龙化成	26,500	766,645.00	0.19
72	300073	当升科技	15,500	744,620.00	0.19
73	300102	乾照光电	28,400	739,536.00	0.19
74	300814	中富电路	3,600	736,200.00	0.19
75	301536	星辰科技	5,700	733,647.00	0.19
76	300568	星源材质	38,900	728,208.00	0.18
77	300001	特锐德	19,200	726,336.00	0.18
78	301297	富乐德	11,800	722,632.00	0.18
79	300953	震裕科技	5,400	721,980.00	0.18
80	300765	石药创新	26,100	710,703.00	0.18
81	300496	中科创达	11,500	710,585.00	0.18
82	300776	帝尔激光	3,300	709,368.00	0.18
83	300201	海伦哲	33,200	699,524.00	0.18
84	300806	斯迪克	6,100	683,200.00	0.17
85	300602	飞荣达	12,800	655,360.00	0.17
86	300738	奥飞数据	32,300	653,106.00	0.17
87	300398	飞凯材料	10,500	648,375.00	0.16
88	300012	华测检测	46,600	645,876.00	0.16
89	300748	金力永磁	20,900	644,765.00	0.16

90	300979	华利集团	21,600	642,600.00	0.16
91	300623	捷捷微电	14,000	629,860.00	0.16
92	302132	中航成飞	10,800	629,856.00	0.16
93	301238	瑞泰新材	25,400	619,760.00	0.16
94	301236	软通动力	14,400	611,280.00	0.15
95	300613	富瀚微	7,500	600,600.00	0.15
96	300903	科翔股份	5,900	597,729.00	0.15
97	301018	申菱环境	5,100	589,611.00	0.15
98	300866	安克创新	5,600	585,200.00	0.15
99	300166	东方国信	32,800	580,888.00	0.15
100	300811	铂科新材	6,100	578,829.00	0.15
101	300888	稳健医疗	20,600	576,594.00	0.15
102	301316	慧博云通	14,200	559,196.00	0.14
103	300773	拉卡拉	36,260	554,778.00	0.14
104	300251	光线传媒	49,800	552,282.00	0.14
105	301127	武汉天源	25,700	532,504.00	0.13
106	300676	华大基因	15,174	532,000.44	0.13
107	300607	拓斯达	12,900	531,867.00	0.13
108	300693	盛弘股份	10,800	526,500.00	0.13
109	301031	中熔电气	4,400	525,580.00	0.13
110	300088	长信科技	44,800	519,680.00	0.13
111	300957	贝泰妮	16,400	516,764.00	0.13
112	300832	新产业	12,300	516,600.00	0.13
113	300762	上海瀚讯	11,300	515,845.00	0.13
114	300457	赢合科技	24,300	512,244.00	0.13
115	300593	新雷能	17,000	511,020.00	0.13
116	300576	容大感光	9,900	507,078.00	0.13
117	300969	恒帅股份	5,360	502,553.60	0.13
118	300034	钢研高纳	29,300	502,202.00	0.13
119	301205	联特科技	1,500	501,150.00	0.13
120	300296	利亚德	89,300	500,080.00	0.13
121	300747	锐科激光	9,400	499,046.00	0.13
122	300253	卫宁健康	73,300	493,309.00	0.12
123	301216	万凯新材	21,300	489,687.00	0.12
124	300718	长盛轴承	8,000	487,760.00	0.12
125	300257	开山股份	16,800	481,824.00	0.12
126	300229	拓尔思	34,800	480,936.00	0.12
127	300347	泰格医药	10,000	480,000.00	0.12
128	300790	宇瞳光学	18,300	477,813.00	0.12
129	300687	赛意信息	15,400	477,400.00	0.12
130	300558	贝达药业	7,300	475,011.00	0.12
131	300007	汉威科技	12,400	473,680.00	0.12
132	300842	帝科股份	5,300	472,601.00	0.12

133	301611	珂玛科技	2,600	468,182.00	0.12
134	300327	中颖电子	14,400	461,520.00	0.12
135	300322	硕贝德	18,200	458,640.00	0.12
136	300070	碧水源	143,600	458,084.00	0.12
137	301039	中集车辆	63,600	448,380.00	0.11
138	300319	麦捷科技	15,100	447,413.00	0.11
139	300779	惠城环保	8,880	445,776.00	0.11
140	301607	富特科技	8,500	444,125.00	0.11
141	300323	华灿光电	21,700	442,680.00	0.11
142	300416	苏试试验	21,700	442,246.00	0.11
143	301189	奥尼电子	7,500	441,975.00	0.11
144	300486	东杰智能	20,700	441,945.00	0.11
145	300682	朗新科技	44,400	439,560.00	0.11
146	300975	商络电子	8,400	434,700.00	0.11
147	301389	隆扬电子	5,000	433,950.00	0.11
148	300821	东岳硅材	21,000	431,760.00	0.11
149	301191	菲菱科思	3,800	431,490.00	0.11
150	300031	宝通科技	15,100	431,407.00	0.11
151	300628	亿联网络	12,700	429,514.00	0.11
152	300855	图南股份	13,700	428,262.00	0.11
153	300222	科大智能	30,800	426,580.00	0.11
154	300488	恒锋工具	9,100	426,153.00	0.11
155	300638	广和通	23,000	425,730.00	0.11
156	300843	胜蓝股份	2,700	421,875.00	0.11
157	300244	迪安诊断	22,500	421,650.00	0.11
158	300045	华力创通	24,400	420,656.00	0.11
159	301319	唯特偶	2,500	418,325.00	0.11
160	301510	固高科技	13,100	418,283.00	0.11
161	300474	景嘉微	6,900	417,312.00	0.11
162	300772	运达股份	33,900	416,970.00	0.11
163	301090	华润材料	66,500	416,955.00	0.11
164	300655	晶瑞电材	19,000	406,980.00	0.10
165	300850	新强联	15,100	404,680.00	0.10
166	300699	光威复材	14,100	403,965.00	0.10
167	300634	彩讯股份	20,600	403,142.00	0.10
168	300725	药石科技	11,000	402,600.00	0.10
169	300337	银邦股份	34,500	402,270.00	0.10
170	300493	润欣科技	26,900	401,079.00	0.10
171	300529	健帆生物	25,800	397,320.00	0.10
172	301571	国科天成	6,000	391,080.00	0.10
173	300429	强力新材	22,000	389,840.00	0.10
174	300951	博硕科技	7,700	388,850.00	0.10
175	300619	金银河	12,480	388,252.80	0.10

