

兴银新锐量化选股混合型证券投资基金

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06月09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	6
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	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	12

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	53
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	53
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	53
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	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53

7.12 投资组合报告附注	53
§ 8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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	55
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	56
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	56
10.8 其他重大事件	57
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	57
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	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	57
§ 12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴银新锐量化选股混合型证券投资基金	
基金简称	兴银新锐量化选股混合	
基金主代码	027446	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026 年 06 月 09 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	227,321,293.40 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	兴银新锐量化选股混合 A	兴银新锐量化选股混合 C
下属分级基金的交易代码	027446	027447
报告期末下属分级基金的份 额总额	51,091,732.21 份	176,229,561.19 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，通过量化选股策略精选股票，力争获得超越业绩比较基准的收益。	
投资策略	本基金通过对宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时进行动态调整。	
业绩比较基准	中证全指指数收益率*70%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*10%+中债-综合全价（总值）指数收益率 *20%	
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，其预期风险和预期收益水平理论上高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。 本基金可投资港股通标的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
	兴银新锐量化选股混合 A	兴银新锐量化选股混合 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	姓名	张庄波	冯萌

责人	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	上海证券报
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06月09日（基金合同生效日）-2026年06月30日）	
	兴银新锐量化选股混合 A	兴银新锐量化选股混合 C
本期已实现收益	-1,423,905.74	-4,930,932.21
本期利润	-3,142,208.94	-10,857,439.67
加权平均基金份额本期利润	-0.0615	-0.0616
本期加权平均净值利润率	-6.22%	-6.23%
本期基金份额净值增长率	-6.15%	-6.16%
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	-3,142,208.94	-10,857,439.67
期末可供分配基金份额利润	-0.0615	-0.0616
期末基金资产净值	47,949,523.27	165,372,121.52
期末基金份额净值	0.9385	0.9384

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	-6.15%	-6.16%

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

兴银新锐量化选股混合 A 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
自基金合同生效起至今	-6.15%	1.36%	4.21%	1.18%	-10.36%	0.18%

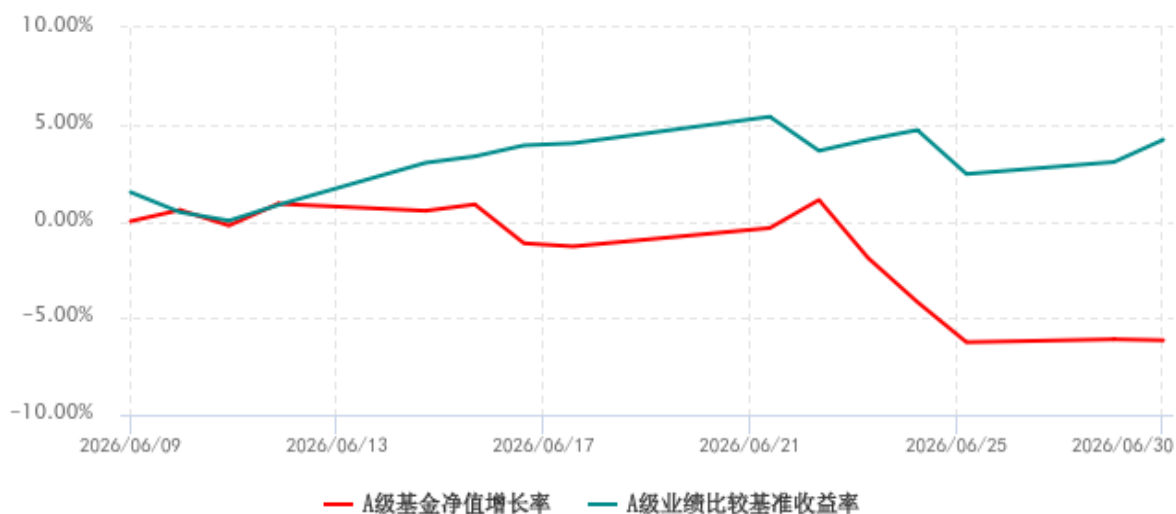
兴银新锐量化选股混合 C 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
自基金合同生效起至今	-6.16%	1.36%	4.21%	1.18%	-10.37%	0.18%

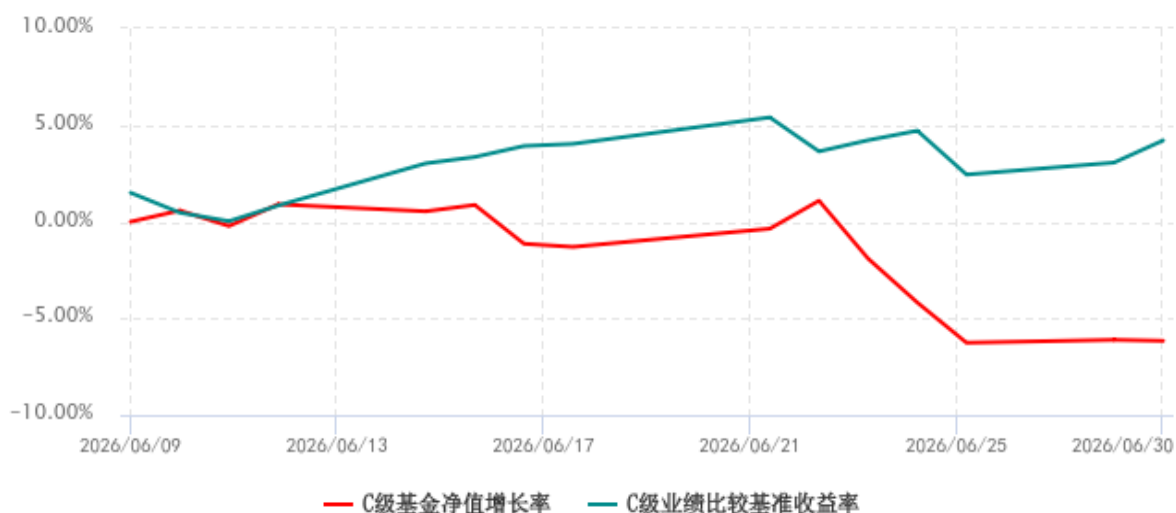
注：1、本基金成立于 2026 年 6 月 9 日；
2、中证全指指数收益率*70%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*10%+中债-综合全价(总值)指数收益率*20%。

