

# 兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证 券投资基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：兴证全球基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 03 月 30 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。

本报告期自 2021 年 02 月 09 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 其他指标 .....	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况 .....	10
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	14
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明 .....	14
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	15
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	15
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息 .....	15
6.2 审计报告的基本内容 .....	15
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>17</b>
7.1 资产负债表 .....	17
7.2 利润表 .....	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	20
7.4 报表附注 .....	21
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>91</b>

8.1 期末基金资产组合情况 .....	91
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	92
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	94
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	97
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	99
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	99
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	99
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	99
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	99
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	99
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	100
8.12 投资组合报告附注 .....	100
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>101</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	101
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	102
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	103
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>103</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>103</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	103
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	104
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	104
11.4 基金投资策略的改变 .....	104
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	104
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	104
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	104
11.8 其他重大事件 .....	106
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>109</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	109
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	110
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>111</b>
13.1 备查文件目录 .....	111
13.2 存放地点 .....	111
13.3 查阅方式 .....	111

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金	
基金简称	兴全中证 800 六个月持有指数	
基金主代码	010673	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 2 月 9 日	
基金管理人	兴证全球基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,857,684,582.36 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	兴全中证 800 六个月持有指数 A	兴全中证 800 六个月持有指数 C
下属分级基金的交易代码	010673	010674
报告期末下属分级基金的份额总额	1,670,491,950.92 份	187,192,631.44 份

注：本基金每份基金份额最短持有期为 6 个月。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对中证 800 指数进行有效跟踪的基础上，对基金投资组合进行相对增强，力争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	本基金采用指数复制结合相对增强的投资策略，即通过指数复制的方法拟合、跟踪中证 800 指数，并在严格控制与业绩比较基准偏离风险的前提下进行相对增强的组合管理，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×90%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期收益和预期风险高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。 本基金除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

### 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		兴证全球基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨卫东	张燕
	联系电话	021-20398888	0755-83199084

电子邮箱	yangwd@xqfunds.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话	4006780099, 021-38824536	95555
传真	021-20398858	0755-83195201
注册地址	上海市黄浦区金陵东路 368 号	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	上海市浦东新区芳甸路 1155 号嘉里城办公楼 28-30 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	201204	518040
法定代表人	杨华辉	缪建民

## 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.xqfunds.com">http://www.xqfunds.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市延安东路 222 号 30 楼
注册登记机构	兴证全球基金管理有限公司	上海市浦东新区芳甸路 1155 号浦东嘉里城办公楼 28-30 楼

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)-2021 年 12 月 31 日	
	兴全中证 800 六个月持有指数 A	兴全中证 800 六个月持有指数 C
本期已实现收益	22,891,337.59	2,357,118.99
本期利润	44,650,320.57	4,090,289.83
加权平均基金份额本期利润	0.0197	0.0128
本期加权平均净值利润率	1.98%	1.29%
本期基金份额净值增长率	2.64%	2.28%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	
期末可供分配利润	14,821,775.07	995,444.36
期末可供分配基金份额利润	0.0089	0.0053

期末基金资产净值	1,714,676,068.16	191,458,984.68
期末基金份额净值	1.0264	1.0228
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	
基金份额累计净值增长率	2.64%	2.28%

注：1、上述财务指标采用的计算公式，详见中国证券监督管理委员会发布的《证券投资基金信息披露编报规则第 1 号〈主要财务指标的计算及披露〉》、《证券投资基金会计核算业务指引》等相关法规。

2、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。

3、上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（例如：开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4、本基金于 2021 年 2 月 9 日生效。合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

### 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

兴全中证 800 六个月持有指数 A

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	4.34%	0.79%	1.48%	0.68%	2.86%	0.11%
过去六个月	2.02%	0.82%	-3.24%	0.88%	5.26%	-0.06%
自基金合同生效起至今	2.64%	0.65%	-6.08%	0.98%	8.72%	-0.33%

兴全中证 800 六个月持有指数 C

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	4.24%	0.79%	1.48%	0.68%	2.76%	0.11%
过去六个月	1.82%	0.82%	-3.24%	0.88%	5.06%	-0.06%
自基金合同生效起至今	2.28%	0.65%	-6.08%	0.98%	8.36%	-0.33%

注：1、本基金为指数增强型证券投资基金，标的指数是中证 800 指数，本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，按下列公式计算：

$$\text{Return}_t = 90\% \times (\text{中证 800 指数收益率}_t / \text{中证 800 指数收益率}_{t-1} - 1) + 5\% (\text{恒生指数收益率}_t / \text{恒生指数收益率}_{t-1} - 1) + 5\% \times (\text{银行活期存款利率}_t / 360)$$

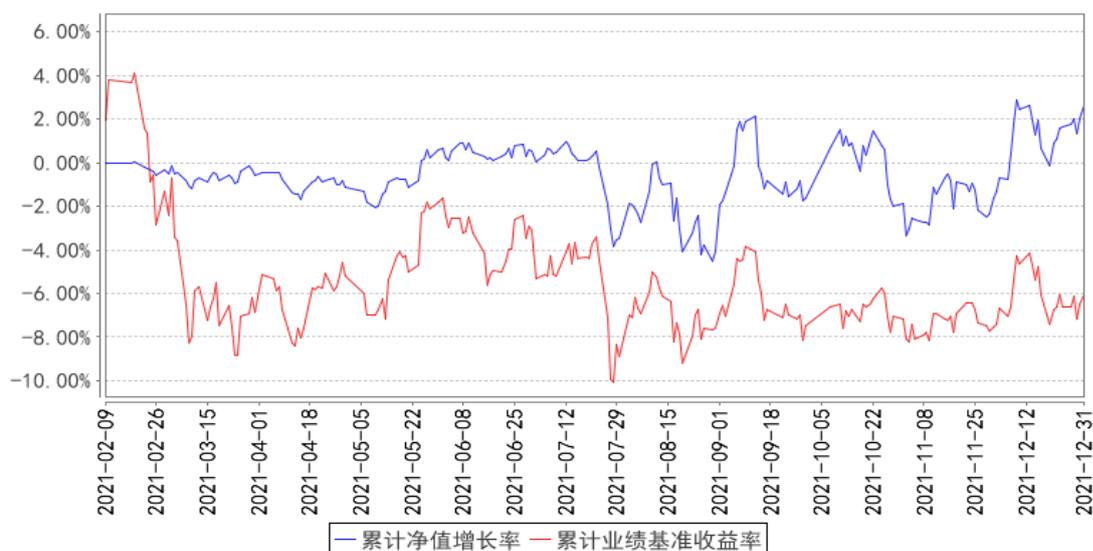
$$\text{Benchmark}_t = (1 + \text{Return}_t) \times (1 + \text{Benchmark}_{t-1}) - 1$$

其中， $t = 1, 2, 3, \dots, T$ ， $T$  表示时间截至日。

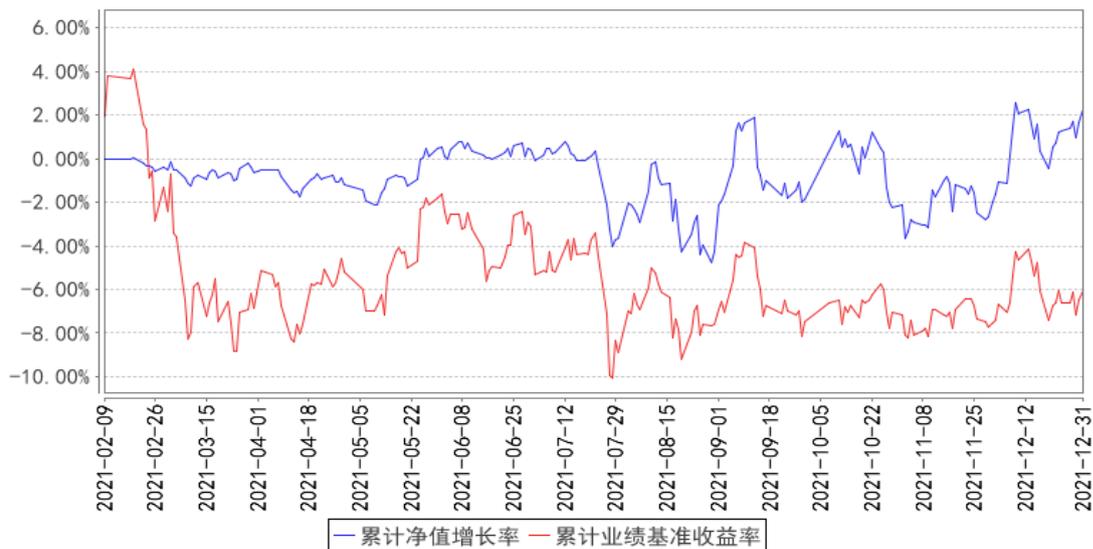
2、本基金基金合同生效日为 2021 年 2 月 9 日，截至报告期末本基金成立不满一年。

### 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

兴全中证 800 六个月持有期指数 A 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



兴全中证800六个月持有指数C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



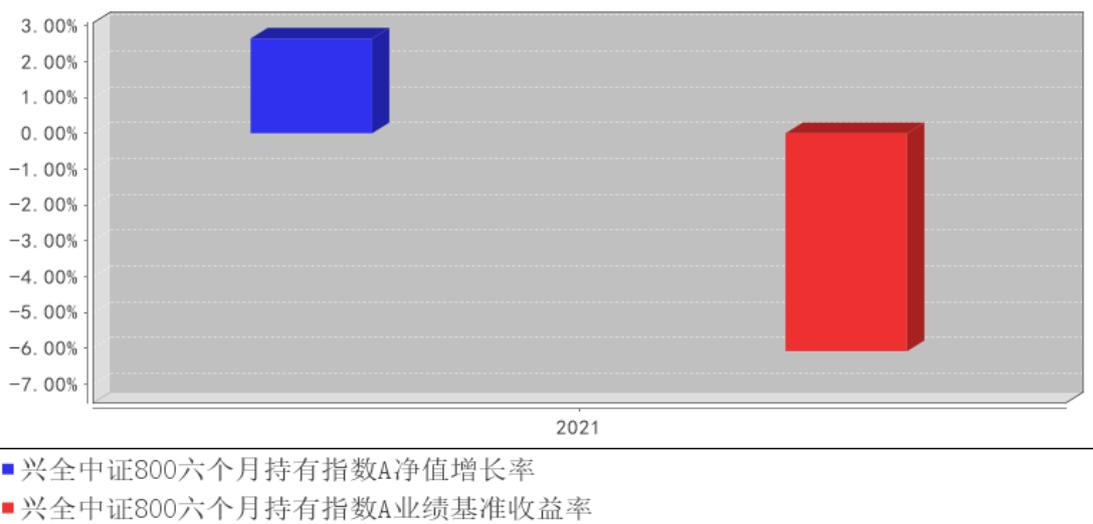
注：1、净值表现所取数据截至到 2021 年 12 月 31 日。

2、按照《兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金基金合同》的规定，本基金建仓期为 2021 年 02 月 09 日起共计六个月。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

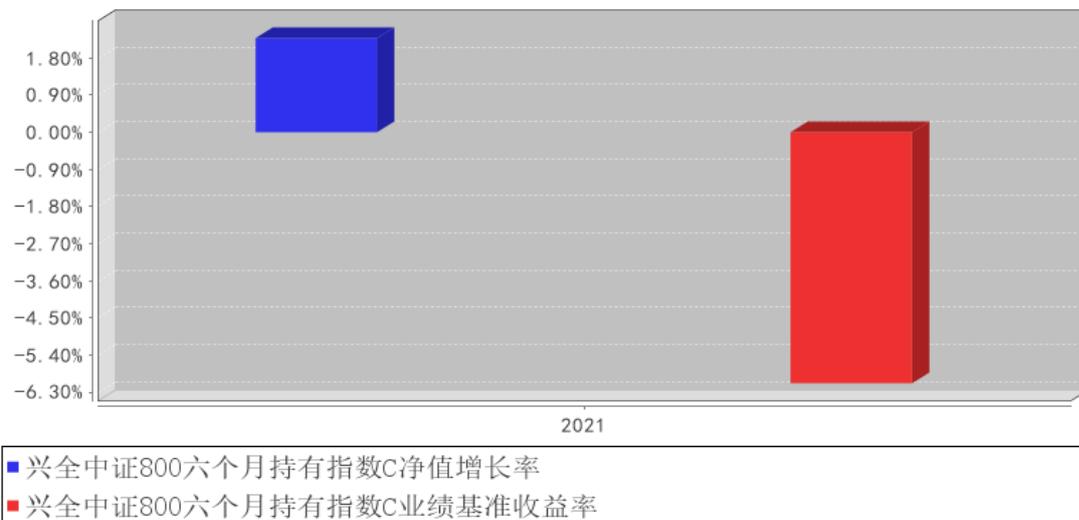
3、本基金基金合同生效日为 2021 年 2 月 9 日，截至报告期末本基金成立不满一年。

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

兴全中证800六个月持有指数A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



兴全中证800六个月持有指数C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：2021 年数据统计期间为 2021 年 2 月 9 日至 2021 年 12 月 31 日，数据按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 其他指标

注：无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金自合同生效日（2021年2月9日）至2021年12月31日期间未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

兴证全球基金管理有限公司（成立时名为“兴业基金管理有限公司”，以下简称“公司”）经证监基金字[2003]100号文批准于2003年9月30日成立。2008年1月，中国证监会批复（证监许可[2008]6号），同意全球人寿保险国际公司（AEGON International B.V）受让公司股权并成为公司股东。2008年4月9日，公司完成股权转让、变更注册资本等相关手续后，公司注册资本由9800万元变更为人民币1.2亿元，其中兴业证券股份有限公司的出资占注册资本的51%，全球人寿保险国际公司的出资占注册资本的49%。2008年7月，经中国证监会批准（证监许可[2008]888号），公司于2008年8月25日完成变更公司名称、注册资本等相关手续后，公司名称变更为“兴业全球基金管理有限公司”，注册资本增加为1.5亿元人民币，其中两股东出资比例不变。2016年12月28日，因公司发展需要，公司名称变更为“兴全基金管理有限公司”。2020年3月18日，公司名称变更为“兴证全球基金管理有限公司”。

截至 2021 年 12 月 31 日，公司旗下已管理兴全可转债混合型证券投资基金等共 47 只基金，包括股票型、混合型、债券型、货币型、指数型、FOF 等类型。

#### 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		
申庆	兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)、兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金基金经理	2021 年 2 月 9 日	-	24 年	硕士，历任兴业证券研究发展中心研究员，兴证全球基金管理有限公司行业研究员，兴全趋势投资混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理助理、兴全全球视野股票型证券投资基金基金经理、基金管理部总监助理、兴全恒益债券型证券投资基金基金经理。
张晓峰	兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金基金经理、兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金经理助理	2021 年 5 月 24 日	-	10 年	硕士，历任兴证全球基金管理有限公司 FOF 投资与金融工程部研究员、固定收益部研究员。

注：1、职务指截止报告期末的职务（报告期末仍在任的）或离任前的职务（报告期内离任的）。

2、任职日期指基金合同生效之日（基金成立时即担任基金经理）或公司作出聘任决定之日（基金成立后担任基金经理）；离任日期指公司作出解聘决定之日。

3、证券从业的涵义遵从行业的相关规定，包括资管相关行业从业经历。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利

益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人制定了《兴证全球基金管理有限公司公平交易管理办法》，并将不时进行修订。本基金管理人主要从研究的公平、决策的公平、交易的公平、公平交易的监控评估、公平交易的报告和信息披露等方面对公平交易行为进行规范，从而达到保证本基金管理人管理的不同投资组合得到公平对待、保护投资者合法权益的目的。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，确保各投资组合之间得到公平对待，保护投资者的合法权益。公司风险管理部对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异进行统计，从不同的角度分析差异的来源、考察是否存在不公平的因素。本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的公平交易制度，未发现违反公平交易原则的情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，不存在本投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况，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

下半年延续了极度分化的结构性行情，使得指数增强依旧成为一件具有挑战性的工作。下半年沪深 300、中证 500、创业板指的涨幅分别为-5.43%、8.10%、-4.44%，受益于对“专精特新”的扶持，中小市值风格突出，而交易拥挤度较高的“赛道”资产回撤明显。