176	300709	精研科技	6,800	382,500.00	0.10
177	300383	光环新网	30,700	381,908.00	0.10
178	300617	安靠智电	7,200	381,528.00	0.10
179	300179	四方达	6,400	380,352.00	0.10
180	300756	金马游乐	11,500	380,075.00	0.10
181	300072	海新能科	111,700	379,780.00	0.10
182	300098	高新兴	82,700	379,593.00	0.10
183	300905	宝丽迪	7,500	379,500.00	0.10
184	300393	中来股份	51,200	373,248.00	0.09
185	300006	莱美药业	72,600	372,438.00	0.09
186	300679	电连技术	6,200	371,938.00	0.09
187	300168	万达信息	81,000	371,790.00	0.09
188	300503	昊志机电	4,000	369,200.00	0.09
189	301115	联检科技	10,500	368,130.00	0.09
190	301215	中汽股份	70,800	367,452.00	0.09
191	300909	汇创达	6,300	366,786.00	0.09
192	300681	英搏尔	12,800	366,336.00	0.09
193	300434	金石亚药	32,400	363,852.00	0.09
194	300255	常山药业	15,500	363,010.00	0.09
195	300171	东富龙	32,800	362,768.00	0.09
196	300932	三友联众	34,200	362,520.00	0.09
197	300397	天和防务	23,900	361,846.00	0.09
198	300324	旋极信息	96,800	360,096.00	0.09
199	300214	日科化学	35,100	359,775.00	0.09
200	300491	通合科技	9,400	358,986.00	0.09
201	300598	诚迈科技	12,600	357,840.00	0.09
202	300358	楚天科技	44,700	357,600.00	0.09
203	300134	大富科技	41,800	357,390.00	0.09
204	300085	银之杰	10,200	356,694.00	0.09
205	300657	弘信电子	8,100	356,562.00	0.09
206	300270	中威电子	27,400	356,474.00	0.09
207	300768	迪普科技	25,800	355,266.00	0.09
208	300481	濮阳惠成	18,600	353,772.00	0.09
209	301093	华兰股份	2,600	352,638.00	0.09
210	300872	天阳科技	22,300	352,340.00	0.09
211	300745	欣锐科技	8,300	350,426.00	0.09
212	300284	苏交科	70,000	350,000.00	0.09
213	301265	华新科技	12,700	349,885.00	0.09
214	300121	阳谷华泰	27,700	349,020.00	0.09
215	301487	盟固利	18,200	348,530.00	0.09
216	300018	中元股份	28,200	348,270.00	0.09
217	300278	华昌达	89,500	347,260.00	0.09
218	300082	奥克股份	40,200	346,926.00	0.09

219	301042	安联锐视	5,200	346,840.00	0.09
220	301005	超捷股份	3,100	345,836.00	0.09
221	301626	苏州天脉	900	345,564.00	0.09
222	301368	丰立智能	8,300	345,529.00	0.09
223	300226	上海钢联	22,500	344,475.00	0.09
224	300131	英唐智控	18,100	344,443.00	0.09
225	301153	中科江南	21,100	343,719.00	0.09
226	300079	数码视讯	81,700	343,140.00	0.09
227	300680	隆盛科技	15,100	343,072.00	0.09
228	301095	广立微	2,900	342,345.00	0.09
229	300700	岱勒新材	16,000	340,480.00	0.09
230	301230	泓博医药	9,200	338,928.00	0.09
231	300724	捷佳伟创	4,800	338,880.00	0.09
232	300142	沃森生物	25,900	336,441.00	0.09
233	300083	创世纪	24,700	336,414.00	0.09
234	301252	同星科技	8,300	336,399.00	0.09
235	300048	合康新能	71,900	335,773.00	0.08
236	300047	天源迪科	37,700	334,776.00	0.08
237	300629	新劲刚	15,600	334,776.00	0.08
238	300569	天能重工	69,300	334,026.00	0.08
239	300856	科思股份	31,300	333,658.00	0.08
240	300036	超图软件	29,600	333,592.00	0.08
241	300490	华自科技	25,200	333,396.00	0.08
242	300633	开立医疗	18,100	332,859.00	0.08
243	301517	陕西华达	6,700	332,521.00	0.08
244	300715	凯伦股份	20,200	332,492.00	0.08
245	300067	安诺其	61,300	332,246.00	0.08
246	300005	探路者	14,700	332,220.00	0.08
247	300606	金太阳	7,800	331,968.00	0.08
248	300016	北陆药业	43,200	331,344.00	0.08
249	301479	弘景光电	5,500	331,100.00	0.08
250	300232	洲明科技	57,600	330,048.00	0.08
251	300797	钢研纳克	24,800	328,848.00	0.08
252	301246	宏源药业	12,200	328,180.00	0.08
253	301128	强瑞技术	2,100	327,390.00	0.08
254	301179	泽宇智能	16,000	327,360.00	0.08
255	300369	绿盟科技	60,000	326,400.00	0.08
256	300286	安科瑞	13,500	326,025.00	0.08
257	301123	奕东电子	2,700	325,944.00	0.08
258	300473	德尔股份	10,700	325,280.00	0.08
259	301226	祥明智能	9,800	325,262.00	0.08
260	301048	金鹰重工	37,700	324,597.00	0.08
261	300342	天银机电	6,900	324,300.00	0.08