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06月09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06月09日-2026年06月30日)



注：1、本基金成立于 2026 年 6 月 9 日；

2、中证全指指数收益率*70%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*10%+中债-综合全价(总值)指数收益率*20%；

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	2026-06-09	-	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间交易价差的分析，确保公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金于 2026 年 6 月 9 日成立。报告期内，市场风格分化较为明显，资金阶段性集中于大盘科技板块，中小市值股票整体承压。根据公开数据，万得微盘股指数自 2026 年 5 月 12 日至 6 月 30 日累计下跌约 22%。自 2015 年以来，万得微盘股指数仅出现过 8 次区间回撤超过 20% 的情况，本轮调整幅度已处于历史较深水平，中小盘股前期积累的交易拥挤和估值压力得到一定释放，中长期配置性价比逐步显现。

基金成立后有序开展建仓，通过量化选股模型重点配置中小市值股票，并将持仓数量控制在约 400 只以内，以充分分散个股风险。在组合管理过程中，基金采用市值轮动策略，动态减持短期涨幅较大、交易热度偏高的股票，增配调整较为充分、风险收益比较好的标的，通过纪律化交易实现组合轮动。同时，基金重视持仓流动性和交易成本管理，在控制组合风险的基础上，力争获取中小市值风格的长期收益。

截至 2026 年 6 月 30 日，本基金规模约 2 亿元，整体处于中小市值策略较为适宜的容量区间，个股调仓对市场价格的影响相对有限，组合换手产生的摩擦成本较低，有利于量化模型和轮动策略的有效执行。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴银新锐量化选股混合 A 基金份额净值为 0.9385 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-6.15%，同期业绩比较基准收益率为 4.21%；截至报告期末兴银新锐量化选股混合 C 基金份额净值为 0.9384 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-6.16%，同期业绩比较基准收益率为 4.21%。

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，随着前期较为集中的科技抱团行情逐步松动，市场有望由少数大盘科技股领涨，向更多行业和中小市值公司扩散。中小盘股并非科技行情的简单对立面，只要市场未形成极致抱团，在风险偏好回升和市场广度改善的环境中，中小盘与科技有望共同上涨。基金将继续坚持中小市值量化策略，严格控制个股风险与组合流动性，动态优化持仓结构和交易节奏，力争把握中小盘股调整后的修复机会，为持有人争取持续、稳健的超额收益。

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。

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：兴银新锐量化选股混合型证券投资基金

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	17,327,220.29
结算备付金		37,980,459.69
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	158,208,234.70
其中：股票投资		158,208,234.70
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		—
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.5	—
资产总计		213,515,914.68
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		—
应付管理人报酬		128,785.47
应付托管费		12,878.56
应付销售服务费		19,967.82
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	32,638.04
负债合计		194,269.89
净资产:		
实收基金	6.4.7.7	227,321,293.40
未分配利润	6.4.7.8	-13,999,648.61
净资产合计		213,321,644.79
负债和净资产总计		213,515,914.68

注：1、报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 227,321,293.40 份。其中兴银新锐量化选股混合 A 基金份额净值 0.9385 元，基金份额总额 51,091,732.21 份；兴银新锐量化选股混合 C 基金份额净值 0.9384 元，基金份额总额 176,229,561.19 份。

2、本基金于 2026 年 06 月 09 日成立，本财务报表的实际编制期间为 2026 年 06 月 09 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：兴银新锐量化选股混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 06 月 09 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 06 月 09 日（基金合同 生效日）至 2026 年 06 月 30 日
一、营业总收入		-13,818,152.52
1. 利息收入		6,529.43
其中：存款利息收入	6.4.7.9	6,529.43
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）		-6,179,871.29
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-6,489,540.49
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	-
股利收益	6.4.7.15	309,669.20
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	-7,644,810.66
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	-
减：二、营业总支出		181,496.09
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	128,785.47
2. 托管费	6.4.10.2.2	12,878.56
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	19,967.82
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		-
8. 其他费用	6.4.7.19	19,864.24
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-13,999,648.61
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-13,999,648.61
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-13,999,648.61

6.3 净资产变动表

会计主体：兴银新锐量化选股混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 06 月 09 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 06 月 09 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	227,321,293.40	-	227,321,293.40
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-13,999,648.61	-13,999,648.61
（一）、综合收益总额	-	-13,999,648.61	-13,999,648.61
（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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
（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	227,321,293.40	-13,999,648.61	213,321,644.79

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

兴银新锐量化选股混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可〔2026〕723 号注册募集。《兴银新锐量化选股混合型证券投资基金基金合同》于 2026 年 6 月 9 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 227,321,293.4 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《兴银新锐量化选股混合型证券投资基金基金合同》等法律文件约定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、科创板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、政府支持债券、次级债、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、

地方政府债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券)、资产支持证券、股指期货、股票期权、国债期货、信用衍生品、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可根据法律法规的规定参与融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为:股票投资(含存托凭证)比例为基金资产的 60%-95%,其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%;每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中,现金 不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为:中证全指指数收益率*70%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*10%+中债-综合全价(总值)指数收益率*20%。

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 6 月 9 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 6 月 9 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 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