随着上市公司盈利拐点的确认，以及稳增长预期增强，下半年的市场风格变得更为均衡，无论是高景气的“赛道”资产，还是高 ROE 稳定成长的“核心”资产，表现均较为一般。中小市值风格虽然相对较强，但波动也较大。之前我们判断高景气类资产的拐点可能由报表低于预期而触发，目前看仅仅情绪扰动，甚至无需低于预期也会导致了相关板块的回调。回头看，下半年表现相对一般的大市值“核心资产”和“高景气资产”两者共同特征是交易拥挤度高，多少都经历过抱团拔估值的正反馈，建立在一致预期上的高估值合理化信仰都给上述资产带来脆弱性。

在具体操作上，我们依然坚持在保持总体行业和风格均衡前提下的行业内相对综合价值比较

的选股策略,并积极把握各种确定性的超额收益甚至绝对收益。随着投资策略工具箱的不断扩大,我们有信心在未来复杂多变的市场环境中有效降低整体组合的下方风险,并持续积累更多的超额收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末兴全中证 800 六个月持有指数 A 的基金份额净值为 1.0264 元,本报告期基金份额净值增长率为 2.64%,同期业绩比较基准收益率为-6.08%;截至本报告期末兴全中证 800 六个月持有指数 C 的基金份额净值为 1.0228 元,本报告期基金份额净值增长率为 2.28%,同期业绩比较基准收益率为-6.08%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前宏观经济面临一定挑战,稳增长成为共识。货币政策进一步发力,央行于年初调降利率,宽信用也有所加码,一月份社融超预期。需要关注海外经济体加息造成的影响。

目前市场面临的问题是拥挤交易之后重归理性。虽然部分“核心”、“赛道”经历年初的调整,估值相对合理化,但一方面钟摆效应可能导致合理估值未必就是最合理的配置时机,另一方面上述资产的“合理”估值仍有很大程度上建立在高度趋同的一致预期上。此外,居民财富再配置的节奏也是重要的影响因素。

我们坚持之前的判断,历史上任何时期的情绪化高估值品种都会向合理水平回归。从投资研究实践看,我们仍认为市场对较为长期的未来并无太强的预测能力。无论是采用超长期预测的“终局”给出乐观的远期估值,还是草木皆兵地对一些政策甚至谣言过度反应,都反映出市场较为浮躁,高度情绪化。作为投资者,我们既要面向未来,努力从经济转型带来的新技术、新产业、新模式中获益,又不能简单地随波逐流,而是要独立思考,从第一性原理出发,进行合乎理性的定价。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人通过以下工作的开展,有力地保证了本基金整体运作的合法合规,从而最大程度地保护了基金份额持有人和其他相关当事人的合法权益:

1、实时风险监控:通过风控系统对本基金的运作进行实时监控,每日撰写监控日志,在此基础上每周撰写信息周报,对本基金遵守风控指标的情况进行汇总、分析和提示。

2、加强事后人工分析,并定期撰写风险管理报告。除系统控制外,公司风险管理部还对一些无法嵌入系统的风控指标进行了事后人工计算分析和复核,并同样反映在监控日志和信息周报中。

此外，在每个季度结束之后，公司风险管理部会对基金的流动性进行压力测试并出具书面报告，对旗下每只基金进行全面的风险评价并形成风险分析报告，并提交公司领导和基金经理审阅。

3、进一步加强对公平交易的监控。根据监管部门的要求以及公司公平交易相关工作的不断深入开展，公司进一步明确公平交易执行和分析中的具体标准，将公平交易问题分为交易的公平和投资策略的公平，主要包括：（1）明确交易部的分单规则及其识别异常下单行为的职责，保证交易的公平；（2）通过 T 检验、模拟利益输送金额、具体可疑交易分析等方法，对以往的下单及交易记录进行分析，保证投资策略的公平。

4、季度监察稽核和专项稽核：根据中国证监会《关于基金管理公司报送监察稽核报告的通知》以及《证券投资基金管理有限公司监察稽核报告内容与格式指引（试行）》等规定，认真做好公司各季度监察稽核工作。对照中国证监会的季度监察稽核项目表，对本基金的守法合规情况进行逐条检视。此外，在公司审计部对投研部门展开的专项稽核中，也会对本基金的业务进行全面检查。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：1、估值委员会制定旗下基金的估值政策和流程，选取适当的估值方法、定期对估值政策和程序进行评价。采用的基金估值方法、政策和程序应经估值委员会审议，并报管理层批准后方可实施。2、估值方法确立后，由 IT 人员或 IT 人员协助估值系统开发商及时对系统中的参数或模型作相应的调整或对系统进行升级，以适应新的估值方法的需要。3、基金会计具体负责执行估值委员会确定的估值策略，并通过与托管行核对等方法确保估值准确无误；4、投资人员（包括基金经理）积极关注市场环境变化及证券发行机构有关影响证券价格的重大事件等可能对给估值造成影响的因素，并就可能带来的影响提出建议和意见；5、监察稽核人员参与估值方案的制定，确保估值方案符合相关法律法规及基金合同的约定，定期对估值流程、系统估值模型及估值结果进行检查，确保估值委员会决议的有效执行，负责基金估值业务的定期和临时信息披露。

上述参与估值流程人员均具备估值业务所需的专业胜任能力。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，本报告期内未进行利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

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

本基金本报告期内未发生需披露的基金份额持有人数不满两百人或基金资产净值低于五千元的情形。

### § 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

#### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### § 6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(22)第 P01799 号

#### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计

	<p>准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	<p>兴证全球基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金 2021 年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金的财务报告过程。</p>

注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	吴凌志 冯适
会计师事务所的地址	上海市延安东路 222 号 30 楼
审计报告日期	2022 年 3 月 29 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	509,792.95
结算备付金		3,114,250.36
存出保证金		362,019.26
交易性金融资产	7.4.7.2	1,950,223,244.87
其中：股票投资		1,832,300,496.37
基金投资		-
债券投资		117,922,748.50
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		37,024,528.99
应收利息	7.4.7.5	1,381,863.57
应收股利		-
应收申购款		27,478.01
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		1,992,643,178.01
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		70,112,589.43
应付证券清算款		5.17
应付赎回款		13,559,673.81
应付管理人报酬		1,850,381.85
应付托管费		252,324.85
应付销售服务费		69,095.39
应付交易费用	7.4.7.7	337,477.36
应交税费		8,407.78
应付利息		39,481.87
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	278,687.66
负债合计		86,508,125.17
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	1,857,684,582.36

未分配利润	7.4.7.10	48,450,470.48
所有者权益合计		1,906,135,052.84
负债和所有者权益总计		1,992,643,178.01

注：1、报告截止日 2021 年 12 月 31 日，兴全中证 800 六个月持有指数 A 基金份额净值 1.0264 元，基金份额总额 1,670,491,950.92 份；兴全中证 800 六个月持有指数 C 基金份额净值 1.0228 元，基金份额总额 187,192,631.44 份。兴全中证 800 六个月持有指数份额总额合计为 1,857,684,582.36 份。

2、本基金合同于 2021 年 2 月 9 日生效，本期财务报表的实际编制期间为 2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间。

## 7.2 利润表

会计主体：兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金

本报告期：2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 2 月 9 日（基金合同 生效日）至 2021 年 12 月 31 日
一、收入		82,915,102.21
1. 利息收入		23,026,290.01
其中：存款利息收入	7.4.7.11	967,685.53
债券利息收入		8,804,727.86
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		12,677,638.34
证券出借利息收入		576,238.28
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		35,693,403.17
其中：股票投资收益	7.4.7.12	14,855,101.91
基金投资收益	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-1,258,508.64
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	22,096,809.90
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	23,492,153.82
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	703,255.21
减：二、费用		34,174,491.81
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	25,156,726.26
2. 托管费	7.4.10.2.2	3,430,462.72

3. 销售服务费	7. 4. 10. 2. 3	1, 128, 687. 28
4. 交易费用	7. 4. 7. 19	3, 177, 803. 07
5. 利息支出		711, 009. 03
其中: 卖出回购金融资产支出		711, 009. 03
6. 税金及附加		2, 145. 08
7. 其他费用	7. 4. 7. 20	567, 658. 37
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		48, 740, 610. 40
减: 所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		48, 740, 610. 40

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金

本报告期: 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2, 877, 155, 099. 67	-	2, 877, 155, 099. 67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	48, 740, 610. 40	48, 740, 610. 40
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-1, 019, 470, 517. 31	-290, 139. 92	-1, 019, 760, 657. 23
其中: 1. 基金申购款	104, 962, 061. 88	533, 422. 44	105, 495, 484. 32
2. 基金赎回款	-1, 124, 432, 579. 19	-823, 562. 36	-1, 125, 256, 141. 55
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者	1, 857, 684, 582. 36	48, 450, 470. 48	1, 906, 135, 052. 84

权益（基金净值）			
----------	--	--	--

注：本基金合同于 2021 年 2 月 9 日生效，本期数据按实际存续期计算。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

杨华辉

庄园芳

詹鸿飞

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金系由基金管理人兴证全球基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》《兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）及其他有关法律法规的规定，经中国证券监督管理委员会证监许可[2020]2894 号文核准予以公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集基金份额 2,876,741,976.79 份，经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了验资报告。本基金基金合同于 2021 年 2 月 9 日正式生效。本基金的管理人为兴证全球基金管理有限公司，托管人为招商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中证 800 指数的成份股及其备选成份股、其他非指数成份股(包含主板、中小板、创业板及其他国内依法发行上市的股票及存托凭证、港股通标的股票)、债券(国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券(含分离交易可转债的纯债部分)、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、金融衍生工具(包括股指期货、国债期货、股票期权)、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的相关规定)。

本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定，参与融资业务和转融通券出借业务。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。

基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 80%，投资于中证 800 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例

合计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。

本基金业绩比较基准：中证 800 指数收益率× 90%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)×5%+银行活期存款利率(税后)× 5%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本基金系在持续经营假设的基础上编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

###### (1) 金融资产的分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项。

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资和债券投资。

###### (2) 金融负债的分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益。

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认。

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

##### (1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

##### (2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益；卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

##### (3) 回购协议

基金持有的回购协议(封闭式回购),以成本列示,按实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在实际持有期间内逐日计提利息。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是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;第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值;第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下:

(1) 对于银行间市场交易的固定收益品种,以及交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照第三方估值机构提供的估值确定公允价值。

(2) 对存在活跃市场的其他投资品种,如估值日有市价的,采用市价确定公允价值;估值日无市价,且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,采用最近交易市价确定公允价值;对于发行时明确一定期限限售期的股票,包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行时股票公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等,按照监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

(3) 对存在活跃市场的其他投资品种,如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时,应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价,确定公允价值。

(4) 当投资品种不再存在活跃市场,基金管理人估值委员会认为必要时,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术,确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利,且该种法定权利现在是可执行的,同时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时,金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外,金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。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确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金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在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示。

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提。

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)，在回购期内逐日计提。

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账。

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账。

(7) 衍生工具收益/(损失)于卖出成交日确认，并按卖出成交金额与其成本的差额入账。

(8) 股利收益于除息日确认，并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入账。

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性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。

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计

量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

- (1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.10% 的年费率逐日计提；
- (2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率逐日计提；
- (3) C 类基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.4% 的年费率逐日计提。
- (4) 基金指数使用费按前一日的基金资产净值的 0.016% 年费率计提，每日计算，逐日累计，按季支付，每季度指数许可使用基点费的下限为 5 万元。
- (5) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提。
- (6) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

- (1) 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相应类别的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；基金份额持有人因持有的基金份额（原份额）所获得的红利再投资份额的持有期，按原份额的持有期计算；
- (2) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；
- (3) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；
- (4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。在符合法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

#### 7.4.4.12 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金额。

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。

#### 7.4.4.13 分部报告

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

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《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》(中基协发[2017]6号)，在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

(2) 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，根据《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》(中国证监会公告[2017]13号)及《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13号)相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(3) 根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》(中基协发[2014]24号)，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场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)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。对基金通过港股通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(4) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。对于基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	509,792.95

定期存款	-
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	-
合计	509,792.95

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,811,274,079.69	1,832,300,496.37	21,026,416.68
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	57,688,748.50	2,403,134.64
	银行间市场	60,234,000.00	62,602.50
	合计	117,922,748.50	2,465,737.14
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,926,731,091.05	1,950,223,244.87	23,492,153.82

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融工具。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末无各项买入返售金融资产期末余额。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	176.85
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,541.54
应收债券利息	1,339,206.33

应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-106.39
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	40,866.05
其他	179.19
合计	1,381,863.57

注：此处其他列示的是应收保证金利息。

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
交易所市场应付交易费用	334,360.99
银行间市场应付交易费用	3,116.37
合计	337,477.36

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	25,445.28
应付证券出借违约金	-
预提审计费用	60,000.00
预提信息披露费	110,000.00
应付指数使用费	83,242.38
合计	278,687.66

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

##### 兴全中证 800 六个月持有指数 A

项目	本期 2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	2,502,409,679.69	2,502,409,679.69
本期申购	99,864,726.95	99,864,726.95
本期赎回（以“-”号填列）	-931,782,455.72	-931,782,455.72
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-

本期末	1,670,491,950.92	1,670,491,950.92
-----	------------------	------------------

## 兴全中证 800 六个月持有指数 C

项目	本期 2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	374,745,419.98	374,745,419.98
本期申购	5,097,334.93	5,097,334.93
本期赎回（以“-”号填列）	-192,650,123.47	-192,650,123.47
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	187,192,631.44	187,192,631.44

注：申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

## 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

## 兴全中证 800 六个月持有指数 A

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	22,891,337.59	21,758,982.98	44,650,320.57
本期基金份额交易产生的变动数	-8,069,562.52	7,603,359.19	-466,203.33
其中：基金申购款	1,107,669.11	-498,764.00	608,905.11
基金赎回款	-9,177,231.63	8,102,123.19	-1,075,108.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,821,775.07	29,362,342.17	44,184,117.24

## 兴全中证 800 六个月持有指数 C

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	2,357,118.99	1,733,170.84	4,090,289.83
本期基金份额交易产生的变动数	-1,361,674.63	1,537,738.04	176,063.41
其中：基金申购款	27,212.77	-102,695.44	-75,482.67

基金赎回款	-1,388,887.40	1,640,433.48	251,546.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	995,444.36	3,270,908.88	4,266,353.24

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
活期存款利息收入	724,997.08	
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	238,585.02	
其他	4,103.43	
合计	967,685.53	

注：此处其他列示的是存出保证金利息收入和申购款利息收入。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
股票投资收益——买卖股票差价收入	14,855,101.91	
股票投资收益——赎回差价收入	-	
股票投资收益——申购差价收入	-	
股票投资收益——证券出借差价收入	-	
合计	14,855,101.91	

##### 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
卖出股票成交总额	711,969,531.88	
减：卖出股票成本总额	697,114,429.97	
买卖股票差价收入	14,855,101.91	

#### 7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,258,508.64
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-1,258,508.64

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,054,240,620.79
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,038,974,985.25
减：应收利息总额	16,524,144.18
买卖债券差价收入	-1,258,508.64

##### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

##### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期末无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

##### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

##### 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	22,096,809.90
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	22,096,809.90

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年12月31日

1. 交易性金融资产	23,492,153.82
股票投资	21,026,416.68
债券投资	2,465,737.14
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	23,492,153.82

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年12月31日
基金赎回费收入	695,566.44
基金转换费收入	7,688.77
合计	703,255.21

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年12月31日
交易所市场交易费用	3,174,353.07
银行间市场交易费用	3,450.00
合计	3,177,803.07

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年12月31日
审计费用	60,000.00
信息披露费	110,000.00
证券出借违约金	-
账户维护费	15,000.00
指数使用费	365,915.98
其他费用	1,939.80
银行费用	14,802.59
合计	567,658.37

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金销售机构
兴证全球基金管理有限公司（“兴证全球基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
兴业证券股份有限公司（“兴业证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
全球人寿保险国际公司（AEGON International B.V）	基金管理人的股东
兴证全球资本管理（上海）有限公司（“兴证全球资本”）	基金管理人的子公司

注：下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
兴业证券	874,460,701.29	30.26

###### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
兴业证券	474,161,248.00	69.48

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
兴业证券	21,221,244,000.00	66.61

#### 7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
兴业证券	815,384.52	38.55	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用（包括但不限于买（卖）经手费、证券结算风险基金和买（卖）证管费等）。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	25,156,726.26
其中：支付销售机构的客户维护费	9,310,728.85

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 1.10% 的年费率计提，计算方法如下：每日应支付的基金管理费=前一日基金资产净值× 1.10%/当年天数。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,430,462.72