262	301662	宏工科技	3,200	324,224.00	0.08
263	300697	电工合金	21,400	324,210.00	0.08
264	301568	思泰克	2,900	323,640.00	0.08
265	300980	祥源新材	11,000	323,510.00	0.08
266	300712	永福股份	15,100	323,291.00	0.08
267	301150	中一科技	5,100	321,861.00	0.08
268	300835	龙磁科技	1,400	321,286.00	0.08
269	300206	理邦仪器	26,200	320,426.00	0.08
270	301012	扬电科技	13,600	319,464.00	0.08
271	300022	吉峰科技	40,900	317,793.00	0.08
272	300871	回盛生物	14,400	317,664.00	0.08
273	300302	同有科技	6,200	317,254.00	0.08
274	301021	英诺激光	2,600	316,940.00	0.08
275	300463	迈克生物	38,300	316,358.00	0.08
276	300183	东软载波	30,200	315,590.00	0.08
277	301096	百诚医药	5,500	314,545.00	0.08
278	300791	仙乐健康	19,600	313,992.00	0.08
279	300896	爱美客	3,600	313,920.00	0.08
280	300793	佳禾智能	27,900	313,875.00	0.08
281	300349	金卡智能	28,600	312,884.00	0.08
282	301302	华如科技	11,600	312,272.00	0.08
283	300885	海昌新材	13,100	311,387.00	0.08
284	301028	鼎熔岩	19,500	311,220.00	0.08
285	301550	斯菱智驱	3,400	310,862.00	0.08
286	300388	节能国祯	50,100	309,117.00	0.08
287	301085	亚康股份	5,100	309,111.00	0.08
288	300890	翔丰华	9,300	308,481.00	0.08
289	300862	蓝盾光电	14,800	308,432.00	0.08
290	300996	普联软件	28,300	308,187.00	0.08
291	301110	青木科技	8,100	306,666.00	0.08
292	300968	格林精密	31,800	306,552.00	0.08
293	300867	圣元环保	16,900	306,228.00	0.08
294	300880	迦南智能	14,400	306,000.00	0.08
295	300424	航新科技	19,400	305,356.00	0.08
296	301656	联合动力	17,700	304,971.00	0.08
297	301002	崧盛股份	7,900	304,940.00	0.08
298	300003	乐普医疗	25,700	304,545.00	0.08
299	300726	宏达电子	3,600	304,452.00	0.08
300	300627	华测导航	10,700	303,880.00	0.08
301	301116	益客食品	35,500	303,880.00	0.08
302	300389	艾比森	23,700	303,834.00	0.08
303	300299	富春股份	61,900	303,310.00	0.08
304	300840	酷特智能	14,700	303,261.00	0.08

305	300955	嘉亨家化	8,400	303,156.00	0.08
306	300448	浩云科技	52,600	302,976.00	0.08
307	301500	飞南资源	11,600	302,180.00	0.08
308	300184	力源信息	17,200	301,860.00	0.08
309	300691	联合光电	19,000	300,390.00	0.08
310	300071	福石控股	85,800	300,300.00	0.08
311	300822	贝仕达克	25,600	299,520.00	0.08
312	300654	世纪天鸿	30,800	299,376.00	0.08
313	301408	华人健康	20,800	299,104.00	0.08
314	300933	中辰股份	49,100	298,528.00	0.08
315	301193	家联科技	16,100	298,494.00	0.08
316	300194	福安药业	88,300	298,454.00	0.08
317	301199	迈赫股份	17,100	298,224.00	0.08
318	300677	英科医疗	7,600	297,692.00	0.08
319	300848	美瑞新材	21,300	297,135.00	0.08
320	301261	恒工精密	3,800	296,780.00	0.08
321	301071	力量钻石	3,200	296,000.00	0.07
322	300946	恒而达	7,500	295,425.00	0.07
323	300239	东宝生物	55,400	295,282.00	0.07
324	300504	天邑股份	18,300	295,179.00	0.07
325	300466	赛摩智能	41,900	294,976.00	0.07
326	300552	万集科技	12,900	294,765.00	0.07
327	301188	力诺药包	4,400	294,360.00	0.07
328	300487	蓝晓科技	5,000	294,250.00	0.07
329	300447	全信股份	19,700	294,121.00	0.07
330	300032	金龙机电	77,400	294,120.00	0.07
331	301122	采纳股份	10,000	294,100.00	0.07
332	300839	博汇股份	25,100	293,921.00	0.07
333	301027	华蓝集团	14,200	293,798.00	0.07
334	300132	青松股份	51,700	293,656.00	0.07
335	301175	中科环保	59,300	293,535.00	0.07
336	300789	唐源电气	16,500	293,205.00	0.07
337	301060	兰卫医学	35,800	292,486.00	0.07
338	300404	博济医药	33,380	292,408.80	0.07
339	300445	康斯特	14,000	291,480.00	0.07
340	300921	南凌科技	14,300	290,433.00	0.07
341	300551	古鳌科技	29,500	290,280.00	0.07
342	300559	佳发教育	28,300	289,509.00	0.07
343	301305	朗坤科技	10,100	288,052.00	0.07
344	301397	溯联股份	8,900	288,004.00	0.07
345	301631	壹连科技	4,000	287,440.00	0.07
346	300479	神思电子	21,200	287,048.00	0.07
347	301206	三元生物	12,900	286,767.00	0.07