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	17,327,220.29

等于：本金	17,325,535.89
加：应计利息	1,684.40
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	17,327,220.29

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	165,853,045.36	-	158,208,234.70	-7,644,810.66
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	165,853,045.36	-	158,208,234.70	-7,644,810.66

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

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

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：本基金于本报告期末无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无其他资产。

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	19,864.24
其他应付	12,773.80
合计	32,638.04

6.4.7.7 实收基金

兴银新锐量化选股混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 06 月 09 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	51,091,732.21	51,091,732.21
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	51,091,732.21	51,091,732.21

兴银新锐量化选股混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 06 月 09 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	176,229,561.19	176,229,561.19
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	176,229,561.19	176,229,561.19

注：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

兴银新锐量化选股混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-1,423,905.74	-1,718,303.20	-3,142,208.94
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,423,905.74	-1,718,303.20	-3,142,208.94

兴银新锐量化选股混合 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-4,930,932.21	-5,926,507.46	-10,857,439.67
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,930,932.21	-5,926,507.46	-10,857,439.67

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 06 月 09 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	5,746.88
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	602.54
其他	180.01
合计	6,529.43

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 06 月 09 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	173,620,615.06

减：卖出股票成本总额	179,886,388.77
减：交易费用	223,766.78
买卖股票差价收入	-6,489,540.49

6.4.7.10.2 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期无证券出借差价收入。

6.4.7.11 债券投资收益

注：本基金在本报告期内无债券投资收益。

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

6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金在本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.13.2 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

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。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金在本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 06 月 09 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	309,669.20
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	309,669.20

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 06 月 09 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-7,644,810.66
——股票投资	-7,644,810.66
——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	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-7,644,810.66

6.4.7.17 其他收入

注：本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.18 信用减值损失

注：本基金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 06 月 09 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	3,844.72
信息披露费	16,019.52
证券出借违约金	-
合计	19,864.24

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至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

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 06 月 09 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	519,360,049.19	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 06 月 09 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	135,035.24	100.00%	0.00	0.00%

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 06 月 09 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	128,785.47
其中：应支付销售机构的客户维护费	63,099.28
应支付基金管理人的净管理费	65,686.19

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.2%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$$

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 06 月 09 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	12,878.56

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

基金托管费每日计提，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 06 月 09 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		
	兴银新锐量化选股混合 A	兴银新锐量化选股混合 C	合计

华福证券	-	19,399.17	19,399.17
合计	-	19,399.17	19,399.17

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 0.40%。销售服务费计提的计算公式如下：

$$H=E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

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

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：本基金本报告期末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：本基金本报告期末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投资过本基金。

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

兴银新锐量化选股混合 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 06 月 30 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
兴瀚资管	3,000,083.33	1.32%

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 06 月 09 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	17,327,220.29	5,746.88

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：本基金本报告期末未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无其他需要说明的关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

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
603137	恒尚 节能	2026- 06-16	重大 事项 停牌	12.94	2026- 07-01	-	43,600	499,496.00	564,184.00	-

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**

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：本基金于本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末未持有需按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末未持有需按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金于本报告期末未持有按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末未持有需按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末未持有需按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	17,327,220.29	-	-	-	-	-	17,327,220.29
结算备付金	37,980,459.69	-	-	-	-	-	37,980,459.69
交易性金融资产	-	-	-	-	-	158,208,234.	158,208,234.

						70	, 2 0 8 , 2 3 4 . 7 0
资产总计	55,307,679 .98	-	-	-	-	158, 208, 234. 70	2 1 3 , 5 1 5 , 9 1 4 . 6 8
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	128, 785. 47	1 2 8 , 7 8 5 . 4 7
应付托管费	-	-	-	-	-	12,8 78.5 6	1 2 , 8 7 8 . 5

							6
应付销售服务费	-	-	-	-	-	19,967.82	19,967.82
其他负债	-	-	-	-	-	32,638.04	32,638.04
负债总计	-	-	-	-	-	194,269.89	194,269.89
利率敏感度缺口	55,307,679.98	-	-	-	-	158,013,964.81	213,321,644.79

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	158,208,234.70	74.16
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	158,208,234.70	74.16

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%	5,537,123.02

	沪深 300 指数下跌 5%	-5, 537, 123. 02
--	----------------	------------------

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	157, 644, 050. 70
第二层次	564, 184. 00
第三层次	—
合计	158, 208, 234. 70

6. 4. 14. 2. 2 公允价值所属层次间的重大变动

无。

6. 4. 14. 3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 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	158,208,234.70	74.10
	其中：股票	158,208,234.70	74.10
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	55,307,679.98	25.90
8	其他各项资产	—	—
9	合计	213,515,914.68	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	2,468,841.00	1.16
B	采矿业	488,334.00	0.23
C	制造业	108,601,549.61	50.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,089,650.00	0.51
E	建筑业	2,921,498.00	1.37
F	批发和零售业	7,499,951.00	3.52
G	交通运输、仓储和邮政业	2,618,754.00	1.23
H	住宿和餐饮业	457,639.00	0.21
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,756,077.75	5.04
J	金融业	—	—
K	房地产业	1,612,002.00	0.76
L	租赁和商务服务业	1,590,238.00	0.75
M	科学研究和技术服务业	8,365,958.25	3.92
N	水利、环境和公共设施管理业	5,493,747.09	2.58
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	1,229,163.00	0.58
Q	卫生和社会工作	1,128,295.00	0.53
R	文化、体育和娱乐业	1,886,537.00	0.88
S	综合	—	—
	合计	158,208,234.70	74.16