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提，计算方法如下：每日应支付的基金

托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴全中证 800 六个月持有指数 A	兴全中证 800 六个月持有指数 C	合计
招商银行	-	144,341.95	144,341.95
兴证全球基金	-	19,613.03	19,613.03
兴业证券	-	113,290.02	113,290.02
合计	-	277,245.00	277,245.00

注：A类份额不收取销售服务费，C类份额的基金销售服务费按前一日基金资产净值的0.40%的费率计提。计算方法如下：每日应支付的C类基金份额销售服务费=C类基金份额前一日的基金资产净值×0.40%/当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

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

注：本基金本报告期内无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。

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

单位：人民币元

本期 2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年12月31日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量（单位：股）	出借期限（单位：）	费率（%）	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额

						天)					
兴业证券股 份有限公司	202108 180000 2224	药明康 德	2021 年 8 月 18 日	2,572,40 0.00	20,000	7	0.02	800.30	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	202108 190000 1812	金风科 技	2021 年 8 月 19 日	1,139,64 4.00	87,800	7	0.02	354.56	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	202108 190000 1876	海康威 视	2021 年 8 月 19 日	10,982,0 00.00	200,000	7	0.02	3,416. 62	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	202108 190000 1884	科伦药 业	2021 年 8 月 19 日	5,043,06 0.00	283,000	7	0.02	1,568. 95	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	202108 190000 2288	新华保 险	2021 年 8 月 19 日	1,083,21 9.00	26,700	7	0.02	337.00	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	202108 190000 2579	金地集 团	2021 年 8 月 19 日	392,700. 00	35,700	7	0.02	122.17	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	202108 200000 1240	康弘药 业	2021 年 8 月 20 日	307,242. 00	16,900	7	0.02	95.59	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	202108 200000 1463	豫园股 份	2021 年 8 月 20 日	582,624. 00	54,400	7	0.02	181.26	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	202108 200000 1492	长江电 力	2021 年 8 月 20 日	1,788,48 5.00	90,100	7	0.02	556.42	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	202108 230000 1743	长江电 力	2021 年 8 月 23 日	1,800,00 0.00	90,000	7	0.02	560.00	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	202108 230000 1923	金地集 团	2021 年 8 月 23 日	391,072. 00	35,200	7	0.02	121.67	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	202108 260000 8715	金风科 技	2021 年 8 月 26 日	1,223,93 2.00	87,800	7	0.02	380.78	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	202108 270000 0500	亚光科 技	2021 年 8 月 27 日	1,514,34 0.00	141,000	7	0.03	1,001. 15	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	202108 270000 1655	紫金矿 业	2021 年 8 月 27 日	2,090,00 0.00	200,000	7	0.02	650.22	-	-	-
兴业证券股	202108	康弘药	2021 年	315,016.	16,900	7	0.02	98.00	-	-	-

份有限公司	270000 8647	业	8月27 日	00							
兴业证券股 份有限公司	202108 310000 0483	亚光科 技	2021年 8月31 日	4,756,86 9.00	425,100	7	0.03	3,144. 82	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202109 010000 1143	亚光科 技	2021年 9月1 日	5,723,87 2.00	515,200	7	0.03	3,784. 12	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202109 010000 1661	陕西煤 业	2021年 9月1 日	1,095,53 2.00	80,200	7	0.02	340.83	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202109 010000 1712	淮北矿 业	2021年 9月1 日	2,003,40 0.00	140,000	7	0.02	623.28	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202109 020000 1317	金融街	2021年 9月2 日	334,430. 00	53,000	7	0.02	104.04	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202109 020000 1557	科伦药 业	2021年 9月2 日	597,300. 00	33,000	7	0.02	185.83	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202109 020000 1586	索菲亚	2021年 9月2 日	603,260. 00	31,000	7	0.02	187.68	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202109 020000 1656	万达电 影	2021年 9月2 日	594,090. 00	41,400	7	0.02	184.83	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202109 020000 1720	华发股 份	2021年 9月2 日	607,308. 00	91,600	7	0.02	188.94	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202109 020000 1816	重庆百 货	2021年 9月2 日	346,775. 00	14,300	7	0.02	107.89	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202109 020000 1818	华润双 鹤	2021年 9月2 日	599,964. 00	51,900	7	0.02	186.66	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202109 020000 1873	安迪苏	2021年 9月2 日	282,900. 00	24,600	7	0.02	88.01	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202109 020000 1890	川投能 源	2021年 9月2 日	615,384. 00	51,800	7	0.02	191.45	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202109 020000 1930	中国铁 建	2021年 9月2 日	1,039,20 0.00	120,000	7	0.02	323.31	-	-	

兴业证券股份有限公司	2021090200002274	中南传媒	2021年9月2日	609,236.00	68,300	7	0.02	189.54	-	-
兴业证券股份有限公司	2021090300001794	开滦股份	2021年9月3日	367,200.00	40,000	14	0.02	242.76	-	-
兴业证券股份有限公司	2021090600001246	中国太保	2021年9月6日	410,256.00	14,400	7	0.02	127.64	-	-
兴业证券股份有限公司	2021090600001276	中天科技	2021年9月6日	1,071,250.00	125,000	7	0.02	333.28	-	-
兴业证券股份有限公司	2021090700001226	金风科技	2021年9月7日	3,412,000.00	200,000	7	0.02	1,061.51	-	-
兴业证券股份有限公司	2021090700001628	天坛生物	2021年9月7日	1,775,500.00	50,000	7	0.02	552.38	-	-
兴业证券股份有限公司	2021090900000765	双汇发展	2021年9月9日	697,408.00	27,200	7	0.02	216.97	-	-
兴业证券股份有限公司	2021090900001144	川投能源	2021年9月9日	1,987,500.00	150,000	7	0.02	618.33	-	-
兴业证券股份有限公司	2021090900001172	豫园股份	2021年9月9日	532,948.00	48,100	7	0.02	165.81	-	-
兴业证券股份有限公司	2021091000001091	中国中免	2021年9月10日	5,278,500.00	20,700	7	0.02	1,642.20	-	-
兴业证券股份有限公司	2021091000001129	川投能源	2021年9月10日	627,000.00	50,000	7	0.02	195.07	-	-
兴业证券股份有限公司	2021091300001469	完美世界	2021年9月13日	896,760.00	53,000	7	0.02	278.99	-	-
兴业证券股份有限公司	2021091300001590	贵阳银行	2021年9月13日	139,200.00	20,000	14	0.02	92.03	-	-
兴业证券股份有限公司	2021091500001464	美年健康	2021年9月15日	178,524.00	22,800	7	0.02	55.54	-	-
兴业证券股份有限公司	202109150000150000	金风科技	2021年9月15日	567,000.00	30,000	7	0.02	176.40	-	-

	1502		日								
兴业证券股 份有限公司	202109 150000 1586	完美世 界	2021年 9月15 日	1,163,21 4.00	70,200	7	0.02	361.89	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202109 150000 1635	广汇汽 车	2021年 9月15 日	688,800. 00	210,000	7	0.02	214.29	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202109 160000 1777	中天科 技	2021年 9月16 日	1,170,00 0.00	130,000	7	0.02	364.00	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202109 160000 1867	中国中 免	2021年 9月16 日	2,510,14 4.00	10,400	7	0.02	780.93	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202109 160000 2078	淮北矿 业	2021年 9月16 日	2,318,40 0.00	140,000	7	0.02	721.28	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202109 220000 1589	巨人网 络	2021年 9月22 日	4,928,04 0.00	456,300	7	0.02	1,533. 17	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202109 220000 1710	亨通光 电	2021年 9月22 日	2,796,00 0.00	200,000	7	0.02	869.87	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202109 220000 1857	中国人 寿	2021年 9月22 日	1,786,13 4.00	60,200	7	0.02	555.69	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202109 240000 1031	上海建 工	2021年 9月24 日	597,000. 00	150,000	7	0.02	185.73	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202110 080000 1363	中联重 科	2021年 10月8 日	1,389,44 4.00	166,800	14	0.02	918.58	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202110 080000 1549	云海金 属	2021年 10月8 日	15,205,9 18.00	782,600	7	0.02	4,730. 73	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202110 080000 1554	金风科 技	2021年 10月8 日	3,408,30 0.00	210,000	7	0.02	1,060. 36	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202110 110000 2107	徐工机 械	2021年 10月 11日	212,544. 00	32,800	14	0.02	140.52	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202110 110000 2222	五粮液	2021年 10月 11日	2,870,28 0.00	12,600	14	0.02	1,897. 57	-	-	
兴业证券股	202110	云海金	2021年	2,229,60	120,000	14	0.02	1,474.	-	-	

份有限公司	110000 2468	属	10月 11日	0.00					01		
兴业证券股 份有限公司	202110 110000 2813	淮北矿 业	2021年 10月 11日	2,233,44 0.00	148,500	14	0.02	1,476. 55		-	-
兴业证券股 份有限公司	202110 110000 2814	川投能 源	2021年 10月 11日	1,784,16 2.00	138,200	14	0.02	1,179. 53		-	-
兴业证券股 份有限公司	202110 110000 2880	盘江股 份	2021年 10月 11日	2,298,67 2.00	244,800	14	0.02	1,519. 68		-	-
兴业证券股 份有限公司	202110 110000 2954	中天科 技	2021年 10月 11日	242,048. 00	24,800	14	0.02	160.02		-	-
兴业证券股 份有限公司	202110 110000 2958	天坛生 物	2021年 10月 11日	395,312. 00	12,400	14	0.02	261.35		-	-
兴业证券股 份有限公司	202110 110000 3721	中国铁 建	2021年 10月 11日	1,075,95 0.00	135,000	14	0.02	711.32		-	-
兴业证券股 份有限公司	202110 110000 3742	中国石 化	2021年 10月 11日	226,842. 00	49,100	14	0.02	149.97		-	-
兴业证券股 份有限公司	202110 110000 3793	长江电 力	2021年 10月 11日	929,660. 00	43,000	14	0.02	614.61		-	-
兴业证券股 份有限公司	202110 120000 1793	金风科 技	2021年 10月 12日	230,700. 00	15,000	14	0.02	152.52		-	-
兴业证券股 份有限公司	202110 120000 1976	索菲亚	2021年 10月 12日	403,650. 00	23,000	14	0.02	266.86		-	-
兴业证券股 份有限公司	202110 120000 2137	盘江股 份	2021年 10月 12日	1,040,75 0.00	115,000	14	0.02	688.05		-	-
兴业证券股 份有限公司	202110 120000 2138	川投能 源	2021年 10月 12日	1,114,47 0.00	87,000	14	0.02	736.79		-	-
兴业证券股 份有限公司	202110 120000 2709	紫金矿 业	2021年 10月 12日	1,809,10 4.00	167,200	14	0.02	1,196. 02		-	-
兴业证券股 份有限公司	202110 130000 2156	开滦股 份	2021年 10月 13日	407,250. 00	45,000	14	0.02	269.24		-	-

兴业证券股份有限公司	202110 140000 1075	金融街	2021年 10月 14日	340,800. 00	56,800	14	0.02	225.31	-	-
兴业证券股份有限公司	202110 140000 1502	康弘药业	2021年 10月 14日	4,963,94 4.00	256,800	14	0.02	3,281. 72	-	-
兴业证券股份有限公司	202110 140000 1557	上海建工	2021年 10月 14日	508,725. 00	157,500	14	0.02	336.32	-	-
兴业证券股份有限公司	202110 140000 1593	亨通光电	2021年 10月 14日	192,717. 00	13,300	14	0.02	127.41	-	-
兴业证券股份有限公司	202110 140000 1625	陕西煤业	2021年 10月 14日	3,147,75 0.00	225,000	14	0.02	2,081. 01	-	-
兴业证券股份有限公司	202110 140000 1668	安迪苏	2021年 10月 14日	569,232. 00	47,200	14	0.02	376.33	-	-
兴业证券股份有限公司	202110 140000 1693	中天科技	2021年 10月 14日	1,038,54 0.00	114,000	14	0.02	686.59	-	-
兴业证券股份有限公司	202110 140000 1875	华友钴业	2021年 10月 14日	1,090,90 0.00	10,000	14	0.02	721.21	-	-
兴业证券股份有限公司	202110 140000 1930	锦江酒店	2021年 10月 14日	716,800. 00	14,000	14	0.02	473.88	-	-
兴业证券股份有限公司	202110 140000 2018	中国神华	2021年 10月 14日	589,082. 00	27,800	14	0.02	389.45	-	-
兴业证券股份有限公司	202110 140000 2062	重庆百货	2021年 10月 14日	1,089,00 0.00	45,000	14	0.02	719.95	-	-
兴业证券股份有限公司	202110 140000 2083	广汇汽车	2021年 10月 14日	695,250. 00	225,000	14	0.02	459.64	-	-
兴业证券股份有限公司	202110 150000 0878	科伦药业	2021年 10月 15日	1,957,47 2.00	107,200	14	0.02	1,294. 11	-	-
兴业证券股份有限公司	202110 150000 0900	索菲亚	2021年 10月 15日	1,897,28 0.00	112,000	14	0.02	1,254. 31	-	-
兴业证券股份有限公司	202110 150000	万达电影	2021年 10月	2,073,62 5.00	132,500	14	0.02	1,370. 90	-	-

	0918		15 日								
兴业证券股 份有限公司	202110 150000 0960	贵阳银 行	2021 年 10 月 15 日	2,002,72 5.00	296,700	14	0.02	1,324. 02		-	-
兴业证券股 份有限公司	202110 150000 1049	华润双 鹤	2021 年 10 月 15 日	899,640. 00	76,500	14	0.02	594.76		-	-
兴业证券股 份有限公司	202110 180000 1116	华润三 九	2021 年 10 月 18 日	1,805,97 6.00	64,800	14	0.02	1,193. 95		-	-
兴业证券股 份有限公司	202110 180000 1189	云海金 属	2021 年 10 月 18 日	11,450,9 70.00	633,000	14	0.02	7,570. 36		-	-
兴业证券股 份有限公司	202110 180000 1195	云海金 属	2021 年 10 月 18 日	2,623,05 0.00	145,000	14	0.02	1,734. 13		-	-
兴业证券股 份有限公司	202110 180000 1307	完美世 界	2021 年 10 月 18 日	1,376,05 0.00	94,900	14	0.02	909.72		-	-
兴业证券股 份有限公司	202110 180000 1537	豫园股 份	2021 年 10 月 18 日	613,200. 00	60,000	14	0.02	405.39		-	-
兴业证券股 份有限公司	202110 180000 1563	中牧股 份	2021 年 10 月 18 日	5,331,80 0.00	503,000	14	0.02	3,524. 91		-	-
兴业证券股 份有限公司	202110 180000 1584	中牧股 份	2021 年 10 月 18 日	10,600,0 00.00	1,000,00 0	14	0.02	7,007. 78		-	-
兴业证券股 份有限公司	202110 200000 0937	亚光科 技	2021 年 10 月 20 日	1,980,80 5.00	210,500	14	0.03	2,465. 00		-	-
兴业证券股 份有限公司	202110 200000 1176	万达电 影	2021 年 10 月 20 日	1,942,38 0.00	130,800	14	0.02	1,284. 13		-	-
兴业证券股 份有限公司	202110 200000 1231	贵阳银 行	2021 年 10 月 20 日	1,292,34 6.00	192,600	14	0.02	854.38		-	-
兴业证券股 份有限公司	202110 200000 1350	豫园股 份	2021 年 10 月 20 日	334,150. 00	32,600	14	0.02	220.91		-	-
兴业证券股 份有限公司	202110 210000 0954	美的集 团	2021 年 10 月 21 日	2,006,78 4.00	28,800	14	0.02	1,326. 71		-	-
兴业证券股	202110	金风科	2021 年	949,520.	57,200	14	0.02	627.74		-	-