348	300381	溢多利	50,900	286,058.00	0.07
349	301079	邵阳液压	8,500	285,940.00	0.07
350	300830	金现代	36,000	285,840.00	0.07
351	300050	世纪鼎利	48,200	285,344.00	0.07
352	301210	金杨精密	9,500	285,000.00	0.07
353	300988	津荣天宇	18,200	284,466.00	0.07
354	300589	江龙船艇	24,100	284,380.00	0.07
355	300511	雪榕生物	56,400	283,692.00	0.07
356	300631	久吾高科	12,300	283,515.00	0.07
357	300940	南极光	18,800	283,504.00	0.07
358	301026	浩通科技	14,000	283,080.00	0.07
359	300246	宝莱特	20,100	282,807.00	0.07
360	301082	久盛电气	31,500	282,240.00	0.07
361	300077	国民技术	9,000	282,150.00	0.07
362	300826	测绘股份	20,130	281,820.00	0.07
363	300510	金冠股份	90,100	281,112.00	0.07
364	301041	金百泽	8,300	280,125.00	0.07
365	300407	凯发电气	25,900	279,720.00	0.07
366	300798	锦鸡股份	42,800	279,484.00	0.07
367	300720	海川智能	2,900	278,980.00	0.07
368	300658	延江股份	24,400	278,892.00	0.07
369	300887	谱尼测试	40,000	278,400.00	0.07
370	300582	英飞特	22,800	277,704.00	0.07
371	301172	君逸数码	10,700	277,665.00	0.07
372	301338	凯格精机	1,700	276,913.00	0.07
373	300365	恒华科技	60,400	276,632.00	0.07
374	301212	联盛化学	11,800	275,530.00	0.07
375	300735	光弘科技	12,100	275,154.00	0.07
376	300583	赛托生物	24,500	275,135.00	0.07
377	300884	狄耐克	27,700	274,784.00	0.07
378	300275	梅安森	34,200	274,626.00	0.07
379	300281	金明精机	45,500	274,365.00	0.07
380	300230	永利股份	65,300	274,260.00	0.07
381	300512	中亚股份	40,200	274,164.00	0.07
382	300565	科信技术	26,900	273,842.00	0.07
383	300375	鹏翎股份	66,400	272,240.00	0.07
384	300025	华星创业	64,800	272,160.00	0.07
385	301171	易点天下	8,000	271,680.00	0.07
386	300564	筑博设计	22,600	271,426.00	0.07
387	300591	万里马	40,100	269,873.00	0.07
388	300509	新美星	32,200	269,836.00	0.07
389	300176	鸿特科技	55,500	269,175.00	0.07
390	300644	南京聚隆	11,500	268,870.00	0.07

391	301035	润丰股份	5,790	268,656.00	0.07
392	300771	智莱科技	26,000	268,320.00	0.07
393	301152	天力锂能	11,300	267,471.00	0.07
394	300107	建新股份	47,700	267,120.00	0.07
395	300732	设研院	47,900	266,803.00	0.07
396	300254	仟源医药	33,300	266,733.00	0.07
397	300970	华绿生物	14,570	266,339.60	0.07
398	300769	德方纳米	4,000	266,000.00	0.07
399	300971	博亚精工	14,200	264,972.00	0.07
400	300074	华平股份	77,900	264,860.00	0.07
401	300422	博世科	62,800	264,388.00	0.07
402	300947	德必集团	20,700	263,925.00	0.07
403	301135	瑞德智能	16,000	263,520.00	0.07
404	301666	大普微	400	263,480.00	0.07
405	300597	吉大通信	37,200	263,376.00	0.07
406	300122	智飞生物	22,300	260,687.00	0.07
407	300112	万讯自控	41,900	259,361.00	0.07
408	300575	中旗股份	52,600	258,792.00	0.07
409	301317	鑫磊股份	4,600	258,152.00	0.07
410	300823	建科智能	17,700	258,066.00	0.07
411	301329	信音电子	10,600	257,474.00	0.07
412	300610	晨化股份	26,400	257,400.00	0.07
413	301121	紫建电子	8,000	256,160.00	0.06
414	300155	安居宝	65,000	254,800.00	0.06
415	301062	上海艾录	44,400	253,524.00	0.06
416	301156	美农生物	23,300	253,271.00	0.06
417	300713	英可瑞	19,800	252,252.00	0.06
418	300660	江苏雷利	9,050	252,133.00	0.06
419	300199	翰宇药业	11,400	251,712.00	0.06
420	300922	天秦装备	16,600	251,490.00	0.06
421	300851	交大思诺	11,300	251,425.00	0.06
422	301491	汉桑科技	6,400	251,328.00	0.06
423	300405	科隆股份	48,400	250,712.00	0.06
424	301157	华塑科技	4,000	249,920.00	0.06
425	301378	通达海	10,400	249,392.00	0.06
426	301295	美硕科技	5,900	248,862.00	0.06
427	301516	中远通	17,500	247,625.00	0.06
428	301518	长华化学	9,400	246,280.00	0.06
429	300263	隆华科技	15,100	246,130.00	0.06
430	300904	威力传动	6,000	243,540.00	0.06
431	300364	中文在线	10,300	242,977.00	0.06
432	300304	云意电气	13,600	242,760.00	0.06
433	301499	维科精密	8,300	242,194.00	0.06