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	605069	正和生态	54,000	889,920.00	0.42
2	688450	光格科技	11,443	766,566.57	0.36
3	002910	庄园牧场	57,500	637,100.00	0.30
4	603137	恒尚节能	43,600	564,184.00	0.26
5	688338	赛科希德	18,396	542,865.96	0.25
6	603700	宁水集团	46,700	542,187.00	0.25
7	600405	动力源	119,700	541,044.00	0.25
8	688071	华依科技	14,624	532,898.56	0.25
9	688026	洁特生物	33,646	528,578.66	0.25
10	688670	金迪克	30,603	518,414.82	0.24
11	688426	康为世纪	27,704	508,091.36	0.24
12	688265	南模生物	14,575	504,149.25	0.24
13	603917	合力科技	42,900	503,646.00	0.24
14	688659	元琛科技	48,009	501,213.96	0.23
15	688251	井松智能	19,455	498,631.65	0.23
16	002442	龙星科技	100,900	497,437.00	0.23
17	688193	仁度生物	8,962	495,598.60	0.23
18	688355	明志科技	25,707	494,859.75	0.23
19	603818	曲美家居	166,500	494,505.00	0.23
20	603819	神力股份	43,000	492,350.00	0.23
21	002828	贝肯能源	46,200	488,334.00	0.23
22	603282	亚光股份	33,300	475,191.00	0.22
23	600419	天润乳业	62,600	473,882.00	0.22
24	002136	安纳达	36,000	470,880.00	0.22
25	605151	西上海	26,500	466,665.00	0.22
26	603836	海程邦达	59,060	466,574.00	0.22
27	603183	建研院	131,300	466,115.00	0.22
28	600560	金自天正	41,800	463,144.00	0.22
29	603136	天目湖	55,200	462,576.00	0.22
30	603787	新日股份	50,700	460,863.00	0.22
31	301520	万邦医药	14,160	460,200.00	0.22
32	300717	华信新材	21,600	460,080.00	0.22
33	600444	国机通用	35,400	459,492.00	0.22
34	600854	春兰股份	112,800	459,096.00	0.22
35	603307	扬州金泉	19,600	457,660.00	0.21

36	601007	金陵饭店	74,900	457,639.00	0.21
37	600594	益佰制药	153,900	457,083.00	0.21
38	688517	金冠电气	26,128	456,717.44	0.21
39	688651	盛邦安全	14,170	456,557.40	0.21
40	688137	近岸蛋白	12,682	456,552.00	0.21
41	603356	华菱精工	27,600	455,952.00	0.21
42	603059	倍加洁	18,800	455,900.00	0.21
43	600613	神奇制药	102,500	455,100.00	0.21
44	603289	泰瑞机器	56,300	454,341.00	0.21
45	603321	梅轮电梯	79,200	453,024.00	0.21
46	603616	韩建河山	75,000	453,000.00	0.21
47	002159	三特索道	36,600	452,742.00	0.21
48	600455	博通股份	20,600	452,376.00	0.21
49	603860	中公高科	18,700	452,353.00	0.21
50	600097	开创国际	58,100	452,018.00	0.21
51	603331	百达精工	42,400	451,984.00	0.21
52	603329	上海雅仕	50,300	451,694.00	0.21
53	603102	百合股份	14,300	451,451.00	0.21
54	688573	信宇人	25,436	450,725.92	0.21
55	603208	江山欧派	42,100	450,470.00	0.21
56	605001	威奥股份	82,600	450,170.00	0.21
57	600833	第一医药	49,900	450,098.00	0.21
58	603029	天鹅股份	32,000	449,920.00	0.21
59	001387	雪祺电气	35,200	449,504.00	0.21
60	600051	宁波联合	79,800	449,274.00	0.21
61	603385	惠达卫浴	92,000	448,960.00	0.21
62	600858	银座股份	101,700	448,497.00	0.21
63	605122	四方新材	41,600	448,448.00	0.21
64	688316	青云科技	8,302	448,308.00	0.21
65	603096	新经典	33,500	448,230.00	0.21
66	605567	春雪食品	56,000	447,440.00	0.21
67	600232	金鹰股份	70,900	446,670.00	0.21
68	003017	大洋生物	19,420	446,660.00	0.21
69	603177	德创环保	54,000	446,580.00	0.21
70	000955	欣龙控股	101,700	446,463.00	0.21
71	603810	丰山集团	40,100	446,313.00	0.21
72	600697	欧亚集团	45,900	446,148.00	0.21
73	603182	嘉华股份	39,100	445,740.00	0.21
74	603214	爱婴室	36,800	445,648.00	0.21
75	603176	汇通集团	104,100	445,548.00	0.21
76	603709	中源家居	32,900	445,466.00	0.21
77	688369	致远互联	21,186	445,117.86	0.21
78	600774	汉商集团	71,100	445,086.00	0.21