份有限公司	210000 1063	技	10月 21日	00							
兴业证券股 份有限公司	202110 210000 1152	完美世 界	2021年 10月 21日	867,349. 00	57,100	14	0.02	573.41	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202110 210000 1166	康弘药 业	2021年 10月 21日	412,650. 00	22,500	14	0.02	272.81	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202110 210000 1323	中国平 安	2021年 10月 21日	27,140,0 00.00	500,000	14	0.02	17,942 .56	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202110 210000 1325	安迪苏	2021年 10月 21日	2,799,62 2.00	217,700	14	0.02	1,850. 86	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202110 220000 0975	中联重 科	2021年 10月 22日	5,114,16 5.00	635,300	14	0.02	3,381. 03	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202110 220000 0997	美的集 团	2021年 10月 22日	1,065,35 0.00	14,300	14	0.02	704.31	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202110 220000 1029	五粮液	2021年 10月 22日	9,451,26 0.00	42,000	14	0.02	6,248. 33	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202110 220000 1034	双汇发 展	2021年 10月 22日	2,077,92 0.00	74,000	14	0.02	1,373. 74	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202110 220000 1109	海康威 视	2021年 10月 22日	1,441,44 0.00	26,000	14	0.02	952.95	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202110 220000 1127	老板电 器	2021年 10月 22日	344,200. 00	10,000	14	0.02	227.55	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202110 220000 1140	完美世 界	2021年 10月 22日	1,168,12 0.00	76,000	14	0.02	772.26	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202110 220000 1146	康弘药 业	2021年 10月 22日	184,200. 00	10,000	14	0.02	121.78	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202110 220000 1192	三六零	2021年 10月 22日	379,422. 00	32,100	14	0.02	250.84	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202110 260000 1389	平安银 行	2021年 10月 26日	4,010,00 0.00	200,000	14	0.02	2,651. 06	-	-	

兴业证券股份有限公司	2021102600001577	科伦药业	2021年10月26日	1,997,152.00	111,200	14	0.02	1,320.34	-	-
兴业证券股份有限公司	2021102600001808	通威股份	2021年10月26日	1,262,700.00	22,500	14	0.02	834.79	-	-
兴业证券股份有限公司	2021102600001845	淮北矿业	2021年10月26日	2,031,480.00	148,500	14	0.02	1,343.03	-	-
兴业证券股份有限公司	2021102600001878	川投能源	2021年10月26日	1,802,280.00	138,000	14	0.02	1,191.51	-	-
兴业证券股份有限公司	2021102600001908	盘江股份	2021年10月26日	2,119,250.00	245,000	14	0.02	1,401.06	-	-
兴业证券股份有限公司	2021102600001924	中国人寿	2021年10月26日	3,562,690.00	110,300	14	0.02	2,355.33	-	-
兴业证券股份有限公司	2021102600002062	中国神华	2021年10月26日	1,077,698.00	49,300	14	0.02	712.48	-	-
兴业证券股份有限公司	2021102800004225	金融街	2021年10月28日	328,304.00	56,800	14	0.02	217.05	-	-
兴业证券股份有限公司	2021102800007139	中国神华	2021年10月28日	560,170.00	27,800	14	0.02	370.33	-	-
兴业证券股份有限公司	2021102800007173	陕西煤业	2021年10月28日	2,819,250.00	225,000	14	0.02	1,863.84	-	-
兴业证券股份有限公司	2021102800007267	华友钴业	2021年10月28日	1,041,800.00	10,000	14	0.02	688.75	-	-
兴业证券股份有限公司	2021102800007389	康弘药业	2021年10月28日	4,699,440.00	256,800	14	0.02	3,106.85	-	-
兴业证券股份有限公司	2021102800007465	上海建工	2021年10月28日	499,275.00	157,500	14	0.02	330.08	-	-
兴业证券股份有限公司	2021102800007503	广汇汽车	2021年10月28日	607,500.00	225,000	14	0.02	401.63	-	-
兴业证券股份有限公司	202110280000	安迪苏	2021年10月	617,376.00	47,200	14	0.02	408.15	-	-

	7509		28 日								
兴业证券股 份有限公司	202110 280000 7555	亨通光 电	2021 年 10 月 28 日	195,776. 00	13,300	14	0.02	129.43	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202110 280000 9895	重庆百 货	2021 年 10 月 28 日	1,019,25 0.00	45,000	14	0.02	673.84	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202110 290000 2594	贵阳银 行	2021 年 10 月 29 日	2,002,72 5.00	296,700	14	0.02	1,324. 02	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202110 290000 2888	科伦药 业	2021 年 10 月 29 日	1,894,22 4.00	107,200	14	0.02	1,252. 29	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202110 290000 2890	索菲亚	2021 年 10 月 29 日	1,895,04 0.00	112,000	14	0.02	1,252. 83	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202110 290000 2894	万达电 影	2021 年 10 月 29 日	1,858,97 5.00	132,500	14	0.02	1,228. 99	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202110 290000 2900	华润双 鹤	2021 年 10 月 29 日	873,630. 00	76,500	14	0.02	577.57	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 010000 1255	中联重 科	2021 年 11 月 1 日	1,245,09 0.00	171,500	14	0.02	823.14	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 010000 1400	招商蛇 口	2021 年 11 月 1 日	1,925,67 2.00	191,800	14	0.02	1,273. 08	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 010000 1473	云海金 属	2021 年 11 月 1 日	2,247,24 0.00	122,000	14	0.02	1,485. 68	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 010000 1475	金风科 技	2021 年 11 月 1 日	3,053,96 0.00	167,800	14	0.02	2,019. 01	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 010000 1592	巨人网 络	2021 年 11 月 1 日	1,209,40 7.00	120,100	14	0.02	799.55	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 010000 1632	万达电 影	2021 年 11 月 1 日	396,396. 00	28,600	14	0.02	262.06	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 010000 1684	辽宁成 大	2021 年 11 月 1 日	454,050. 00	22,500	14	0.02	300.18	-	-	
兴业证券股	202111	川投能	2021 年	1,140,57	87,000	14	0.02	754.04	-	-	

份有限公司	010000 1761	源	11 月 1 日	0.00							
兴业证券股 份有限公司	202111 010000 1796	三六零	2021 年 11 月 1 日	119,700. 00	10,000	14	0.02	79.14	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 010000 1798	盘江股 份	2021 年 11 月 1 日	916,550. 00	115,000	14	0.02	605.94	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 010000 1830	安迪苏	2021 年 11 月 1 日	1,162,91 0.00	89,800	14	0.02	768.81	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 010000 1861	中天科 技	2021 年 11 月 1 日	1,544,56 8.00	138,900	14	0.02	1,021. 13	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 010000 2079	中国神 华	2021 年 11 月 1 日	1,163,21 1.00	57,900	14	0.02	769.01	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 010000 3829	华润三 九	2021 年 11 月 1 日	1,568,80 8.00	64,800	14	0.02	1,037. 16	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 010000 3831	云海金 属	2021 年 11 月 1 日	2,670,90 0.00	145,000	14	0.02	1,765. 76	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 010000 3833	完美世 界	2021 年 11 月 1 日	1,653,15 8.00	94,900	14	0.02	1,092. 92	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 010000 3835	中牧股 份	2021 年 11 月 1 日	11,350,0 00.00	1,000,00 0	14	0.02	7,503. 61	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 010000 3837	豫园股 份	2021 年 11 月 1 日	591,000. 00	60,000	14	0.02	390.72	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 010000 3849	中牧股 份	2021 年 11 月 1 日	5,709,05 0.00	503,000	14	0.02	3,774. 32	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 030000 0810	徐工机 械	2021 年 11 月 3 日	1,970,97 2.00	330,700	14	0.02	1,303. 03	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 030000 0940	云海金 属	2021 年 11 月 3 日	10,729,3 50.00	633,000	14	0.02	7,093. 29	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 030000 1106	亨通光 电	2021 年 11 月 3 日	1,921,53 6.00	125,100	14	0.02	1,270. 35	-	-	

兴业证券股份有限公司	2021110300001160	三六零	2021年11月3日	2,933,757.00	239,100	14	0.02	1,939.54	-	-
兴业证券股份有限公司	2021110300001339	王府井	2021年11月3日	408,671.00	13,700	14	0.02	270.18	-	-
兴业证券股份有限公司	2021110300002630	贵阳银行	2021年11月3日	1,257,678.00	192,600	14	0.02	831.46	-	-
兴业证券股份有限公司	2021110300002640	豫园股份	2021年11月3日	315,894.00	32,600	14	0.02	208.84	-	-
兴业证券股份有限公司	2021110300002652	万达电影	2021年11月3日	1,763,184.00	130,800	14	0.02	1,165.66	-	-
兴业证券股份有限公司	2021110300002862	亚光科技	2021年11月3日	1,856,610.00	210,500	14	0.03	2,310.45	-	-
兴业证券股份有限公司	2021110400002885	康弘药业	2021年11月4日	417,150.00	22,500	14	0.02	275.78	-	-
兴业证券股份有限公司	2021110400002895	安迪苏	2021年11月4日	2,877,994.00	217,700	14	0.02	1,902.67	-	-
兴业证券股份有限公司	2021110400003057	金风科技	2021年11月4日	1,176,032.00	57,200	14	0.02	777.49	-	-
兴业证券股份有限公司	2021110500000445	碧水源	2021年11月5日	506,863.00	72,100	14	0.03	670.19	-	-
兴业证券股份有限公司	2021110500000465	碧水源	2021年11月5日	473,822.00	67,400	14	0.03	589.65	-	-
兴业证券股份有限公司	2021110500001142	索菲亚	2021年11月5日	402,960.00	23,000	14	0.02	266.40	-	-
兴业证券股份有限公司	2021110500001159	完美世界	2021年11月5日	929,500.00	50,000	14	0.02	614.50	-	-
兴业证券股份有限公司	2021110500001177	康弘药业	2021年11月5日	609,120.00	32,400	14	0.02	402.70	-	-
兴业证券股份有限公司	202111050000	康弘药业	2021年11月5日	188,000.00	10,000	14	0.02	124.29	-	-

	1179		日								
兴业证券股份 有限公司	202111 050000 1288	安迪苏	2021年 11月5 日	385,520. 00	30,500	14	0.02	254.87	-	-	
兴业证券股份 有限公司	202111 050000 1437	药明康 德	2021年 11月5 日	1,997,12 0.00	15,800	14	0.02	1,320. 32	-	-	
兴业证券股份 有限公司	202111 050000 1593	开滦股 份	2021年 11月5 日	319,950. 00	45,000	14	0.02	211.52	-	-	
兴业证券股份 有限公司	202111 050004 0583	老板电 器	2021年 11月5 日	304,500. 00	10,000	14	0.02	201.31	-	-	
兴业证券股份 有限公司	202111 050004 5699	中联重 科	2021年 11月5 日	4,497,92 4.00	635,300	14	0.02	2,973. 63	-	-	
兴业证券股份 有限公司	202111 050004 5943	五粮液	2021年 11月5 日	8,833,02 0.00	42,000	14	0.02	5,839. 61	-	-	
兴业证券股份 有限公司	202111 050004 5979	双汇发 展	2021年 11月5 日	2,278,46 0.00	74,000	14	0.02	1,506. 32	-	-	
兴业证券股份 有限公司	202111 050004 7213	三六零	2021年 11月5 日	393,546. 00	32,100	14	0.02	260.18	-	-	
兴业证券股份 有限公司	202111 050004 8373	美的集 团	2021年 11月5 日	1,011,72 5.00	14,300	14	0.02	668.86	-	-	
兴业证券股份 有限公司	202111 080000 1376	五粮液	2021年 11月8 日	2,109,90 0.00	10,000	14	0.02	1,394. 88	-	-	
兴业证券股份 有限公司	202111 080000 1572	三七互 娱	2021年 11月8 日	2,009,51 3.00	78,100	14	0.02	1,328. 51	-	-	
兴业证券股份 有限公司	202111 080000 1575	巨人网 络	2021年 11月8 日	2,016,58 5.00	184,500	14	0.02	1,333. 19	-	-	
兴业证券股份 有限公司	202111 080000 1616	完美世 界	2021年 11月8 日	1,474,74 6.00	77,700	14	0.02	974.97	-	-	
兴业证券股份 有限公司	202111 080000 1680	贵阳银 行	2021年 11月8 日	331,500. 00	51,000	14	0.02	219.16	-	-	
兴业证券股	202111	科伦药	2021年	2,028,28	111,200	14	0.02	1,340.	-	-	

份有限公司	090000 9110	业	11 月 9 日	8.00				92		
兴业证券股 份有限公司	202111 090001 2378	平安银 行	2021 年 11 月 9 日	3,506,00 0.00	200,000	14	0.02	2,317. 86	-	-
兴业证券股 份有限公司	202111 090001 2930	中国人 寿	2021 年 11 月 9 日	3,185,46 4.00	110,300	14	0.02	2,105. 95	-	-
兴业证券股 份有限公司	202111 090001 2944	淮北矿 业	2021 年 11 月 9 日	1,660,23 0.00	148,500	14	0.02	1,097. 60	-	-
兴业证券股 份有限公司	202111 090001 2946	川投能 源	2021 年 11 月 9 日	1,675,32 0.00	138,000	14	0.02	1,107. 57	-	-
兴业证券股 份有限公司	202111 090001 2948	通威股 份	2021 年 11 月 9 日	1,135,80 0.00	22,500	14	0.02	750.89	-	-
兴业证券股 份有限公司	202111 090001 2950	盘江股 份	2021 年 11 月 9 日	1,817,90 0.00	245,000	14	0.02	1,201. 83	-	-
兴业证券股 份有限公司	202111 090001 3512	中国神 华	2021 年 11 月 9 日	958,885. 00	49,300	14	0.02	633.93	-	-
兴业证券股 份有限公司	202111 100000 1115	泸州老 窖	2021 年 11 月 10 日	2,190,50 0.00	10,000	14	0.02	1,448. 16	-	-
兴业证券股 份有限公司	202111 100000 1255	三七互 娱	2021 年 11 月 10 日	1,145,45 8.00	45,800	14	0.02	757.28	-	-
兴业证券股 份有限公司	202111 100000 1257	巨人网 络	2021 年 11 月 10 日	241,488. 00	21,600	14	0.02	159.65	-	-
兴业证券股 份有限公司	202111 100000 1489	长电科 技	2021 年 11 月 10 日	1,349,50 4.00	41,600	14	0.02	892.17	-	-
兴业证券股 份有限公司	202111 100000 1635	广汇汽 车	2021 年 11 月 10 日	25,200.0 0	10,000	14	0.02	16.66	-	-
兴业证券股 份有限公司	202111 110000 3274	康弘药 业	2021 年 11 月 11 日	4,835,54 4.00	256,800	14	0.02	3,196. 83	-	-
兴业证券股 份有限公司	202111 110000 3360	上海建 工	2021 年 11 月 11 日	502,425. 00	157,500	14	0.02	332.16	-	-

兴业证券股份有限公司	202111 110000 3386	安迪苏	2021年 11月 11日	592,360. 00	47,200	14	0.02	391.62	-	-
兴业证券股份有限公司	202111 110000 3390	广汇汽车	2021年 11月 11日	578,250. 00	225,000	14	0.02	382.29	-	-
兴业证券股份有限公司	202111 110000 3440	亨通光电	2021年 11月 11日	211,603. 00	13,300	14	0.02	139.89	-	-
兴业证券股份有限公司	202111 110000 8634	金融街	2021年 11月 11日	348,752. 00	56,800	14	0.02	230.56	-	-
兴业证券股份有限公司	202111 110001 0106	重庆百货	2021年 11月 11日	1,038,60 0.00	45,000	14	0.02	686.63	-	-
兴业证券股份有限公司	202111 110001 0208	中国神华	2021年 11月 11日	534,594. 00	27,800	14	0.02	353.43	-	-
兴业证券股份有限公司	202111 120000 0442	亚光科技	2021年 11月 12日	862,960. 00	92,000	14	0.03	1,141. 02	-	-
兴业证券股份有限公司	202111 120000 0851	五粮液	2021年 11月 12日	2,038,50 0.00	10,000	14	0.02	1,347. 68	-	-
兴业证券股份有限公司	202111 120000 0877	招商蛇口	2021年 11月 12日	2,051,60 0.00	184,000	14	0.02	1,356. 34	-	-
兴业证券股份有限公司	202111 120000 1163	锦江酒店	2021年 11月 12日	1,855,86 8.00	31,600	14	0.02	1,226. 93	-	-
兴业证券股份有限公司	202111 120000 2017	科伦药业	2021年 11月 12日	1,948,89 6.00	107,200	14	0.02	1,288. 44	-	-
兴业证券股份有限公司	202111 120000 2035	索菲亚	2021年 11月 12日	1,967,84 0.00	112,000	14	0.02	1,300. 96	-	-
兴业证券股份有限公司	202111 120000 2043	万达电影	2021年 11月 12日	1,905,35 0.00	132,500	14	0.02	1,259. 65	-	-
兴业证券股份有限公司	202111 120000 2053	华润双鹤	2021年 11月 12日	889,695. 00	76,500	14	0.02	588.19	-	-
兴业证券股份有限公司	202111 120000	贵阳银行	2021年 11月	1,937,45 1.00	296,700	14	0.02	1,280. 87	-	-