434	300331	苏大维格	3,400	241,774.00	0.06
435	301519	舜禹股份	22,200	240,870.00	0.06
436	301567	贝隆精密	6,900	238,809.00	0.06
437	301183	东田微	900	238,383.00	0.06
438	300100	双林股份	8,500	236,130.00	0.06
439	300723	一品红	6,300	234,864.00	0.06
440	300455	航天智装	10,900	234,786.00	0.06
441	300170	汉得信息	15,300	233,172.00	0.06
442	300144	宋城演艺	39,900	231,819.00	0.06
443	301086	鸿富瀚	1,100	230,208.00	0.06
444	300938	信测标准	4,600	229,448.00	0.06
445	301486	致尚科技	1,100	229,152.00	0.06
446	300042	朗科科技	3,000	228,510.00	0.06
447	300413	芒果超媒	15,600	228,228.00	0.06
448	301219	腾远钴业	4,100	224,680.00	0.06
449	300382	斯莱克	9,600	221,856.00	0.06
450	300065	海兰信	9,900	220,869.00	0.06
451	301285	鸿日达	2,000	220,660.00	0.06
452	300303	聚飞光电	19,700	217,882.00	0.06
453	300002	神州泰岳	26,900	210,089.00	0.05
454	300409	道氏技术	10,400	207,272.00	0.05
455	300436	广生堂	1,900	204,516.00	0.05
456	301196	唯科科技	1,620	203,180.40	0.05
457	301013	利和兴	2,800	202,300.00	0.05
458	301275	汉朔科技	4,400	197,560.00	0.05
459	301369	联动科技	800	196,000.00	0.05
460	300469	信息发展	3,500	184,135.00	0.05
461	300999	金龙鱼	7,800	181,428.00	0.05
462	300913	兆龙互连	3,700	177,267.00	0.04
463	300224	正海磁材	13,200	175,956.00	0.04
464	300684	中石科技	2,800	170,800.00	0.04
465	301029	怡合达	6,300	170,163.00	0.04
466	301489	思泉新材	1,000	164,580.00	0.04
467	300133	华策影视	23,200	164,256.00	0.04
468	300401	花园生物	7,500	164,175.00	0.04
469	300596	利安隆	3,100	162,688.00	0.04
470	300868	杰美特	1,100	161,381.00	0.04
471	300775	三角防务	7,300	160,892.00	0.04
472	301176	逸豪新材	2,300	156,400.00	0.04
473	300182	捷成股份	32,800	155,800.00	0.04
474	300480	光力科技	3,600	153,648.00	0.04
475	300118	东方日升	12,300	153,135.00	0.04
476	300777	中简科技	5,800	152,424.00	0.04

477	300468	四方精创	7,200	151,272.00	0.04
478	300353	东土科技	7,200	149,616.00	0.04
479	300459	汤姆猫	43,700	148,143.00	0.04
480	300357	我武生物	6,300	146,916.00	0.04
481	300573	兴齐眼药	3,600	146,736.00	0.04
482	300827	上能电气	4,700	144,713.00	0.04
483	301392	汇成真空	500	144,320.00	0.04
484	300428	立中集团	7,900	143,622.00	0.04
485	301177	迪阿股份	5,200	143,364.00	0.04
486	300174	元力股份	4,900	143,178.00	0.04
487	300420	五洋自控	14,800	140,008.00	0.04
488	300499	高澜股份	3,600	139,320.00	0.04
489	300861	美畅股份	5,500	138,545.00	0.04
490	300674	宇信科技	9,200	138,460.00	0.04
491	300053	航宇微	8,400	138,180.00	0.03
492	301382	蜂助手	3,000	138,000.00	0.03
493	300761	立华股份	8,400	137,844.00	0.03
494	300739	明阳电路	3,900	137,046.00	0.03
495	300315	掌趣科技	34,800	135,720.00	0.03
496	301678	新恒汇	1,700	134,028.00	0.03
497	300819	聚杰微纤	1,800	133,236.00	0.03
498	300145	南方泵业	24,400	132,980.00	0.03
499	300146	汤臣倍健	14,500	131,080.00	0.03
500	300601	康泰生物	11,300	128,142.00	0.03
501	300328	宜安科技	9,100	127,764.00	0.03
502	301015	百洋医药	6,700	127,702.00	0.03
503	301326	捷邦科技	900	125,433.00	0.03
504	300852	四会富仕	1,800	124,632.00	0.03
505	300265	通光线缆	6,000	124,080.00	0.03
506	300204	舒泰神	5,200	123,656.00	0.03
507	301232	飞沃科技	800	123,160.00	0.03
508	300731	科创新源	2,100	122,556.00	0.03
509	301606	绿联科技	2,000	122,040.00	0.03
510	300497	富祥股份	5,500	121,880.00	0.03
511	300252	金信诺	7,000	120,750.00	0.03
512	301207	华兰疫苗	7,400	120,546.00	0.03
513	300900	广联航空	3,100	119,567.00	0.03
514	300976	达瑞电子	1,500	119,475.00	0.03
515	300378	鼎捷数智	3,300	119,130.00	0.03
516	300435	中泰股份	4,400	119,108.00	0.03
517	300618	寒锐钴业	3,300	117,810.00	0.03
518	300820	英杰电气	1,300	117,299.00	0.03
519	301228	实朴检测	1,500	117,240.00	0.03