79	605266	健之佳	30,400	445,056.00	0.21
80	603326	我乐家居	72,200	444,752.00	0.21
81	300562	乐心医疗	32,900	444,479.00	0.21
82	603909	建发合诚	52,100	444,413.00	0.21
83	603041	美思德	42,800	443,836.00	0.21
84	603332	苏州龙杰	43,900	443,829.00	0.21
85	603839	安正时尚	76,900	443,713.00	0.21
86	603506	南都物业	47,500	443,650.00	0.21
87	600883	博闻科技	63,300	443,100.00	0.21
88	600235	民丰特纸	89,100	442,827.00	0.21
89	603073	彩蝶实业	29,700	442,827.00	0.21
90	605003	众望布艺	21,600	442,800.00	0.21
91	603982	泉峰汽车	79,200	442,728.00	0.21
92	603900	莱绅通灵	78,600	442,518.00	0.21
93	600371	万向德农	70,800	442,500.00	0.21
94	603168	莎普爱思	93,700	442,264.00	0.21
95	600099	林海股份	55,300	441,294.00	0.21
96	600148	长春一东	30,400	441,104.00	0.21
97	605033	美邦股份	26,500	440,960.00	0.21
98	603089	正裕工业	52,800	440,880.00	0.21
99	688468	科美诊断	77,362	440,189.78	0.21
100	603238	诺邦股份	40,000	440,000.00	0.21
101	603151	邦基科技	40,000	439,600.00	0.21
102	603086	先达股份	84,700	439,593.00	0.21
103	600706	曲江文旅	65,200	438,796.00	0.21
104	603536	惠发食品	56,300	438,577.00	0.21
105	688078	龙软科技	20,823	438,324.15	0.21
106	600137	浪莎股份	27,000	438,210.00	0.21
107	600493	凤竹纺织	83,600	438,064.00	0.21
108	600661	昂立教育	63,300	437,403.00	0.21
109	603028	赛福天	67,600	437,372.00	0.21
110	603079	圣达生物	38,600	436,952.00	0.20
111	600128	苏豪弘业	57,500	436,425.00	0.20
112	603768	常青股份	47,800	436,414.00	0.20
113	605180	华生科技	36,800	436,080.00	0.20
114	603908	牧高笛	25,800	435,504.00	0.20
115	300195	长荣股份	74,100	434,967.00	0.20
116	688638	誉辰智能	13,948	434,759.16	0.20
117	600992	贵绳股份	50,300	433,586.00	0.20
118	688113	联测科技	12,319	432,396.90	0.20
119	603022	新通联	54,100	432,259.00	0.20
120	603172	万丰股份	26,300	432,109.00	0.20
121	600802	福建水泥	104,800	431,776.00	0.20

122	600257	大湖股份	99,700	431,701.00	0.20
123	688092	爱科科技	20,307	431,320.68	0.20
124	605155	西大门	36,400	430,976.00	0.20
125	688118	普元信息	21,372	430,004.64	0.20
126	603755	日辰股份	18,900	428,841.00	0.20
127	688420	美腾科技	20,349	428,753.43	0.20
128	688565	力源科技	45,325	428,321.25	0.20
129	688695	中创股份	22,898	428,192.60	0.20
130	603968	醋化股份	46,200	427,812.00	0.20
131	688132	邦彦技术	32,515	427,572.25	0.20
132	600692	亚通股份	78,500	426,255.00	0.20
133	688329	艾隆科技	20,995	424,308.95	0.20
134	600359	新农开发	78,400	423,360.00	0.20
135	688395	正弦电气	19,133	422,839.30	0.20
136	001205	盛航股份	30,900	422,712.00	0.20
137	688067	爱威科技	20,953	422,202.95	0.20
138	688203	海正生材	42,260	421,754.80	0.20
139	688004	博汇科技	23,057	419,637.40	0.20
140	688013	天臣医疗	16,974	418,748.58	0.20
141	002084	海鸥住工	120,200	418,296.00	0.20
142	688681	科汇股份	29,889	417,848.22	0.20
143	605177	东亚药业	24,400	417,484.00	0.20
144	001324	长青科技	22,700	417,226.00	0.20
145	688288	鸿泉技术	23,473	417,115.21	0.20
146	688560	明冠新材	35,194	417,048.90	0.20
147	002857	三晖电气	23,700	416,409.00	0.20
148	688393	安必平	23,367	415,465.26	0.19
149	688060	云涌科技	12,620	415,071.80	0.19
150	688244	永信至诚	28,883	411,871.58	0.19
151	301336	趣睡科技	10,300	411,485.00	0.19
152	688058	宝兰德	19,653	411,140.76	0.19
153	688613	奥精医疗	29,125	410,953.75	0.19
154	688217	睿昂基因	19,859	410,286.94	0.19
155	688616	西力科技	40,593	409,989.30	0.19
156	300412	迦南科技	89,600	408,576.00	0.19
157	688021	奥福科技	20,949	405,572.64	0.19
158	688089	嘉必优	38,218	405,492.98	0.19
159	300637	扬帆新材	39,000	404,820.00	0.19
160	002760	凤形股份	24,600	403,932.00	0.19
161	688296	和达科技	34,969	400,045.36	0.19
162	002660	茂硕电源	61,500	399,750.00	0.19
163	003011	海象新材	22,000	399,740.00	0.19
164	000790	华神科技	114,300	398,907.00	0.19

165	688528	秦川物联	43,575	398,275.50	0.19
166	002524	光正眼科	119,900	396,869.00	0.19
167	001278	一彬科技	25,800	396,804.00	0.19
168	688466	金科环境	30,923	396,742.09	0.19
169	000715	中兴商业	85,300	395,792.00	0.19
170	001373	翔腾新材	13,100	394,965.00	0.19
171	002775	文科股份	115,600	394,196.00	0.18
172	301390	经纬股份	12,200	393,572.00	0.18
173	002909	集泰股份	79,600	393,224.00	0.18
174	002687	乔治白	75,000	393,000.00	0.18
175	603180	金牌家居	28,600	392,392.00	0.18
176	001336	楚环科技	17,800	391,956.00	0.18
177	688051	佳华科技	16,957	389,671.86	0.18
178	001202	炬申股份	28,700	388,885.00	0.18
179	002381	双箭股份	75,000	388,500.00	0.18
180	003008	开普检测	22,700	387,489.00	0.18
181	002234	民和股份	60,200	385,882.00	0.18
182	002893	京能热力	41,700	385,725.00	0.18
183	002858	力盛体育	35,300	385,123.00	0.18
184	002696	百洋股份	77,400	384,678.00	0.18
185	002890	弘宇股份	26,900	384,401.00	0.18
186	002809	红墙股份	51,600	383,904.00	0.18
187	002852	道道全	54,100	383,569.00	0.18
188	002576	通达动力	27,100	383,465.00	0.18
189	000633	合金投资	80,500	383,180.00	0.18
190	003003	天元股份	38,500	383,075.00	0.18
191	000014	沙河股份	41,900	382,547.00	0.18
192	002172	澳洋健康	135,600	382,392.00	0.18
193	301585	蓝宇股份	15,160	382,183.60	0.18
194	300935	盈建科	13,000	381,420.00	0.18
195	002492	恒基达鑫	70,400	380,864.00	0.18
196	000153	丰原药业	75,000	380,250.00	0.18
197	688597	煜邦电力	58,492	380,198.00	0.18
198	002778	中晟高科	25,000	380,000.00	0.18
199	002813	路畅科技	20,100	379,890.00	0.18
200	301108	洁雅股份	16,100	379,799.00	0.18
201	301135	瑞德智能	23,000	378,810.00	0.18
202	002799	环球印务	62,500	378,125.00	0.18
203	000419	通程控股	83,700	377,487.00	0.18
204	300746	汉嘉数智	34,900	377,269.00	0.18
205	002144	宏达高科	38,300	377,255.00	0.18
206	000985	大庆华科	26,500	377,095.00	0.18
207	000856	冀东装备	52,700	376,805.00	0.18