	3695		12 日								
兴业证券股 份有限公司	202111 150000 1568	华侨城 A	2021 年 11 月 15 日	2,038,31 0.00	317,000	14	0.02	1,347. 55	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 150000 1672	招商蛇 口	2021 年 11 月 15 日	391,652. 00	35,800	14	0.02	258.93	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 150000 1895	康弘药 业	2021 年 11 月 15 日	231,715. 00	12,100	14	0.02	153.19	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 150000 2050	天坛生 物	2021 年 11 月 15 日	2,057,40 0.00	67,500	14	0.02	1,360. 17	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 150000 2196	中国中 免	2021 年 11 月 15 日	2,298,80 0.00	10,000	14	0.02	1,519. 76	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 150000 2327	建发股 份	2021 年 11 月 15 日	2,101,46 4.00	253,800	14	0.02	1,389. 30	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 150000 2374	金地集 团	2021 年 11 月 15 日	1,889,55 0.00	171,000	14	0.02	1,249. 20	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 150000 5567	中牧股 份	2021 年 11 月 15 日	11,440,0 00.00	1,000,00 0	14	0.02	7,563. 11	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 150000 5569	盘江股 份	2021 年 11 月 15 日	819,950. 00	115,000	14	0.02	542.08	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 150000 5571	豫园股 份	2021 年 11 月 15 日	587,400. 00	60,000	14	0.02	388.34	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 150000 5573	中联重 科	2021 年 11 月 15 日	1,186,78 0.00	171,500	14	0.02	784.59	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 150000 5575	华润三 九	2021 年 11 月 15 日	1,579,82 4.00	64,800	14	0.02	1,044. 44	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 150000 5577	云海金 属	2021 年 11 月 15 日	2,133,78 0.00	122,000	14	0.02	1,410. 67	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 150000 5579	云海金 属	2021 年 11 月 15 日	2,536,05 0.00	145,000	14	0.02	1,676. 61	-	-	
兴业证券股	202111	三六零	2021 年	123,700.	10,000	14	0.02	81.78	-	-	

份有限公司	150000 5581		11 月 15 日	00							
兴业证券股 份有限公司	202111 150000 5583	辽宁成 大	2021 年 11 月 15 日	434,475. 00	22,500	14	0.02	287.24	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 150000 5585	川投能 源	2021 年 11 月 15 日	1,026,60 0.00	87,000	14	0.02	678.70	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 150000 5587	金风科 技	2021 年 11 月 15 日	3,082,48 6.00	167,800	14	0.02	2,037. 87	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 150000 5589	巨人网 络	2021 年 11 月 15 日	1,375,14 5.00	120,100	14	0.02	909.12	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 150000 5591	完美世 界	2021 年 11 月 15 日	1,943,55 2.00	94,900	14	0.02	1,284. 90	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 150000 5593	安迪苏	2021 年 11 月 15 日	1,121,60 2.00	89,800	14	0.02	741.50	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 150000 6023	中牧股 份	2021 年 11 月 15 日	5,754,32 0.00	503,000	14	0.02	3,804. 24	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 150000 6025	万达电 影	2021 年 11 月 15 日	416,416. 00	28,600	14	0.02	275.30	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 170000 0784	亚光科 技	2021 年 11 月 17 日	47,892.0 0	5,200	14	0.03	63.32	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 170000 0847	美的集 团	2021 年 11 月 17 日	2,083,97 9.00	28,900	14	0.02	1,377. 74	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 170000 0937	双汇发 展	2021 年 11 月 17 日	2,134,86 0.00	69,000	14	0.02	1,411. 38	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 170000 1129	巨人网 络	2021 年 11 月 17 日	1,693,50 0.00	150,000	14	0.02	1,119. 59	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 170000 1169	万达电 影	2021 年 11 月 17 日	671,140. 00	46,000	14	0.02	443.70	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 170000 1329	东软集 团	2021 年 11 月 17 日	1,977,36 5.00	188,500	14	0.02	1,307. 26	-	-	

兴业证券股份有限公司	2021111700001384	豫园股份	2021年11月17日	474,210.00	47,900	14	0.02	313.51	-	-
兴业证券股份有限公司	2021111700001429	华海药业	2021年11月17日	1,519,700.00	70,000	14	0.02	1,004.69	-	-
兴业证券股份有限公司	2021111700003427	王府井	2021年11月17日	421,275.00	13,700	14	0.02	278.51	-	-
兴业证券股份有限公司	2021111700003429	云海金属	2021年11月17日	11,837,100.00	633,000	14	0.02	7,825.64	-	-
兴业证券股份有限公司	2021111700003935	三六零	2021年11月17日	2,921,802.00	239,100	14	0.02	1,931.64	-	-
兴业证券股份有限公司	2021111700003973	贵阳银行	2021年11月17日	1,253,826.00	192,600	14	0.02	828.92	-	-
兴业证券股份有限公司	2021111700004175	徐工机械	2021年11月17日	2,004,042.00	330,700	14	0.02	1,324.89	-	-
兴业证券股份有限公司	2021111700004317	万达电影	2021年11月17日	1,908,372.00	130,800	14	0.02	1,261.65	-	-
兴业证券股份有限公司	2021111700004447	亨通光电	2021年11月17日	2,170,485.00	125,100	14	0.02	1,434.93	-	-
兴业证券股份有限公司	2021111700004465	豫园股份	2021年11月17日	322,740.00	32,600	14	0.02	213.37	-	-
兴业证券股份有限公司	2021111800004787	安迪苏	2021年11月18日	2,736,489.00	217,700	14	0.02	1,809.12	-	-
兴业证券股份有限公司	2021111800005279	金风科技	2021年11月18日	1,074,788.00	57,200	14	0.02	710.55	-	-
兴业证券股份有限公司	2021111900001071	平安银行	2021年11月19日	6,352,500.00	350,000	14	0.02	4,199.71	-	-
兴业证券股份有限公司	2021111900001233	双汇发展	2021年11月19日	3,322,000.00	110,000	14	0.02	2,196.21	-	-
兴业证券股份有限公司	202111190000	中天科技	2021年11月	925,000.00	50,000	14	0.02	611.53	-	-

	1757		19 日								
兴业证券股份 有限公司	202111 190000 4627	开滦股 份	2021 年 11 月 19 日	310,950. 00	45,000	14	0.02	205.57	-	-	
兴业证券股份 有限公司	202111 190000 5513	中联重 科	2021 年 11 月 19 日	4,377,21 7.00	635,300	14	0.02	2,893. 83	-	-	
兴业证券股份 有限公司	202111 190000 5519	美的集 团	2021 年 11 月 19 日	1,001,00 0.00	14,300	14	0.02	661.77	-	-	
兴业证券股份 有限公司	202111 190000 5637	五粮液	2021 年 11 月 19 日	8,929,20 0.00	42,000	14	0.02	5,903. 19	-	-	
兴业证券股份 有限公司	202111 190000 5655	双汇发 展	2021 年 11 月 19 日	2,234,80 0.00	74,000	14	0.02	1,477. 45	-	-	
兴业证券股份 有限公司	202111 190000 5735	三六零	2021 年 11 月 19 日	385,521. 00	32,100	14	0.02	254.87	-	-	
兴业证券股份 有限公司	202111 190001 1053	药明康 德	2021 年 11 月 19 日	2,058,74 0.00	15,800	14	0.02	1,361. 06	-	-	
兴业证券股份 有限公司	202111 190001 7757	老板电 器	2021 年 11 月 19 日	327,800. 00	10,000	14	0.02	216.71	-	-	
兴业证券股份 有限公司	202111 190001 7815	完美世 界	2021 年 11 月 19 日	991,500. 00	50,000	14	0.02	655.49	-	-	
兴业证券股份 有限公司	202111 190001 8005	安迪苏	2021 年 11 月 19 日	387,045. 00	30,500	14	0.02	255.88	-	-	
兴业证券股份 有限公司	202111 220000 0972	徐工机 械	2021 年 11 月 22 日	1,082,39 3.00	180,700	14	0.02	715.58	-	-	
兴业证券股份 有限公司	202111 220000 1176	三七互 娱	2021 年 11 月 22 日	1,989,25 4.00	76,100	14	0.02	1,315. 12	-	-	
兴业证券股份 有限公司	202111 220000 1178	索菲亚	2021 年 11 月 22 日	409,400. 00	23,000	14	0.02	270.66	-	-	
兴业证券股份 有限公司	202111 220000 1380	上海机 场	2021 年 11 月 22 日	1,749,24 0.00	36,000	14	0.02	1,156. 44	-	-	
兴业证券股	202111	巨人网	2021 年	1,985,22	184,500	14	0.02	1,312.	-	-	

份有限公司	220001 1226	络	11月 22日	0.00				45		
兴业证券股 份有限公司	202111 220001 3560	贵阳银 行	2021年 11月 22日	332,010. 00	51,000	14	0.02	219.50	-	-
兴业证券股 份有限公司	202111 230000 7078	平安银 行	2021年 11月 23日	3,576,00 0.00	200,000	14	0.02	2,364. 13	-	-
兴业证券股 份有限公司	202111 230000 8538	科伦药 业	2021年 11月 23日	2,069,43 2.00	111,200	14	0.02	1,368. 12	-	-
兴业证券股 份有限公司	202111 240000 0836	碧水源	2021年 11月 24日	1,983,15 0.00	282,500	14	0.03	2,467. 92	-	-
兴业证券股 份有限公司	202111 240000 1028	三七互 娱	2021年 11月 24日	1,974,11 2.00	78,400	14	0.02	1,305. 11	-	-
兴业证券股 份有限公司	202111 240000 1062	万达电 影	2021年 11月 24日	259,875. 00	17,500	14	0.02	171.81	-	-
兴业证券股 份有限公司	202111 240000 2463	巨人网 络	2021年 11月 24日	230,688. 00	21,600	14	0.02	152.51	-	-
兴业证券股 份有限公司	202111 240000 2465	三七互 娱	2021年 11月 24日	1,153,24 4.00	45,800	14	0.02	762.42	-	-
兴业证券股 份有限公司	202111 240000 9453	泸州老 窖	2021年 11月 24日	2,349,50 0.00	10,000	14	0.02	1,553. 28	-	-
兴业证券股 份有限公司	202111 250000 6048	中国神 华	2021年 11月 25日	564,618. 00	27,800	14	0.02	373.28	-	-
兴业证券股 份有限公司	202111 250000 6050	重庆百 货	2021年 11月 25日	1,058,85 0.00	45,000	14	0.02	700.02	-	-
兴业证券股 份有限公司	202111 250000 6052	安迪苏	2021年 11月 25日	574,424. 00	47,200	14	0.02	379.76	-	-
兴业证券股 份有限公司	202111 250000 6054	上海建 工	2021年 11月 25日	496,125. 00	157,500	14	0.02	327.99	-	-
兴业证券股 份有限公司	202111 250000 6056	康弘药 业	2021年 11月 25日	4,894,60 8.00	256,800	14	0.02	3,235. 88	-	-

兴业证券股份有限公司	2021112500006058	金融街	2021年11月25日	322,624.00	56,800	14	0.02	213.29	-	-
兴业证券股份有限公司	2021112600000784	双汇发展	2021年11月26日	2,090,900.00	72,100	14	0.02	1,382.32	-	-
兴业证券股份有限公司	2021112600000880	康弘药业	2021年11月26日	1,131,082.00	60,100	14	0.02	747.77	-	-
兴业证券股份有限公司	2021112600000926	大秦铁路	2021年11月26日	2,697,084.00	440,700	14	0.02	1,783.07	-	-
兴业证券股份有限公司	2021112600000991	上海机场	2021年11月26日	829,488.00	17,600	14	0.02	548.38	-	-
兴业证券股份有限公司	2021112600001050	浙江龙盛	2021年11月26日	497,772.00	39,600	14	0.02	329.08	-	-
兴业证券股份有限公司	2021112600001052	广汇汽车	2021年11月26日	567,000.00	225,000	14	0.02	374.85	-	-
兴业证券股份有限公司	2021112600002116	五粮液	2021年11月26日	2,228,600.00	10,000	14	0.02	1,473.35	-	-
兴业证券股份有限公司	2021112600002180	科伦药业	2021年11月26日	1,999,280.00	107,200	14	0.02	1,321.75	-	-
兴业证券股份有限公司	2021112600002182	索菲亚	2021年11月26日	1,925,280.00	112,000	14	0.02	1,272.82	-	-
兴业证券股份有限公司	2021112600002184	万达电影	2021年11月26日	1,845,725.00	132,500	14	0.02	1,220.23	-	-
兴业证券股份有限公司	2021112600002186	华润双鹤	2021年11月26日	957,780.00	76,500	14	0.02	633.20	-	-
兴业证券股份有限公司	2021112900000980	淮北矿业	2021年11月29日	1,066,000.00	100,000	14	0.02	704.74	-	-
兴业证券股份有限公司	2021112900001002	盘江股份	2021年11月29日	1,063,500.00	150,000	14	0.02	703.09	-	-
兴业证券股份有限公司	202111290000	浙江龙盛	2021年11月	795,555.00	63,900	14	0.02	525.95	-	-

	1094		29 日								
兴业证券股 份有限公司	202111 290000 1116	中国中 铁	2021 年 11 月 29 日	798,000. 00	150,000	14	0.02	527.57	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 290000 3291	豫园股 份	2021 年 11 月 29 日	571,200. 00	60,000	14	0.02	377.63	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 290000 3293	中国中 免	2021 年 11 月 29 日	2,033,00 0.00	10,000	14	0.02	1,344. 04	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 290000 3295	三六零	2021 年 11 月 29 日	118,900. 00	10,000	14	0.02	78.61	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 290000 3297	盘江股 份	2021 年 11 月 29 日	815,350. 00	115,000	14	0.02	539.04	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 290000 3299	辽宁成 大	2021 年 11 月 29 日	418,275. 00	22,500	14	0.02	276.53	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 290000 3301	川投能 源	2021 年 11 月 29 日	999,630. 00	87,000	14	0.02	660.87	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 290000 3303	安迪苏	2021 年 11 月 29 日	1,056,94 6.00	89,800	14	0.02	698.76	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 290000 3305	中牧股 份	2021 年 11 月 29 日	11,000,0 00.00	1,000,00 0	14	0.02	7,272. 22	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 290000 3307	云海金 属	2021 年 11 月 29 日	3,204,50 0.00	145,000	14	0.02	2,118. 53	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 290000 3309	完美世 界	2021 年 11 月 29 日	1,868,58 1.00	94,900	14	0.02	1,235. 34	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 290000 3311	云海金 属	2021 年 11 月 29 日	2,696,20 0.00	122,000	14	0.02	1,782. 49	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 290000 3313	金风科 技	2021 年 11 月 29 日	3,070,74 0.00	167,800	14	0.02	2,030. 10	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 290000 3315	华润三 九	2021 年 11 月 29 日	1,591,48 8.00	64,800	14	0.02	1,052. 15	-	-	
兴业证券股	202111	中联重	2021 年	1,188,49	171,500	14	0.02	785.73	-	-	

份有限公司	290000 3317	科	11月 29日	5.00							
兴业证券股 份有限公司	202111 290000 3807	招商蛇 口	2021年 11月 29日	417,070. 00	35,800	14	0.02	275.73	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 290000 3813	中牧股 份	2021年 11月 29日	5,533.00 0.00	503,000	14	0.02	3,657. 93	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202111 290000 3827	万达电 影	2021年 11月 29日	389,818. 00	28,600	14	0.02	257.71	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 010000 1142	徐工机 械	2021年 12月1 日	119,400. 00	20,000	14	0.02	78.94	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 010000 1392	三七互 娱	2021年 12月1 日	234,600. 00	10,000	14	0.02	155.10	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 010000 1442	亨通光 电	2021年 12月1 日	1,289.60 0.00	80,000	14	0.02	852.57	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 010000 1516	东软集 团	2021年 12月1 日	896,800. 00	80,000	14	0.02	592.88	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 010000 1663	锦江酒 店	2021年 12月1 日	1,989.68 5.00	38,300	14	0.02	1,315. 40	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 010000 1694	金地集 团	2021年 12月1 日	579,124. 00	55,900	14	0.02	382.87	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 010000 1699	浙江龙 盛	2021年 12月1 日	1,358.90 0.00	107,000	14	0.02	898.38	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 010000 2693	万达电 影	2021年 12月1 日	1,848.20 4.00	130,800	14	0.02	1,221. 87	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 010000 2695	万达电 影	2021年 12月1 日	649,980. 00	46,000	14	0.02	429.71	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 010000 2705	亨通光 电	2021年 12月1 日	2,016.61 2.00	125,100	14	0.02	1,333. 20	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 010000 2709	华海药 业	2021年 12月1 日	1,469.30 0.00	70,000	14	0.02	971.37	-	-	