520	301363	美好医疗	6,380	116,945.40	0.03
521	301267	华夏眼科	8,000	116,720.00	0.03
522	300009	安科生物	14,800	116,180.00	0.03
523	301312	智立方	1,000	116,010.00	0.03
524	301182	凯旺科技	1,100	113,597.00	0.03
525	300440	运达科技	5,300	113,049.00	0.03
526	300706	阿石创	1,300	112,255.00	0.03
527	301306	西测测试	700	110,943.00	0.03
528	301286	侨源股份	1,900	110,181.00	0.03
529	300113	顺网科技	6,000	109,260.00	0.03
530	300400	劲拓股份	2,900	109,185.00	0.03
531	301248	杰创智能	1,300	109,109.00	0.03
532	300130	新国都	5,100	107,304.00	0.03
533	300151	昌红科技	4,300	107,285.00	0.03
534	300580	贝斯特	5,300	106,583.00	0.03
535	300415	伊之密	5,300	105,523.00	0.03
536	300049	福瑞医科	2,700	104,976.00	0.03
537	300624	万兴科技	2,000	103,740.00	0.03
538	300959	线上线下	700	103,467.00	0.03
539	301087	可孚医疗	2,150	102,447.50	0.03
540	301069	凯盛新材	5,100	102,204.00	0.03
541	300101	振芯科技	6,300	101,871.00	0.03
542	300846	首都在线	4,700	99,687.00	0.03
543	301078	孩子王	14,200	95,992.00	0.02
544	301099	雅创电子	1,000	95,500.00	0.02
545	300139	晓程科技	2,600	95,030.00	0.02
546	300041	回天新材	6,100	94,794.00	0.02
547	300990	同飞股份	900	94,563.00	0.02
548	301345	涛涛车业	400	92,400.00	0.02
549	300035	中科电气	6,400	92,288.00	0.02
550	300516	久之洋	2,800	91,728.00	0.02
551	300046	台基股份	2,500	91,400.00	0.02
552	300586	美联新材	5,800	90,712.00	0.02
553	300939	秋田微	1,300	89,960.00	0.02
554	300641	正丹股份	5,800	89,204.00	0.02
555	301091	深城交	5,700	88,350.00	0.02
556	300834	星辉环材	2,100	87,780.00	0.02
557	300181	佐力药业	6,200	87,420.00	0.02
558	300363	博腾股份	5,300	86,072.00	0.02
559	301566	达利凯普	2,300	85,284.00	0.02
560	300188	国投智能	9,100	85,085.00	0.02
561	300283	温州宏丰	4,000	82,200.00	0.02
562	300741	华宝股份	6,500	81,380.00	0.02

563	300057	万顺新材	9,200	79,856.00	0.02
564	300196	长海股份	2,700	79,839.00	0.02
565	300444	双杰电气	6,400	78,144.00	0.02
566	301209	联合化学	1,400	77,770.00	0.02
567	300566	激智科技	2,100	77,595.00	0.02
568	300696	爱乐达	2,900	75,487.00	0.02
569	300520	科大国创	2,800	75,432.00	0.02
570	301362	民爆光电	400	73,568.00	0.02
571	300910	瑞丰新材	2,600	72,904.00	0.02
572	301328	维峰电子	1,000	71,200.00	0.02
573	300026	红日药业	24,500	71,050.00	0.02
574	301047	义翘神州	1,100	71,016.00	0.02
575	300276	三丰智能	9,900	70,983.00	0.02
576	301070	开勒股份	800	70,400.00	0.02
577	301458	钧崴电子	1,200	70,152.00	0.02
578	300482	万孚生物	4,200	69,762.00	0.02
579	300770	新媒股份	2,200	69,278.00	0.02
580	300219	鸿利智汇	6,600	68,838.00	0.02
581	300825	阿尔特	4,800	68,544.00	0.02
582	301522	上大股份	2,600	68,042.00	0.02
583	300221	银禧科技	4,200	67,494.00	0.02
584	301366	一博科技	1,100	67,287.00	0.02
585	301000	肇民科技	2,100	67,221.00	0.02
586	300294	博雅生物	4,700	66,928.00	0.02
587	300985	致远新能	1,700	65,450.00	0.02
588	300986	志特新材	3,800	65,170.00	0.02
589	301498	乖宝宠物	1,600	64,944.00	0.02
590	300080	易成新能	16,900	63,544.00	0.02
591	301050	雷电微力	1,900	63,536.00	0.02
592	301263	泰恩康	3,100	63,519.00	0.02
593	300595	欧普康视	6,000	63,180.00	0.02
594	300895	铜牛信息	1,200	62,448.00	0.02
595	301045	天禄科技	700	62,356.00	0.02
596	300259	新天科技	9,400	62,322.00	0.02
597	301373	凌玮科技	400	62,200.00	0.02
598	300019	硅宝科技	3,200	60,992.00	0.02
599	300540	蜀道装备	1,600	60,640.00	0.02
600	300483	首华燃气	3,400	59,772.00	0.02
601	300341	麦克奥迪	4,500	59,625.00	0.02
602	301055	张小泉	1,400	59,458.00	0.02
603	300180	华峰超纤	15,000	59,100.00	0.01
604	300492	华图山鼎	1,700	58,395.00	0.01
605	301580	爱迪特	900	57,897.00	0.01