208	300992	泰福泵业	15,100	376,443.00	0.18
209	002998	优彩资源	57,800	376,278.00	0.18
210	002671	龙泉股份	101,400	376,194.00	0.18
211	002999	天禾股份	70,700	376,124.00	0.18
212	300884	狄耐克	37,900	375,968.00	0.18
213	002022	科华生物	82,000	375,560.00	0.18
214	300956	英力股份	33,400	375,416.00	0.18
215	002652	扬子新材	88,000	374,880.00	0.18
216	300923	研奥股份	16,800	374,304.00	0.18
217	002343	慈文传媒	85,800	374,088.00	0.18
218	001260	坤泰股份	23,900	374,035.00	0.18
219	300950	德固特	22,300	373,971.00	0.18
220	301098	金埔园林	45,500	373,100.00	0.17
221	300517	海波重科	39,600	373,032.00	0.17
222	002682	龙洲股份	87,900	372,696.00	0.17
223	000705	浙江震元	63,700	372,645.00	0.17
224	002942	新农股份	26,000	372,580.00	0.17
225	002802	洪汇新材	35,400	372,408.00	0.17
226	688038	中科通达	22,137	372,344.34	0.17
227	300891	惠云钛业	58,800	372,204.00	0.17
228	002817	黄山胶囊	63,400	371,524.00	0.17
229	300694	蠡湖股份	38,700	371,520.00	0.17
230	002591	恒大高新	60,700	371,484.00	0.17
231	001255	博菲电气	14,800	371,332.00	0.17
232	003023	彩虹集团	19,100	371,304.00	0.17
233	002105	信隆健康	75,100	370,994.00	0.17
234	000548	湖南投资	90,700	370,963.00	0.17
235	002661	克明食品	53,300	369,369.00	0.17
236	000702	正虹科技	74,400	369,024.00	0.17
237	300513	恒实科技	50,900	368,516.00	0.17
238	002780	三夫户外	30,300	367,842.00	0.17
239	001366	播恩集团	33,900	367,476.00	0.17
240	300615	欣天科技	36,600	367,098.00	0.17
241	300340	科恒股份	42,000	367,080.00	0.17
242	003042	中农联合	30,200	366,930.00	0.17
243	002949	华阳国际	37,000	365,930.00	0.17
244	001234	泰慕士	18,600	365,304.00	0.17
245	002205	国统股份	36,200	365,258.00	0.17
246	301633	港迪技术	7,800	365,118.00	0.17
247	002295	精艺股份	43,000	364,640.00	0.17
248	300564	筑博设计	30,300	363,903.00	0.17
249	001209	洪兴股份	22,700	363,654.00	0.17
250	300883	龙利得	57,600	363,456.00	0.17

251	002790	瑞尔特	68,200	362,824.00	0.17
252	002732	燕塘乳业	29,200	362,080.00	0.17
253	300971	博亚精工	19,400	362,004.00	0.17
254	001277	速达股份	13,100	361,429.00	0.17
255	002820	桂发祥	43,000	361,200.00	0.17
256	300150	世纪瑞尔	90,900	360,873.00	0.17
257	301159	三维天地	12,400	360,840.00	0.17
258	301331	恩威医药	16,400	360,800.00	0.17
259	000605	渤海股份	67,400	360,590.00	0.17
260	000812	陕西金叶	116,300	360,530.00	0.17
261	300929	华骐环保	34,200	360,468.00	0.17
262	002968	新大正	42,500	359,550.00	0.17
263	001231	农心科技	19,700	359,328.00	0.17
264	002862	实丰文化	28,000	359,240.00	0.17
265	300928	华安鑫创	12,400	358,112.00	0.17
266	001368	通达创智	17,400	357,918.00	0.17
267	300753	爱朋医疗	18,900	357,777.00	0.17
268	301300	远翔新材	11,400	357,618.00	0.17
269	300653	正海生物	24,900	357,564.00	0.17
270	300103	达刚控股	46,600	357,422.00	0.17
271	000590	古汉医药	43,700	357,029.00	0.17
272	002494	华斯股份	80,200	356,088.00	0.17
273	300417	南华仪器	34,700	356,022.00	0.17
274	301166	优宁维	13,800	355,902.00	0.17
275	003027	同兴科技	20,400	355,572.00	0.17
276	300707	威唐工业	31,800	355,524.00	0.17
277	001219	青岛食品	31,000	355,260.00	0.17
278	300640	德艺文创	63,000	354,690.00	0.17
279	301083	百胜智能	26,900	354,273.00	0.17
280	300025	华星创业	84,300	354,060.00	0.17
281	300771	智莱科技	34,300	353,976.00	0.17
282	002836	新宏泽	38,300	353,892.00	0.17
283	301198	喜悦智行	26,400	353,760.00	0.17
284	301024	霍普股份	9,600	353,472.00	0.17
285	000573	粤宏远 A	99,800	353,292.00	0.17
286	300977	深圳瑞捷	22,900	353,118.00	0.17
287	301170	锡南科技	16,400	352,764.00	0.17
288	000757	浩物股份	103,400	352,594.00	0.17
289	300519	新光药业	29,700	351,945.00	0.16
290	300597	吉大通信	49,700	351,876.00	0.16
291	300784	利安科技	8,300	351,671.00	0.16
292	300583	赛托生物	31,300	351,499.00	0.16
293	300112	万讯自控	56,700	350,973.00	0.16