兴业证券股份有限公司	2021120100002711	豫园股份	2021年12月1日	311,330.00	32,600	14	0.02	205.82	-	-
兴业证券股份有限公司	2021120100002713	豫园股份	2021年12月1日	457,445.00	47,900	14	0.02	302.42	-	-
兴业证券股份有限公司	2021120100002715	东软集团	2021年12月1日	2,113,085.00	188,500	14	0.02	1,396.98	-	-
兴业证券股份有限公司	2021120100002723	三六零	2021年12月1日	2,900,283.00	239,100	14	0.02	1,917.41	-	-
兴业证券股份有限公司	2021120100002727	贵阳银行	2021年12月1日	1,251,900.00	192,600	14	0.02	827.65	-	-
兴业证券股份有限公司	2021120100003347	美的集团	2021年12月1日	1,969,824.00	28,900	14	0.02	1,302.27	-	-
兴业证券股份有限公司	2021120100003351	双汇发展	2021年12月1日	2,014,800.00	69,000	14	0.02	1,332.01	-	-
兴业证券股份有限公司	2021120200003667	安迪苏	2021年12月2日	2,551,444.00	217,700	14	0.02	1,686.79	-	-
兴业证券股份有限公司	2021120200003669	金风科技	2021年12月2日	1,007,864.00	57,200	14	0.02	666.31	-	-
兴业证券股份有限公司	2021120300001045	中联重科	2021年12月3日	740,000.00	100,000	14	0.02	489.22	-	-
兴业证券股份有限公司	2021120300001052	徐工机械	2021年12月3日	1,210,000.00	200,000	14	0.02	799.94	-	-
兴业证券股份有限公司	2021120300001164	美年健康	2021年12月3日	3,235,535.00	434,300	14	0.02	2,139.05	-	-
兴业证券股份有限公司	2021120300001215	云海金属	2021年12月3日	5,995,000.00	250,000	14	0.02	3,963.36	-	-
兴业证券股份有限公司	2021120300001252	科伦药业	2021年12月3日	1,919,000.00	100,000	14	0.02	1,268.67	-	-
兴业证券股份有限公司	202112030000	巨人网络	2021年12月3日	333,995.00	33,500	14	0.02	220.81	-	-

	1287		日								
兴业证券股 份有限公司	202112 030000 1444	东软集 团	2021年 12月3 日	1,983,43 8.00	181,800	14	0.02	1,311. 27	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 030000 1458	中国人 寿	2021年 12月3 日	1,464,50 0.00	50,000	14	0.02	968.20	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 030000 1521	王府井	2021年 12月3 日	380,038. 00	13,700	14	0.02	251.25	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 030000 1565	中国铁 建	2021年 12月3 日	775,000. 00	100,000	14	0.02	512.36	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 030000 5261	三六零	2021年 12月3 日	393,546. 00	32,100	14	0.02	260.18	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 030000 5481	老板电 器	2021年 12月3 日	311,300. 00	10,000	14	0.02	205.80	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 030000 5787	完美世 界	2021年 12月3 日	961,500. 00	50,000	14	0.02	635.66	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 030000 5821	药明康 德	2021年 12月3 日	2,240,44 0.00	15,800	14	0.02	1,481. 18	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 030000 6305	安迪苏	2021年 12月3 日	360,510. 00	30,500	14	0.02	238.34	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 030000 7457	平安银 行	2021年 12月3 日	6,177,50 0.00	350,000	14	0.02	4,084. 01	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 030000 7495	中联重 科	2021年 12月3 日	4,701,22 0.00	635,300	14	0.02	3,108. 03	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 030000 7513	美的集 团	2021年 12月3 日	960,388. 00	14,300	14	0.02	634.92	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 030000 8993	五粮液	2021年 12月3 日	9,636,90 0.00	42,000	14	0.02	6,371. 06	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 030000 9005	双汇发 展	2021年 12月3 日	2,235,54 0.00	74,000	14	0.02	1,477. 94	-	-	
兴业证券股	202112	中天科	2021年	815,500.	50,000	14	0.02	539.14	-	-	

份有限公司	030000 9089	技	12月3 日	00							
兴业证券股 份有限公司	202112 060000 1523	陕西煤 业	2021年 12月6 日	1,980,76 8.00	150,400	14	0.02	1,309. 51	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 060000 1637	东软集 团	2021年 12月6 日	2,049,29 4.00	183,300	14	0.02	1,354. 81	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 060000 6254	贵阳银 行	2021年 12月6 日	332,520. 00	51,000	14	0.02	219.83	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 060000 6256	上海机 场	2021年 12月6 日	1,645,56 0.00	36,000	14	0.02	1,087. 90	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 060000 6258	三七互 娱	2021年 12月6 日	1,764,75 9.00	76,100	14	0.02	1,166. 70	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 070000 0658	亚光科 技	2021年 12月7 日	1,652,40 0.00	180,000	14	0.03	2,184. 84	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 070000 5841	科伦药 业	2021年 12月7 日	2,101,68 0.00	111,200	14	0.02	1,389. 44	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 080000 0807	芒果超 媒	2021年 12月8 日	858,816. 00	18,900	14	0.03	1,068. 75	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 080000 1046	徐工机 械	2021年 12月8 日	306,885. 00	49,900	14	0.02	202.89	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 080000 1159	云海金 属	2021年 12月8 日	5,066,56 0.00	227,200	14	0.02	3,349. 56	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 080000 1214	海康威 视	2021年 12月8 日	3,307,52 0.00	64,000	14	0.02	2,186. 64	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 080000 1318	大秦铁 路	2021年 12月8 日	3,155,00 0.00	500,000	14	0.02	2,085. 81	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 080000 1446	浙江龙 盛	2021年 12月8 日	425,040. 00	33,600	14	0.02	281.00	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 080000 1480	上海医 药	2021年 12月8 日	370,000. 00	20,000	14	0.02	244.61	-	-	

兴业证券股份有限公司	2021120800001528	中国铁建	2021年12月8日	233,100.00	30,000	14	0.02	154.11	-	-
兴业证券股份有限公司	2021120800004310	泸州老窖	2021年12月8日	2,528,700.00	10,000	14	0.02	1,671.75	-	-
兴业证券股份有限公司	2021120800004328	三七互娱	2021年12月8日	1,967,840.00	78,400	14	0.02	1,300.96	-	-
兴业证券股份有限公司	2021120800004384	巨人网络	2021年12月8日	217,944.00	21,600	14	0.02	144.09	-	-
兴业证券股份有限公司	2021120800004386	三七互娱	2021年12月8日	1,149,580.00	45,800	14	0.02	760.00	-	-
兴业证券股份有限公司	2021120800004388	万达电影	2021年12月8日	252,175.00	17,500	14	0.02	166.72	-	-
兴业证券股份有限公司	2021120800005290	碧水源	2021年12月8日	2,036,825.00	282,500	14	0.03	2,534.72	-	-
兴业证券股份有限公司	2021120900003371	中国神华	2021年12月9日	606,040.00	27,800	14	0.02	400.66	-	-
兴业证券股份有限公司	2021120900004345	金融街	2021年12月9日	324,328.00	56,800	14	0.02	214.42	-	-
兴业证券股份有限公司	2021120900005473	康弘药业	2021年12月9日	4,827,840.00	256,800	14	0.02	3,191.74	-	-
兴业证券股份有限公司	2021120900005579	上海建工	2021年12月9日	522,900.00	157,500	14	0.02	345.70	-	-
兴业证券股份有限公司	2021120900005621	安迪苏	2021年12月9日	576,784.00	47,200	14	0.02	381.32	-	-
兴业证券股份有限公司	2021120900005797	重庆百货	2021年12月9日	1,317,600.00	45,000	14	0.02	871.08	-	-
兴业证券股份有限公司	2021121000000397	亚光科技	2021年12月10日	1,367,534.00	142,600	14	0.03	1,808.18	-	-
兴业证券股份有限公司	202112100000	中联重科	2021年12月	141,149.00	19,100	14	0.02	93.32	-	-

	0592		10 日								
兴业证券股 份有限公司	202112 100000 0599	徐工机 械	2021 年 12 月 10 日	121,800. 00	20,000	14	0.02	80.52	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 100000 0669	云海金 属	2021 年 12 月 10 日	3,153,80 0.00	130,000	14	0.02	2,085. 01	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 100000 0756	淮北矿 业	2021 年 12 月 10 日	530,400. 00	48,000	14	0.02	350.65	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 100000 0786	中天科 技	2021 年 12 月 10 日	1,364,80 0.00	80,000	14	0.02	902.28	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 100000 0807	东软集 团	2021 年 12 月 10 日	1,910,10 8.00	155,800	14	0.02	1,262. 79	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 100000 0872	华友钴 业	2021 年 12 月 10 日	2,039,17 5.00	15,900	14	0.02	1,348. 12	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 100000 1605	大秦铁 路	2021 年 12 月 10 日	2,736,74 7.00	440,700	14	0.02	1,809. 29	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 100000 2181	五粮液	2021 年 12 月 10 日	2,470,00 0.00	10,000	14	0.02	1,632. 94	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 100000 2595	科伦药 业	2021 年 12 月 10 日	2,020,72 0.00	107,200	14	0.02	1,335. 92	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 100000 2613	索菲亚	2021 年 12 月 10 日	2,206,40 0.00	112,000	14	0.02	1,458. 68	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 100000 2633	万达电 影	2021 年 12 月 10 日	1,945,10 0.00	132,500	14	0.02	1,285. 93	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 100000 2637	康弘药 业	2021 年 12 月 10 日	1,126,27 4.00	60,100	14	0.02	744.59	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 100000 2647	上海机 场	2021 年 12 月 10 日	817,872. 00	17,600	14	0.02	540.70	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 100000 2687	华润双 鹤	2021 年 12 月 10 日	918,000. 00	76,500	14	0.02	606.90	-	-	
兴业证券股	202112	广汇汽	2021 年	587,250.	225,000	14	0.02	388.24	-	-	

份有限公司	100000 2727	车	12月 10日	00							
兴业证券股 份有限公司	202112 100000 2737	浙江龙 盛	2021年 12月 10日	507,276. 00	39,600	14	0.02	335.37	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 130000 0617	亚光科 技	2021年 12月 13日	774,400. 00	80,000	14	0.03	1,023. 93	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 130000 6471	中牧股 份	2021年 12月 13日	5,849,89 0.00	503,000	14	0.02	3,867. 43	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 130000 6473	万达电 影	2021年 12月 13日	414,986. 00	28,600	14	0.02	274.35	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 130000 8409	中国中 铁	2021年 12月 13日	850,500. 00	150,000	14	0.02	562.28	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 130000 8411	川投能 源	2021年 12月 13日	1,037,04 0.00	87,000	14	0.02	685.60	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 130000 8413	淮北矿 业	2021年 12月 13日	1,117,00 0.00	100,000	14	0.02	738.46	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 130000 8415	中国中 免	2021年 12月 13日	2,292,00 0.00	10,000	14	0.02	1,515. 27	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 130000 8417	三六零	2021年 12月 13日	124,000. 00	10,000	14	0.02	81.98	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 130000 8419	豫园股 份	2021年 12月 13日	599,400. 00	60,000	14	0.02	396.27	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 130000 8421	盘江股 份	2021年 12月 13日	1,111,50 0.00	150,000	14	0.02	734.83	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 130000 8423	辽宁成 大	2021年 12月 13日	425,250. 00	22,500	14	0.02	281.14	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 130000 8425	安迪苏	2021年 12月 13日	1,093,76 4.00	89,800	14	0.02	723.10	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 130000 8427	盘江股 份	2021年 12月 13日	852,150. 00	115,000	14	0.02	563.37	-	-	

兴业证券股份有限公司	2021121300008429	中牧股份	2021年12月13日	11,630,000.00	1,000,000	14	0.02	7,688.72	-	-
兴业证券股份有限公司	2021121300008431	云海金属	2021年12月13日	3,448,100.00	145,000	14	0.02	2,279.58	-	-
兴业证券股份有限公司	2021121300008433	浙江龙盛	2021年12月13日	809,613.00	63,900	14	0.02	535.24	-	-
兴业证券股份有限公司	2021121300008435	完美世界	2021年12月13日	2,083,055.00	94,900	14	0.02	1,377.13	-	-
兴业证券股份有限公司	2021121300008437	云海金属	2021年12月13日	2,901,160.00	122,000	14	0.02	1,917.99	-	-
兴业证券股份有限公司	2021121300008439	金风科技	2021年12月13日	3,042,214.00	167,800	14	0.02	2,011.24	-	-
兴业证券股份有限公司	2021121300008441	华润三九	2021年12月13日	1,666,656.00	64,800	14	0.02	1,101.84	-	-
兴业证券股份有限公司	2021121300008443	中联重科	2021年12月13日	1,293,110.00	171,500	14	0.02	854.89	-	-
兴业证券股份有限公司	2021121500013041	三六零	2021年12月15日	2,907,456.00	239,100	14	0.02	1,922.15	-	-
兴业证券股份有限公司	2021121500013091	贵阳银行	2021年12月15日	1,249,974.00	192,600	14	0.02	826.37	-	-
兴业证券股份有限公司	2021121500013335	三七互娱	2021年12月15日	249,000.00	10,000	14	0.02	164.62	-	-
兴业证券股份有限公司	2021121500013339	东软集团	2021年12月15日	1,000,800.00	80,000	14	0.02	661.64	-	-
兴业证券股份有限公司	2021121500013643	浙江龙盛	2021年12月15日	1,335,360.00	107,000	14	0.02	882.82	-	-
兴业证券股份有限公司	2021121500013865	双汇发展	2021年12月15日	2,087,940.00	69,000	14	0.02	1,380.36	-	-
兴业证券股份有限公司	202112150001	万达电影	2021年12月	1,901,832.00	130,800	14	0.02	1,257.32	-	-

	4001		15 日								
兴业证券股 份有限公司	202112 150001 4005	万达电 影	2021 年 12 月 15 日	668,840. 00	46,000	14	0.02	442.18	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 150001 4073	金地集 团	2021 年 12 月 15 日	586,950. 00	55,900	14	0.02	388.04	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 150001 4091	亨通光 电	2021 年 12 月 15 日	1,932,79 5.00	125,100	14	0.02	1,277. 79	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 150001 4095	亨通光 电	2021 年 12 月 15 日	1,236,00 0.00	80,000	14	0.02	817.13	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 150001 4097	华海药 业	2021 年 12 月 15 日	1,368,50 0.00	70,000	14	0.02	904.73	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 150001 4117	豫园股 份	2021 年 12 月 15 日	325,348. 00	32,600	14	0.02	215.09	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 150001 4119	豫园股 份	2021 年 12 月 15 日	478,042. 00	47,900	14	0.02	316.04	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 150001 4137	锦江酒 店	2021 年 12 月 15 日	2,064,37 0.00	38,300	14	0.02	1,364. 78	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 150001 4139	东软集 团	2021 年 12 月 15 日	2,358,13 5.00	188,500	14	0.02	1,558. 99	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 150001 5531	美的集 团	2021 年 12 月 15 日	2,033,11 5.00	28,900	14	0.02	1,344. 11	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 160000 5777	安迪苏	2021 年 12 月 16 日	2,616,75 4.00	217,700	14	0.02	1,729. 97	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 160000 7239	金风科 技	2021 年 12 月 16 日	1,069,64 0.00	57,200	14	0.02	707.15	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 170000 5085	巨人网 络	2021 年 12 月 17 日	1,112,00 0.00	100,000	14	0.02	735.16	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 170000 5281	康弘药 业	2021 年 12 月 17 日	1,977,48 0.00	108,000	14	0.02	1,307. 33	-	-	
兴业证券股	202112	金证股	2021 年	681,500.	50,000	14	0.02	450.55	-	-	