606	301327	华宝新能	1,200	57,684.00	0.01
607	300293	蓝英装备	2,800	56,980.00	0.01
608	301033	迈普医学	1,100	56,969.00	0.01
609	300689	澄天伟业	800	56,144.00	0.01
610	301292	海科新源	700	55,811.00	0.01
611	300626	华瑞股份	1,600	55,808.00	0.01
612	300632	光莆股份	1,900	54,245.00	0.01
613	300815	玉禾田	3,300	53,955.00	0.01
614	300740	水羊股份	2,900	53,389.00	0.01
615	300127	银河磁体	1,900	53,105.00	0.01
616	301321	翰博高新	1,200	52,980.00	0.01
617	300348	长亮科技	6,000	52,800.00	0.01
618	301061	匠心家居	1,500	52,605.00	0.01
619	300678	中科信息	2,300	51,520.00	0.01
620	301349	信德新材	700	51,520.00	0.01
621	300685	艾德生物	3,000	50,520.00	0.01
622	300292	吴通控股	9,200	49,864.00	0.01
623	300203	聚光科技	3,500	48,405.00	0.01
624	300964	本川智能	560	48,255.20	0.01
625	300668	杰恩股份	800	47,960.00	0.01
626	300722	新余国科	2,100	46,830.00	0.01
627	300129	泰胜风能	5,400	46,170.00	0.01
628	300298	三诺生物	3,300	46,035.00	0.01
629	300522	世名科技	1,900	45,543.00	0.01
630	300737	科顺股份	6,900	45,333.00	0.01
631	300258	精锻科技	4,100	45,223.00	0.01
632	300943	春晖智控	1,000	44,950.00	0.01
633	300727	润禾材料	1,200	44,904.00	0.01
634	301137	哈焊华通	1,300	44,668.00	0.01
635	300467	迅游科技	1,200	44,616.00	0.01
636	300191	潜能恒信	1,600	44,240.00	0.01
637	300581	晨曦航空	3,900	43,836.00	0.01
638	301638	南网数字	1,800	43,290.00	0.01
639	300553	集智股份	700	42,973.00	0.01
640	300708	聚灿光电	5,000	42,900.00	0.01
641	300592	华凯易佰	2,400	42,480.00	0.01
642	301323	新莱福	500	40,795.00	0.01
643	300547	川环科技	1,200	40,068.00	0.01
644	300360	炬华科技	3,400	39,950.00	0.01
645	301339	通行宝	3,900	39,897.00	0.01
646	300084	海默科技	3,300	39,699.00	0.01
647	300120	经纬辉开	3,500	39,655.00	0.01
648	301529	福赛科技	400	38,544.00	0.01

649	300249	依米康	2,500	38,500.00	0.01
650	300997	欢乐家	2,800	37,940.00	0.01
651	300066	三川智慧	6,700	37,386.00	0.01
652	301160	翔楼新材	800	37,320.00	0.01

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

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	300750	宁德时代	81,366,250.08	20.59
2	300308	中际旭创	43,680,838.00	11.05
3	300502	新易盛	37,160,409.20	9.40
4	300760	迈瑞医疗	27,514,649.24	6.96
5	301358	湖南裕能	19,855,388.51	5.02
6	300014	亿纬锂能	18,901,016.09	4.78
7	300408	三环集团	18,661,523.00	4.72
8	300124	汇川技术	18,510,117.00	4.68
9	300339	润和软件	17,152,769.14	4.34
10	300450	先导智能	15,148,452.94	3.83
11	300972	万辰集团	14,973,875.00	3.79
12	300223	北京君正	14,492,184.00	3.67
13	300454	深信服	14,158,235.00	3.58
14	300031	宝通科技	13,646,564.00	3.45
15	300433	蓝思科技	13,504,105.00	3.42
16	300073	当升科技	13,140,419.00	3.32
17	300903	科翔股份	13,022,363.52	3.29
18	300676	华大基因	12,881,629.04	3.26
19	300432	富临精工	12,553,527.00	3.18
20	300115	长盈精密	12,004,133.00	3.04
21	300861	美畅股份	11,710,799.80	2.96
22	300394	天孚通信	11,478,384.20	2.90
23	300195	长荣股份	11,154,521.00	2.82
24	301510	固高科技	11,140,221.00	2.82
25	301055	张小泉	11,113,232.00	2.81
26	301246	宏源药业	10,998,737.00	2.78
27	300274	阳光电源	10,940,358.00	2.77
28	300232	洲明科技	10,767,437.00	2.72
29	300957	贝泰妮	10,684,580.00	2.70
30	300745	欣锐科技	10,616,692.00	2.69

31	300661	圣邦股份	10,545,672.00	2.67
32	300476	胜宏科技	10,540,328.00	2.67
33	300919	中伟新材	10,514,985.00	2.66
34	300691	联合光电	10,490,019.00	2.65
35	300395	菲利华	10,428,487.00	2.64
36	300418	昆仑万维	10,366,897.00	2.62
37	300490	华自科技	10,271,409.00	2.60
38	300058	蓝色光标	10,000,361.00	2.53
39	300059	东方财富	9,823,222.00	2.49
40	300458	全志科技	9,819,111.40	2.48
41	300738	奥飞数据	9,773,163.00	2.47
42	300496	中科创达	9,727,042.99	2.46
43	301165	锐捷网络	9,658,532.60	2.44
44	300590	移为通信	9,634,187.25	2.44
45	300857	协创数据	9,581,302.00	2.42
46	300814	中富电路	9,336,535.00	2.36
47	300438	鹏辉能源	9,254,402.00	2.34
48	300206	理邦仪器	9,253,953.00	2.34
49	300285	国瓷材料	9,101,532.00	2.30
50	300012	华测检测	9,089,347.00	2.30
51	300373	扬杰科技	9,024,848.00	2.28
52	300575	中旗股份	8,980,457.00	2.27
53	301297	富乐德	8,863,539.00	2.24
54	301536	星宸科技	8,817,285.00	2.23
55	301216	万凯新材	8,783,222.00	2.22
56	300074	华平股份	8,694,793.00	2.20
57	300709	精研科技	8,636,783.00	2.19
58	300749	顶固集创	8,345,628.00	2.11
59	300299	富春股份	8,338,387.00	2.11
60	300613	富瀚微	8,048,031.00	2.04
61	300604	长川科技	7,989,298.00	2.02
62	301656	联合动力	7,964,414.00	2.02
63	300548	长芯博创	7,956,715.00	2.01
64	301200	大族数控	7,938,316.54	2.01