294	301036	双乐股份	16,000	350,880.00	0.16
295	000619	海螺新材	79,700	350,680.00	0.16
296	300514	友讯达	37,500	350,625.00	0.16
297	300743	天地数码	24,000	350,160.00	0.16
298	301378	通达海	14,600	350,108.00	0.16
299	301130	西点药业	14,593	349,940.14	0.16
300	300675	建科院	29,500	349,575.00	0.16
301	300605	恒锋信息	37,800	349,272.00	0.16
302	301103	何氏眼科	23,300	349,034.00	0.16
303	300141	和顺电气	37,100	348,369.00	0.16
304	301163	宏德股份	15,700	348,226.00	0.16
305	300610	晨化股份	35,700	348,075.00	0.16
306	300898	熊猫乳品	19,200	347,904.00	0.16
307	300535	达威股份	25,500	347,565.00	0.16
308	301065	本立科技	19,681	347,369.65	0.16
309	300851	交大思诺	15,600	347,100.00	0.16
310	300949	奥雅股份	17,200	346,924.00	0.16
311	300987	川网传媒	28,200	346,860.00	0.16
312	300635	中达安	28,500	346,845.00	0.16
313	301503	智迪科技	12,600	346,626.00	0.16
314	301011	华立科技	24,500	346,430.00	0.16
315	301185	鸥玛软件	23,300	346,238.00	0.16
316	300813	泰林生物	18,100	345,529.00	0.16
317	300960	通业科技	22,200	345,210.00	0.16
318	301388	欣灵电气	14,800	345,136.00	0.16
319	300549	优德精密	26,500	345,030.00	0.16
320	300778	新城市	36,100	344,755.00	0.16
321	300642	透景生命	29,200	344,560.00	0.16
322	301001	凯淳股份	15,900	344,553.00	0.16
323	300837	浙矿股份	14,500	344,520.00	0.16
324	300838	浙江力诺	25,800	344,430.00	0.16
325	301320	豪江智能	26,700	344,430.00	0.16
326	300612	宣亚国际	31,500	344,295.00	0.16
327	300387	富邦科技	50,700	344,253.00	0.16
328	300823	建科智能	23,600	344,088.00	0.16
329	300958	建工修复	32,300	343,672.00	0.16
330	300426	华智数媒	67,900	343,574.00	0.16
331	300335	迪森股份	70,500	343,335.00	0.16
332	300176	鸿特科技	70,700	342,895.00	0.16
333	300534	陇神戎发	48,400	342,672.00	0.16
334	301063	海锅股份	20,400	341,904.00	0.16
335	300350	华鹏飞	86,100	341,817.00	0.16
336	300961	深水海纳	26,600	341,810.00	0.16

337	300824	北鼎股份	47,600	341,768.00	0.16
338	300713	英可瑞	26,800	341,432.00	0.16
339	300422	博世科	81,100	341,431.00	0.16
340	300074	华平股份	100,400	341,360.00	0.16
341	300645	正元智慧	29,000	341,330.00	0.16
342	300240	飞力达	68,300	340,817.00	0.16
343	301167	建研设计	27,500	340,725.00	0.16
344	300371	汇中股份	34,800	340,344.00	0.16
345	301505	苏州规划	21,100	339,710.00	0.16
346	300800	力合科技	36,700	339,475.00	0.16
347	300359	全通教育	94,800	339,384.00	0.16
348	301601	惠通科技	21,700	338,954.00	0.16
349	301010	晶雪节能	20,800	338,832.00	0.16
350	301022	海泰科	15,000	338,400.00	0.16
351	301515	港通医疗	19,300	338,329.00	0.16
352	301192	泰祥股份	17,900	338,310.00	0.16
353	301009	可靠股份	41,400	338,238.00	0.16
354	301298	东利机械	29,200	337,844.00	0.16
355	301578	辰奕智能	16,540	337,250.60	0.16
356	301258	富士莱	14,800	336,996.00	0.16
357	301126	达嘉维康	39,400	336,870.00	0.16
358	300906	日月明	13,500	336,555.00	0.16
359	301353	普莱得	20,230	336,020.30	0.16
360	301272	英华特	10,200	335,988.00	0.16
361	301533	威马农机	14,200	335,972.00	0.16
362	301049	超越科技	18,800	335,768.00	0.16
363	301032	新柴股份	36,100	335,730.00	0.16
364	301052	果麦文化	15,100	335,522.00	0.16
365	301131	聚赛龙	10,438	335,372.94	0.16
366	301105	鸿铭股份	7,800	335,244.00	0.16
367	301359	东南电子	21,100	335,068.00	0.16
368	301156	美农生物	30,800	334,796.00	0.16
369	300543	朗科智能	46,400	334,544.00	0.16
370	300126	锐奇股份	57,700	333,506.00	0.16
371	002982	湘佳股份	31,600	333,380.00	0.16
372	300844	山水比德	15,000	333,150.00	0.16
373	300732	设研院	59,800	333,086.00	0.16
374	300575	中旗股份	67,700	333,084.00	0.16
375	300892	品渥食品	17,700	332,406.00	0.16
376	300405	科隆股份	64,000	331,520.00	0.16
377	300886	华业香料	16,600	330,340.00	0.15
378	301006	迈拓股份	26,300	330,065.00	0.15
379	300995	奇德新材	12,300	329,763.00	0.15