份有限公司	170000 6208	份	12月 17日	00							
兴业证券股 份有限公司	202112 170000 6288	盘江股 份	2021年 12月 17日	724,850. 00	95,000	14	0.02	479.21	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 170000 6400	中天科 技	2021年 12月 17日	184,200. 00	10,000	14	0.02	121.78	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 170001 8008	东软集 团	2021年 12月 17日	2,212,50 6.00	181,800	14	0.02	1,462. 71	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 170001 8066	中国铁 建	2021年 12月 17日	778,000. 00	100,000	14	0.02	514.34	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 170001 8108	中国人 寿	2021年 12月 17日	1,496,50 0.00	50,000	14	0.02	989.35	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 170002 2754	中天科 技	2021年 12月 17日	921,000. 00	50,000	14	0.02	608.88	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 170002 2756	王府井	2021年 12月 17日	368,256. 00	13,700	14	0.02	243.46	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 170002 3706	平安银 行	2021年 12月 17日	6,149,50 0.00	350,000	14	0.02	4,065. 50	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 170002 3736	中联重 科	2021年 12月 17日	4,694,86 7.00	635,300	14	0.02	3,103. 83	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 170002 3740	美的集 团	2021年 12月 17日	982,410. 00	14,300	14	0.02	649.48	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 170002 3742	徐工机 械	2021年 12月 17日	1,222,00 0.00	200,000	14	0.02	807.88	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 170002 3804	双汇发 展	2021年 12月 17日	2,228,14 0.00	74,000	14	0.02	1,473. 05	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 170002 3832	美年健 康	2021年 12月 17日	3,222,50 6.00	434,300	14	0.02	2,130. 43	-	-	
兴业证券股 份有限公司	202112 170002 3924	老板电 器	2021年 12月 17日	335,100. 00	10,000	14	0.02	221.54	-	-	

兴业证券股份有限公司	2021121700023936	巨人网络	2021年12月17日	372,520.00	33,500	14	0.02	246.28	-	-
兴业证券股份有限公司	2021122000002001	泸州老窖	2021年12月20日	2,872,740.00	11,600	14	0.02	1,899.20	2,944,892.00	1,492.26
兴业证券股份有限公司	2021122000002391	巨人网络	2021年12月20日	380,100.00	35,000	14	0.02	251.29	418,950.00	197.45
兴业证券股份有限公司	2021122000006321	贵阳银行	2021年12月20日	330,480.00	51,000	14	0.02	218.48	332,010.00	171.71
兴业证券股份有限公司	2021122000006323	东软集团	2021年12月20日	2,219,763.00	183,300	14	0.02	1,467.51	2,485,548.00	1,153.02
兴业证券股份有限公司	2021122000006325	三七互娱	2021年12月20日	1,837,815.00	76,100	14	0.02	1,215.00	2,056,222.00	954.69
兴业证券股份有限公司	2021122000006327	陕西煤业	2021年12月20日	1,934,144.00	150,400	14	0.02	1,278.68	1,834,880.00	1,004.63
兴业证券股份有限公司	2021122000006329	上海机场	2021年12月20日	1,564,560.00	36,000	14	0.02	1,034.35	1,680,840.00	812.68
兴业证券股份有限公司	2021122100015773	科伦药业	2021年12月21日	2,024,952.00	111,200	14	0.02	1,338.72	2,105,016.00	956.20
兴业证券股份有限公司	2021122100020069	亚光科技	2021年12月21日	1,623,600.00	180,000	14	0.03	2,146.76	1,632,600.00	1,533.40
兴业证券股份有限公司	2021122200002458	招商蛇口	2021年12月22日	327,600.00	25,200	14	0.02	216.58	336,168.00	139.23
兴业证券股份有限公司	2021122200002713	云海金属	2021年12月22日	6,102,360.00	253,000	14	0.02	4,034.34	5,803,820.00	2,593.53
兴业证券股份有限公司	2021122200003113	巨人网络	2021年12月22日	565,500.00	50,000	14	0.02	373.86	598,500.00	240.30
兴业证券股份有限公司	2021122200003200	万达电影	2021年12月22日	401,472.00	27,200	14	0.02	265.42	421,056.00	170.64
兴业证券股份有限公司	202112220000	川投能源	2021年12月	1,416,000.00	120,000	14	0.02	936.13	1,500,000.00	601.83

	3608		22 日								
兴业证券股 份有限公司	202112 220000 8662	大秦铁 路	2021 年 12 月 22 日	3,190,00 0.00	500,000	14	0.02	2,108. 94	3,200, 000.00	1,355.7 6	
兴业证券股 份有限公司	202112 220000 8666	上海医 药	2021 年 12 月 22 日	379,600. 00	20,000	14	0.02	250.96	397,40 0.00	161.37	
兴业证券股 份有限公司	202112 220001 0624	泸州老 窖	2021 年 12 月 22 日	2,522,80 0.00	10,000	14	0.02	1,667. 85	2,538, 700.00	1,072.1 7	
兴业证券股 份有限公司	202112 220001 0682	浙江龙 盛	2021 年 12 月 22 日	418,320. 00	33,600	14	0.02	276.56	424,36 8.00	177.75	
兴业证券股 份有限公司	202112 220001 2014	芒果超 媒	2021 年 12 月 22 日	1,005,29 1.00	18,900	14	0.03	1,251. 03	1,081, 458.00	804.24	
兴业证券股 份有限公司	202112 220001 2086	碧水源	2021 年 12 月 22 日	2,110,27 5.00	282,500	14	0.03	2,626. 12	2,031, 175.00	1,688.2 2	
兴业证券股 份有限公司	202112 230000 7441	金融街	2021 年 12 月 23 日	322,624. 00	56,800	14	0.02	213.29	321,48 8.00	121.92	
兴业证券股 份有限公司	202112 230000 7549	康弘药 业	2021 年 12 月 23 日	4,714,84 8.00	256,800	14	0.02	3,117. 04	5,225, 880.00	1,781.2 0	
兴业证券股 份有限公司	202112 230000 7573	安迪苏	2021 年 12 月 23 日	553,656. 00	47,200	14	0.02	366.03	581,50 4.00	209.12	
兴业证券股 份有限公司	202112 230000 7603	重庆百 货	2021 年 12 月 23 日	1,168,65 0.00	45,000	14	0.02	772.61	1,170, 900.00	441.52	
兴业证券股 份有限公司	202112 230000 8073	中国神 华	2021 年 12 月 23 日	630,226. 00	27,800	14	0.02	416.65	626,05 6.00	238.08	
兴业证券股 份有限公司	202112 240000 1526	亚光科 技	2021 年 12 月 24 日	2,752,64 0.00	312,800	14	0.03	3,425. 51	2,837, 096.00	1,712.7 6	
兴业证券股 份有限公司	202112 240000 2727	三七互 娱	2021 年 12 月 24 日	2,022,99 6.00	78,900	14	0.02	1,337. 43	2,131, 878.00	668.71	
兴业证券股 份有限公司	202112 240000 2857	万达电 影	2021 年 12 月 24 日	888,000. 00	60,000	14	0.02	587.07	928,80 0.00	293.51	
兴业证券股	202112	徐工机	2021 年	119,800.	20,000	14	0.02	79.20	119,80	39.62	

份有限公司	240000 8198	械	12月 24日	00					0.00	
兴业证券股 份有限公司	202112 240000 8200	五粮液	2021年 12月 24日	2,419,40 0.00	10,000	14	0.02	1,599. 49	2,226, 600.00	799.75
兴业证券股 份有限公司	202112 240000 8204	科伦药 业	2021年 12月 24日	1,983,20 0.00	107,200	14	0.02	1,311. 12	2,029, 296.00	655.55
兴业证券股 份有限公司	202112 240000 8206	索菲亚	2021年 12月 24日	2,252,32 0.00	112,000	14	0.02	1,489. 03	2,486, 400.00	744.52
兴业证券股 份有限公司	202112 240000 8214	康弘药 业	2021年 12月 24日	1,117,25 9.00	60,100	14	0.02	738.63	1,223, 035.00	369.32
兴业证券股 份有限公司	202112 240000 8216	万达电 影	2021年 12月 24日	1,961,00 0.00	132,500	14	0.02	1,296. 44	2,051, 100.00	648.20
兴业证券股 份有限公司	202112 240000 8220	上海机 场	2021年 12月 24日	784,432. 00	17,600	14	0.02	518.60	821,74 4.00	259.28
兴业证券股 份有限公司	202112 240000 8222	华润双 鹤	2021年 12月 24日	944,010. 00	76,500	14	0.02	624.10	1,022, 805.00	312.06
兴业证券股 份有限公司	202112 240000 8226	广汇汽 车	2021年 12月 24日	594,000. 00	225,000	14	0.02	392.70	600,75 0.00	196.35
兴业证券股 份有限公司	202112 240000 8232	浙江龙 盛	2021年 12月 24日	491,832. 00	39,600	14	0.02	325.16	500,14 8.00	162.61
兴业证券股 份有限公司	202112 240000 8238	东软集 团	2021年 12月 24日	2,036,30 6.00	155,800	14	0.02	1,346. 22	2,112, 648.00	673.12
兴业证券股 份有限公司	202112 240000 8244	大秦铁 路	2021年 12月 24日	2,789,63 1.00	440,700	14	0.02	1,844. 26	2,820, 480.00	922.11
兴业证券股 份有限公司	202112 240000 8246	淮北矿 业	2021年 12月 24日	535,200. 00	48,000	14	0.02	353.83	536,64 0.00	176.89
兴业证券股 份有限公司	202112 240000 8460	中天科 技	2021年 12月 24日	1,278,40 0.00	80,000	14	0.02	845.16	1,356, 800.00	422.59
兴业证券股 份有限公司	202112 240000 8462	云海金 属	2021年 12月 24日	3,240,90 0.00	130,000	14	0.02	2,142. 60	2,982, 200.00	1,071.2 8

兴业证券股份有限公司	202112 270000 1516	云海金属	2021年 12月 27日	2,821,200.00	120,000	14	0.02	1,865.13	2,752,800.00	532.88
兴业证券股份有限公司	202112 270000 4828	中国中铁	2021年 12月 27日	873,000.00	150,000	14	0.02	577.15	868,500.00	164.92
兴业证券股份有限公司	202112 270000 4830	淮北矿业	2021年 12月 27日	1,107,000.00	100,000	14	0.02	731.85	1,118,000.00	209.12
兴业证券股份有限公司	202112 270000 4832	中国中免	2021年 12月 27日	2,200,000.00	10,000	14	0.02	1,454.44	2,194,100.00	415.56
兴业证券股份有限公司	202112 270000 4834	盘江股份	2021年 12月 27日	1,128,000.00	150,000	14	0.02	745.73	1,090,500.00	213.08
兴业证券股份有限公司	202112 270000 4836	川投能源	2021年 12月 27日	1,079,670.00	87,000	14	0.02	713.78	1,087,500.00	203.92
兴业证券股份有限公司	202112 270000 4838	浙江龙盛	2021年 12月 27日	794,277.00	63,900	14	0.02	525.11	807,057.00	150.04
兴业证券股份有限公司	202112 270000 4840	中联重科	2021年 12月 27日	1,231,370.00	171,500	14	0.02	814.07	1,229,655.00	232.60
兴业证券股份有限公司	202112 270000 4842	中牧股份	2021年 12月 27日	13,190,000.00	1,000,000	14	0.02	8,720.06	13,070,000.00	2,491.44
兴业证券股份有限公司	202112 270000 4844	辽宁成大	2021年 12月 27日	429,300.00	22,500	14	0.02	283.82	439,200.00	81.08
兴业证券股份有限公司	202112 270000 4846	盘江股份	2021年 12月 27日	864,800.00	115,000	14	0.02	571.73	836,050.00	163.36
兴业证券股份有限公司	202112 270000 4848	云海金属	2021年 12月 27日	3,408,950.00	145,000	14	0.02	2,253.69	3,326,300.00	643.92
兴业证券股份有限公司	202112 270000 4850	金风科技	2021年 12月 27日	2,699,902.00	167,800	14	0.02	1,784.94	2,763,666.00	510.00
兴业证券股份有限公司	202112 270000 4852	华润三九	2021年 12月 27日	2,118,960.00	64,800	14	0.02	1,400.87	2,218,752.00	400.24
兴业证券股份有限公司	202112 270000	万达电影	2021年 12月	433,290.00	28,600	14	0.02	286.45	442,728.00	81.84

	7514		27 日							
兴业证券股份 有限公司	202112 270000 7608	中牧股 份	2021 年 12 月 27 日	6,634,57 0.00	503,000	14	0.02	4,386. 19	6,574, 210.00	1,253.2 0
兴业证券股份 有限公司	202112 290000 1283	徐工机 械	2021 年 12 月 29 日	1,500,00 0.00	250,000	14	0.02	991.67	1,497, 500.00	141.66
兴业证券股份 有限公司	202112 290000 1721	康弘药 业	2021 年 12 月 29 日	2,005,96 5.00	105,300	14	0.02	1,326. 17	2,142, 855.00	189.46
兴业证券股份 有限公司	202112 290000 2305	华发股 份	2021 年 12 月 29 日	723,600. 00	120,000	14	0.02	478.38	722,40 0.00	68.34
兴业证券股份 有限公司	202112 290000 2337	华友钴 业	2021 年 12 月 29 日	3,952,80 0.00	36,000	14	0.02	2,613. 24	3,971, 160.00	373.32
兴业证券股份 有限公司	202112 290000 5278	双汇发 展	2021 年 12 月 29 日	2,166,60 0.00	69,000	14	0.02	1,432. 36	2,176, 950.00	204.62
兴业证券股份 有限公司	202112 290000 5380	万达电 影	2021 年 12 月 29 日	692,300. 00	46,000	14	0.02	457.69	712,08 0.00	65.38
兴业证券股份 有限公司	202112 290000 5390	万达电 影	2021 年 12 月 29 日	1,968,54 0.00	130,800	14	0.02	1,301. 42	2,024, 784.00	185.92
兴业证券股份 有限公司	202112 290000 5414	金地集 团	2021 年 12 月 29 日	690,924. 00	55,900	14	0.02	456.78	725,02 3.00	65.26
兴业证券股份 有限公司	202112 290000 5430	亨通光 电	2021 年 12 月 29 日	1,823,95 8.00	125,100	14	0.02	1,205. 84	1,891, 512.00	172.26
兴业证券股份 有限公司	202112 290000 5432	亨通光 电	2021 年 12 月 29 日	1,166,40 0.00	80,000	14	0.02	771.12	1,209, 600.00	110.16
兴业证券股份 有限公司	202112 290000 5434	华海药 业	2021 年 12 月 29 日	1,402,10 0.00	70,000	14	0.02	926.94	1,516, 200.00	132.42
兴业证券股份 有限公司	202112 290000 5442	豫园股 份	2021 年 12 月 29 日	322,740. 00	32,600	14	0.02	213.37	335,78 0.00	30.48
兴业证券股份 有限公司	202112 290000 5446	豫园股 份	2021 年 12 月 29 日	474,210. 00	47,900	14	0.02	313.51	493,37 0.00	44.78
兴业证券股	202112	东软集	2021 年	2,454,27	188,500	14	0.02	1,622.	2,556,	231.80

份有限公司	290000 5448	团	12月 29日	0.00				55	060.00	
兴业证券股 份有限公司	202112 290000 5454	锦江酒 店	2021年 12月 29日	2,232,50 7.00	38,300	14	0.02	1,475. 94	2,244, 380.00	210.84
兴业证券股 份有限公司	202112 290000 5468	三六零	2021年 12月 29日	2,991,14 1.00	239,100	14	0.02	1,977. 48	3,041, 352.00	282.50
兴业证券股 份有限公司	202112 290000 5496	贵阳银 行	2021年 12月 29日	1,249,97 4.00	192,600	14	0.02	826.37	1,253, 826.00	118.06
兴业证券股 份有限公司	202112 290000 8136	三七互 娱	2021年 12月 29日	247,200. 00	10,000	14	0.02	163.43	270,20 0.00	23.34
兴业证券股 份有限公司	202112 290000 8138	东软集 团	2021年 12月 29日	1,041,60 0.00	80,000	14	0.02	688.61	1,084, 800.00	98.38
兴业证券股 份有限公司	202112 300000 5080	安迪苏	2021年 12月 30日	2,651,58 6.00	217,700	14	0.02	1,752. 99	2,682, 064.00	125.21
兴业证券股 份有限公司	202112 300000 5082	金风科 技	2021年 12月 30日	921,492. 00	57,200	14	0.02	609.21	942,08 4.00	43.51
兴业证券股 份有限公司	202112 310000 4778	康弘药 业	2021年 12月 31日	2,197,80 0.00	108,000	14	0.02	1,452. 99	2,197, 800.00	-
兴业证券股 份有限公司	202112 310000 5188	金证股 份	2021年 12月 31日	716,000. 00	50,000	14	0.02	473.36	716,00 0.00	-
兴业证券股 份有限公司	202112 310000 9646	中国铁 建	2021年 12月 31日	780,000. 00	100,000	14	0.02	515.67	780,00 0.00	-
兴业证券股 份有限公司	202112 310000 9694	中国人 寿	2021年 12月 31日	1,504,50 0.00	50,000	14	0.02	994.64	1,504, 500.00	-
兴业证券股 份有限公司	202112 310001 2022	平安银 行	2021年 12月 31日	5,768,00 0.00	350,000	14	0.02	3,813. 29	5,768, 000.00	-
兴业证券股 份有限公司	202112 310001 2502	巨人网 络	2021年 12月 31日	400,995. 00	33,500	14	0.02	265.10	400,99 5.00	-
兴业证券股 份有限公司	202112 310001 3454	中天科 技	2021年 12月 31日	169,600. 00	10,000	14	0.02	112.12	169,60 0.00	-