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	300750	宁德时代	43,687,731.00	11.05
2	300308	中际旭创	32,234,210.00	8.16

3	300502	新易盛	30,759,639.38	7.78
4	300760	迈瑞医疗	23,279,191.96	5.89
5	301358	湖南裕能	19,756,666.00	5.00
6	300408	三环集团	16,705,939.50	4.23
7	300014	亿纬锂能	16,568,328.00	4.19
8	300339	润和软件	15,153,842.00	3.83
9	300031	宝通科技	14,463,001.00	3.66
10	300903	科翔股份	14,186,083.00	3.59
11	300223	北京君正	14,105,844.00	3.57
12	300124	汇川技术	13,665,362.00	3.46
13	300972	万辰集团	13,187,448.00	3.34
14	300861	美畅股份	13,094,634.00	3.31
15	300454	深信服	12,827,381.00	3.25
16	300450	先导智能	12,256,424.00	3.10
17	300676	华大基因	11,964,263.98	3.03
18	300073	当升科技	11,782,020.00	2.98
19	301055	张小泉	11,388,409.02	2.88
20	300285	国瓷材料	11,245,503.90	2.85
21	300115	长盈精密	11,095,490.00	2.81
22	300432	富临精工	11,056,918.00	2.80
23	300661	圣邦股份	10,979,703.00	2.78
24	300745	欣锐科技	10,934,792.00	2.77
25	301536	星宸科技	10,519,233.00	2.66
26	300709	精研科技	10,251,566.00	2.59
27	301510	固高科技	10,242,761.36	2.59
28	300195	长荣股份	10,199,310.00	2.58
29	301297	富乐德	10,131,678.00	2.56
30	301246	宏源药业	10,101,957.74	2.56
31	300691	联合光电	10,082,653.80	2.55
32	300232	洲明科技	9,878,120.00	2.50
33	300058	蓝色光标	9,826,689.34	2.49
34	300395	菲利华	9,820,191.00	2.48
35	300857	协创数据	9,797,800.00	2.48
36	300496	中科创达	9,623,655.00	2.43
37	300373	扬杰科技	9,300,619.59	2.35
38	300814	中富电路	9,216,251.00	2.33
39	300418	昆仑万维	9,175,303.00	2.32
40	300613	富瀚微	8,957,802.00	2.27
41	300957	贝泰妮	8,916,277.00	2.26
42	300458	全志科技	8,868,352.60	2.24
43	300919	中伟新材	8,651,139.00	2.19
44	300074	华平股份	8,438,726.00	2.14
45	300490	华自科技	8,423,842.00	2.13

46	300433	蓝思科技	8,393,895.00	2.12
47	301165	锐捷网络	8,276,416.60	2.09
48	300738	奥飞数据	8,265,758.00	2.09
49	300206	理邦仪器	8,101,403.00	2.05
50	300012	华测检测	8,050,146.00	2.04
51	300438	鹏辉能源	8,043,596.00	2.04
52	300749	顶固集创	8,034,523.00	2.03
53	300602	飞荣达	7,910,693.00	2.00
54	301656	联合动力	7,909,795.40	2.00

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	2,074,132,229.57
卖出股票收入（成交）总额	1,764,320,937.63

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	845,654.40
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	1,186,401.34
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	2,032,055.74

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
兴银创业板综合指数增强 A	842	76,941.03	99,700.90	0.15%	64,684,642.56	99.85%
兴银创业板综合指数增强 C	3,467	85,969.52	—	—	298,056,314.97	100.00%
合计	4,309	84,205.30	99,700.90	0.03%	362,740,957.53	99.97%

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	兴银创业板综合指数增强 A	69,825.49	0.107781%
	兴银创业板综合指数增强 C	1,292,810.24	0.433747%
	合计	1,362,635.73	0.375547%

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	兴银创业板综合指数增强 A	0~10
	兴银创业板综合指数增强 C	>100
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	兴银创业板综合指数增强 A	0~10
	兴银创业板综合指数增强 C	0~10
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	兴银创业板综合指数增强 A	兴银创业板综合指数增强 C
基金合同生效日（2026 年 03 月 31 日）基金份额总额	142,176,928.52	653,211,050.22
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	2,312,179.20	15,305,979.56
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	79,704,764.26	370,460,714.81
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	64,784,343.46	298,056,314.97

§ 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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中原证券股份有限公司	2	3,728,347,087.80	97.13%	932,138.81	97.13%	-
方正证券	2	110,106,079.40	2.87%	27,528.90	2.87%	-
东方财富证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

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	兴银创业板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	2026-02-27
2	兴银创业板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	2026-04-01
3	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
4	兴银创业板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	2026-05-28

§ 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. 《兴银创业板综合指数增强型证券投资基金基金合同》
3. 《兴银创业板综合指数增强型证券投资基金托管协议》
4. 《兴银创业板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