380	002114	罗平锌电	45,600	329,688.00	0.15
381	300155	安居宝	84,100	329,672.00	0.15
382	300942	易瑞生物	57,000	329,460.00	0.15
383	301429	森泰股份	21,000	329,070.00	0.15
384	301037	保立佳	27,400	328,800.00	0.15
385	300947	德必集团	25,700	327,675.00	0.15
386	301519	舜禹股份	30,200	327,670.00	0.15
387	301229	纽泰格	27,000	327,240.00	0.15
388	300621	维业股份	51,500	327,025.00	0.15
389	300703	创源股份	25,500	325,635.00	0.15
390	300556	丝路视觉	18,700	324,819.00	0.15
391	300937	药易购	16,800	324,072.00	0.15
392	300865	大宏立	14,800	323,380.00	0.15
393	301539	宏鑫科技	24,600	322,260.00	0.15
394	300305	裕兴股份	54,800	321,128.00	0.15
395	301287	康力源	9,900	319,671.00	0.15
396	300876	蒙泰高新	22,300	319,559.00	0.15
397	301113	雅艺科技	21,340	318,179.40	0.15
398	300254	仟源医药	39,500	316,395.00	0.15
399	603956	威派格	48,000	302,400.00	0.14
400	300665	飞鹿股份	24,600	251,658.00	0.12

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	605069	正和生态	1,083,041.00	0.51
2	688450	光格科技	1,061,523.05	0.50
3	002910	庄园牧场	968,761.00	0.45
4	688026	洁特生物	957,119.49	0.45
5	688426	康为世纪	948,816.31	0.44
6	688092	爱科科技	939,561.87	0.44
7	688338	赛科希德	937,265.58	0.44
8	688659	元琛科技	932,905.55	0.44
9	603700	宁水集团	931,896.00	0.44
10	688193	仁度生物	924,640.06	0.43
11	688251	井松智能	923,987.63	0.43
12	002442	龙星科技	921,447.00	0.43
13	603917	合力科技	919,982.00	0.43
14	688071	华依科技	910,570.49	0.43
15	301024	霍普股份	908,857.00	0.43

16	688265	南模生物	905,380.91	0.42
17	688316	青云科技	904,717.73	0.42
18	000955	欣龙控股	904,129.00	0.42
19	600405	动力源	895,641.00	0.42
20	603819	神力股份	893,374.00	0.42

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	688450	光格科技	669,363.63	0.31
2	301337	亚华电子	574,434.00	0.27
3	688156	路德科技	574,028.88	0.27
4	688026	洁特生物	572,359.74	0.27
5	688338	赛科希德	544,207.83	0.26
6	300717	华信新材	541,167.00	0.25
7	301469	恒达新材	538,843.00	0.25
8	301108	洁雅股份	538,163.00	0.25
9	688718	唯赛勃	533,212.62	0.25
10	688357	建龙微纳	528,270.17	0.25
11	301335	天元宠物	527,605.00	0.25
12	301062	上海艾录	525,724.00	0.25
13	301395	仁信新材	523,116.00	0.25
14	000635	英力特	513,327.00	0.24
15	002723	小崧股份	511,709.00	0.24
16	300509	新美星	510,613.00	0.24
17	002767	先锋电子	510,311.00	0.24
18	300915	海融科技	506,433.00	0.24
19	301233	盛帮股份	505,817.00	0.24
20	300562	乐心医疗	504,788.00	0.24

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	345,739,434.13
卖出股票收入（成交）总额	173,620,615.06

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。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

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

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

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

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

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

本基金不存在前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情形。

7.12.3 期末其他各项资产构成

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	603137	恒尚节能	564,184.00	0.26	停牌

注：本基金本报告期末前十名股票投资的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

本报告中因四舍五入原因，投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
兴银新锐量化选股混合 A	590	86,596.16	3,783,877.64	7.41%	47,307,854.57	92.59%
兴银新锐量化选股混合 C	3,486	50,553.52	3,012,496.68	1.71%	173,217,064.51	98.29%

合计	4,076	55,770.68	6,796,374.32	2.99%	220,524,919.08	97.01%
----	-------	-----------	--------------	-------	----------------	--------

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	兴银新锐量化选股混合 A	49,616.48	0.10%
	兴银新锐量化选股混合 C	875.32	0.00%
	合计	50,491.80	0.02%

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	兴银新锐量化选股混合 A	0~10
	兴银新锐量化选股混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	兴银新锐量化选股混合 A	0
	兴银新锐量化选股混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	兴银新锐量化选股混合 A	兴银新锐量化选股混合 C
基金合同生效日（2026 年 06 月 09 日）基金 份额总额	51,091,732.21	176,229,561.19
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购 份额	-	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总 赎回份额	-	-
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	51,091,732.21	176,229,561.19

§ 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

报告期内基金投资策略未改变。

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	

华福证 券	2	519,360,049.19	100.00%	135,035.24	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。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

注：本基金本报告期租用证券公司交易单元未进行其他证券投资。

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	兴银新锐量化选股混合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	2026-05-14
2	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
3	兴银新锐量化选股混合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	2026-06-10

§ 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. 《兴银新锐量化选股混合型证券投资基金基金合同》
3. 《兴银新锐量化选股混合型证券投资基金招募说明书》
4. 《兴银新锐量化选股混合型证券投资基金托管协议》
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照
6. 报告期内在指定信息披露媒体上公开披露的各项公告
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