兴业证券股份有限公司	2021123100014634	美的集团	2021年12月31日	1,055,483.00	14,300	14	0.02	697.79	1,055,483.00	-
兴业证券股份有限公司	2021123100014678	徐工机械	2021年12月31日	1,198,000.00	200,000	14	0.02	792.01	1,198,000.00	-
兴业证券股份有限公司	2021123100014888	双汇发展	2021年12月31日	2,334,700.00	74,000	14	0.02	1,543.50	2,334,700.00	-

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

注：本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

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

注：本报告期末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	509,792.95	724,997.08

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张）	总金额
兴业证券	113052	兴业转债	优先配售	67,100	6,710,000.00

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

为了更好地实现基金合同所规定的投资目标，紧密跟踪标的指数，提高基金运作效率，本基金根据基金合同约定的投资策略，按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，经基金托管人审核同意，在报告期内投资于托管行发行的股票招商银行。于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有招商银行的 A 股的估值总额为人民币 56,503,600.00 元。

### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内无利润分配的情况。

### 7.4.12 期末(2021 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001234	泰慕士	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 11 日	新股流通受限	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
002555	三七互娱	2021 年 10 月 20 日	2022 年 4 月 20 日	大宗交易购入流通受限	21.10	25.37	250,000	5,275,000.00	6,342,500.00	-
002728	特一药业	2021 年 11 月 29 日	2022 年 6 月 1 日	非公开发行流通受限	10.92	15.86	1,831,501	19,999,990.92	29,047,605.86	-
002792	通宇通讯	2021 年 12 月 7 日	2022 年 6 月 10 日	非公开发行流通受限	12.64	15.33	1,036,392	13,099,994.88	15,887,889.36	-
300293	蓝英装备	2021 年 11 月 16 日	2022 年 5 月 17 日	非公开发行流通受限	11.61	12.15	430,664	5,000,009.04	5,232,567.60	-
300383	光环新网	2021 年 12 月 29 日	2022 年 7 月 1 日	非公开发行流通受限	11.79	14.06	1,526,717	17,999,993.43	21,465,641.02	-
300506	名家汇	2021 年 12 月 28 日	2022 年 6 月 30 日	非公开发行流通受限	6.30	6.85	2,380,952	14,999,997.60	16,309,521.20	-

300793	佳禾智能	2021年12月8日	2022年6月10日	非公开发行流通受限	14.16	19.38	564,971	7,999,989.36	10,949,137.98	-
301025	读客文化	2021年7月6日	2022年01月24日	新股流通受限	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301026	浩通科技	2021年7月8日	2022年1月17日	新股流通受限	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-
301027	华蓝集团	2021年7月8日	2022年01月19日	新股流通受限	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301028	东亚机械	2021年7月12日	2022年1月20日	新股流通受限	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
301057	汇隆新材	2021年8月31日	2022年3月9日	新股流通受限	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301059	金三江	2021年9月3日	2022年3月14日	新股流通受限	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301062	上海艾录	2021年9月7日	2022年3月14日	新股流通受限	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301063	海锅股份	2021年9月9日	2022年3月24日	新股流通受限	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
301072	中捷精工	2021年9月22日	2022年3月29日	新股流通受限	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301078	孩子王	2021年9月30日	2022年4月14日	新股流通受限	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-

		日	日							
301079	邵阳 液压	2021 年 10 月 11 日	2022 年 4 月 19 日	新股 流通 受限	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-
301081	严牌 股份	2021 年 10 月 13 日	2022 年 4 月 20 日	新股 流通 受限	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-
301083	百胜 智能	2021 年 10 月 13 日	2022 年 4 月 21 日	新股 流通 受限	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-
301089	拓新 药业	2021 年 10 月 20 日	2022 年 4 月 27 日	新股 流通 受限	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301092	争光 股份	2021 年 10 月 21 日	2022 年 5 月 5 日	新股 流通 受限	36.31	35.52	323	11,728.13	11,472.96	-
301093	华兰 股份	2021 年 10 月 21 日	2022 年 5 月 5 日	新股 流通 受限	58.08	49.85	409	23,754.72	20,388.65	-
301096	百诚 医药	2021 年 12 月 13 日	2022 年 6 月 20 日	新股 流通 受限	79.60	78.53	272	21,651.20	21,360.16	-
301098	金埔 园林	2021 年 11 月 4 日	2022 年 5 月 12 日	新股 流通 受限	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	-
301138	华研 精机	2021 年 12 月 8 日	2022 年 6 月 15 日	新股 流通 受限	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10	-
301149	隆华 新材	2021 年 11 月 3 日	2022 年 5 月 10 日	新股 流通 受限	10.07	16.76	1,214	12,224.98	20,346.64	-
301155	海力 风电	2021 年 11 月 17	2022 年 5 月 24	新股 流通 受限	60.66	96.75	1,054	63,935.64	101,974.50	-

		日	日							
301179	泽宇智能	2021年12月1日	2022年6月8日	新股流通受限	43.99	50.77	295	12,977.05	14,977.15	-
301182	凯旺科技	2021年12月16日	2022年6月23日	新股流通受限	27.12	30.58	294	7,973.28	8,990.52	-
301190	善水科技	2021年12月17日	2022年6月24日	新股流通受限	27.85	27.46	575	16,013.75	15,789.50	-
301221	光庭信息	2021年12月15日	2022年6月22日	新股流通受限	69.89	88.72	280	19,569.20	24,841.60	-
688038	中科通达	2021年7月5日	2022年1月13日	新股流通受限	8.60	18.72	2,132	18,335.20	39,911.04	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113052	兴业转债	2021年12月28日	2022年1月14日	新债未上市	100.00	100.00	67,100	6,710,000.00	6,710,000.00	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 33,712,589.43 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
190407	19 农发 07	2022 年 1 月 17 日	100.39	129,000	12,950,310.00

190407	19 农发 07	2022 年 1 月 4 日	100.39	100,000	10,039,000.00
190407	19 农发 07	2022 年 1 月 6 日	100.39	120,000	12,046,800.00
合计				349,000	35,036,110.00

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 36,400,000.00 元,于 2022 年 1 月 4 日、2022 年 1 月 6 日及 2022 年 1 月 7 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位:人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值 单价	数量(单 位:股)	期末估值 总额
1	000001	平安银行	2022 年 1 月 14 日	16.48	350,000	5,768,000.00
2	000157	中联重科	2022 年 1 月 10 日	7.17	171,500	1,229,655.00
3	000333	美的集团	2022 年 1 月 14 日	73.81	14,300	1,055,483.00
4	000402	金融街	2022 年 1 月 6 日	5.66	56,800	321,488.00
5	000425	徐工机械	2022 年 1 月 7 日-2022 年 1 月 14 日	5.99	470,000	2,815,300.00
6	000568	泸州老窖	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 5 日	253.87	21,600	5,483,592.00
7	000858	五粮液	2022 年 1 月 7 日	222.66	10,000	2,226,600.00
8	000895	双汇发展	2022 年 1 月 12 日-2022 年 1 月 14 日	31.55	143,000	4,511,650.00
9	000999	华润三九	2022 年 1 月 10 日	34.24	64,800	2,218,752.00
10	001979	招商蛇口	2022 年 1 月 5 日	13.34	25,200	336,168.00
11	002182	云海金属	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 10 日	22.94	648,000	14,865,120.00
12	002202	金风科技	2022 年 1 月 10 日-2022 年 1 月 13 日	16.47	225,000	3,705,750.00
13	002422	科伦药	2022 年 1 月 4 日-2022	18.93	218,400	4,134,312.00

		业	年 1 月 7 日			.00
14	002555	三七互娱	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	27.02	165,000	4,458,300.00
15	002558	巨人网络	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 14 日	11.97	118,500	1,418,445.00
16	002572	索菲亚	2022 年 1 月 7 日	22.20	112,000	2,486,400.00
17	002739	万达电影	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 12 日	15.48	425,100	6,580,548.00
18	002773	康弘药业	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 14 日	20.35	530,200	10,789,570.00
19	300070	碧水源	2022 年 1 月 5 日	7.19	282,500	2,031,175.00
20	300123	亚光科技	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 7 日	9.07	492,800	4,469,696.00
21	300413	芒果超媒	2022 年 1 月 5 日	57.22	18,900	1,081,458.00
22	600009	上海机场	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 7 日	46.69	53,600	2,502,584.00
23	600062	华润双鹤	2022 年 1 月 7 日	13.37	76,500	1,022,805.00
24	600195	中牧股份	2022 年 1 月 10 日-2022 年 1 月 10 日	13.07	1,503,000	19,644,210.00
25	600297	广汇汽车	2022 年 1 月 7 日	2.67	225,000	600,750.00
26	600299	安迪苏	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 13 日	12.32	264,900	3,263,568.00
27	600325	华发股份	2022 年 1 月 12 日	6.02	120,000	722,400.00
28	600352	浙江龙盛	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 10 日	12.63	137,100	1,731,573.00
29	600383	金地集团	2022 年 1 月 12 日	12.97	55,900	725,023.00
30	600395	盘江股份	2022 年 1 月 10 日-2022 年 1 月 10 日	7.27	265,000	1,926,550.00
31	600446	金证股份	2022 年 1 月 14 日	14.32	50,000	716,000.00
32	600487	亨通光电	2022 年 1 月 12 日-2022 年 1 月 12 日	15.12	205,100	3,101,112.00
33	600521	华海药业	2022 年 1 月 12 日	21.66	70,000	1,516,200.00
34	600522	中天科技	2022 年 1 月 7 日-2022 年 1 月 14 日	16.96	90,000	1,526,400.00
35	600655	豫园股	2022 年 1 月 12 日-2022	10.30	80,500	829,150.00

		份	年 1 月 12 日			0
36	600674	川投能源	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 10 日	12.50	207,000	2,587,500.00
37	600718	东软集团	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	13.56	607,600	8,239,056.00
38	600729	重庆百货	2022 年 1 月 6 日	26.02	45,000	1,170,900.00
39	600739	辽宁成大	2022 年 1 月 10 日	19.52	22,500	439,200.00
40	600754	锦江酒店	2022 年 1 月 12 日	58.60	38,300	2,244,380.00
41	600985	淮北矿业	2022 年 1 月 7 日-2022 年 1 月 10 日	11.18	148,000	1,654,640.00
42	601006	大秦铁路	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 7 日	6.40	940,700	6,020,480.00
43	601088	中国神华	2022 年 1 月 6 日	22.52	27,800	626,056.00
44	601186	中国铁建	2022 年 1 月 14 日	7.80	100,000	780,000.00
45	601225	陕西煤业	2022 年 1 月 4 日	12.20	150,400	1,834,880.00
46	601360	三六零	2022 年 1 月 12 日	12.72	239,100	3,041,352.00
47	601390	中国中铁	2022 年 1 月 10 日	5.79	150,000	868,500.00
48	601607	上海医药	2022 年 1 月 5 日	19.87	20,000	397,400.00
49	601628	中国人寿	2022 年 1 月 14 日	30.09	50,000	1,504,500.00
50	601888	中国中免	2022 年 1 月 10 日	219.41	10,000	2,194,100.00
51	601997	贵阳银行	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	6.51	243,600	1,585,836.00
52	603799	华友钴业	2022 年 1 月 12 日	110.31	36,000	3,971,160.00
合计	-	-	-	-	10,796,200	160,975,727.00

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务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以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、风险管理部和合规管理部以及审计部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，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的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金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；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金于本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金于本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

##### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日
AAA	17,745,045.40
AAA 以下	3,890,503.10
未评级	-
合计	21,635,548.50

注：此处列示的信用证券不包括国债、央行票据、政策性金融债券等非信用债券投资。

##### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金于本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。

本基金所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易。因此，除在附注 7.4.12 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。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时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。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金为开放式基金，投资者可在合同规定的交易日进行基金申购与赎回业务，本基金管理人针对基金特定的运作方式，建立了相应的流动性风险监控与预警机制。本基金管理人每日预测基金的流动性需求，通过独立的风险管理部门设置流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，并按照基金类型建立并定期开展专项的流动性压力测试工作，对流动性风险进行预警。本基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款及强制赎回费条款，同时控制每日确认的净赎回申请不超过本基金投资组合 7 个工作日可变现资产的可变现价值，减少赎回业务对本基金的流动性冲击，从而控制流动性风险。此外，本基金通过预留一定的现金头寸，并且可在需要时通过卖出回购金融资产方式借入短期资金，以缓解流动性风险。

本基金所持的证券在证券交易所上市或可于银行间同业市场交易。截止本报告期末，单一投资者持有基金份额比例未超过基金总份额 50%。本报告期末，除完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合以外，本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的 30%，本基金投资未违背法律法规对流通受限资产的相关比例要求。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动

而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、权证存出保证金及债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年12 月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	509,792.95	-	-	-	-	-	509,792.95
结算备付金	3,114,250.36	-	-	-	-	-	3,114,250.36
存出保证金	362,019.26	-	-	-	-	-	362,019.26
交易性金融资产	12,002,400.00	2,002,400.00	82,282,400.00	3,509,400.00	18,126,148.50	1,832,300,496.37	1,950,223,244.87
应收利息	-	-	-	-	-	1,381,863.57	1,381,863.57
应收申购款	2,149.74	-	-	-	-	25,328.27	27,478.01
应收证券清算款	-	-	-	-	-	37,024,528.99	37,024,528.99
资产总计	15,990,612.31	2,002,400.00	82,282,400.00	3,509,400.00	18,126,148.50	1,870,732,217.20	1,992,643,178.01
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	13,559,673.81	13,559,673.81
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,850,381.85	1,850,381.85
应付托管费	-	-	-	-	-	252,324.85	252,324.85
应付证券清算款	-	-	-	-	-	5.17	5.17
卖出回购金融资产款	70,112,589.43	-	-	-	-	-	70,112,589.43
应付销售服务费	-	-	-	-	-	69,095.39	69,095.39
应付交易费用	-	-	-	-	-	337,477.36	337,477.36
应付利息	-	-	-	-	-	39,481.87	39,481.87

应交税费	-	-	-	-	-	8,407.78	8,407.78
其他负债	-	-	-	-	-	-278,687.66	278,687.66
负债总计	70,112,589.43	-	-	-	-	16,395,535.74	86,508,125.17
利率敏感度缺口	54,121,977.12	2,002,400.00	82,282,400.00	3,509,400.00	18,126,148.50	1,854,336.68	1,906,135.052.84

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他影响债券公允价值的变量保持不变，仅利率发生变动；	
	假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化(即平移收益率曲线)。	
	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(2021年12月31日)
分析	利率+1%	-495,734.53
	利率-1%	501,742.91

注：上表反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日			合计
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	24,139,165.79	-	24,139,165.79
资产合计	-	24,139,165.79	-	24,139,165.79

以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	24,139,165.79	-	24,139,165.79

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除市场汇率以外的其他市场变量保持不变		
	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（2021年12月31日）	
分析	所有外币相对人民币贬值 5%	-1,206,958.29	
	所有外币相对人民币升值 5%	1,206,958.29	

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金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股票和债券，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。

本基金投资组合中股票投资比例范围为本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 80%，投资于中证 800 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计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。本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 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	1,832,300,496.37	96.13
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	117,922,748.50	6.19
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	1,950,223,244.87	102.31

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假设单个证券的公允价值和市场组合的公允价值依照资本-资产定价模型 (CAPM) 描述的规律进行变动	
	使用本基金业绩比较基准所对应的市场组合进行分析	
	在业绩基准变化 10% 时, 对单个证券相应的公允价值变化进行加总得到基金净值的变化	
	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 (2021 年 12 月 31 日)
分析	业绩基准+10%	186,082,872.58
	业绩基准-10%	-186,082,872.58

注: 本基金管理人运用 CAPM 模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析, 反映了在其他变量不变的假设下, 证券投资价格发生合理、可能的变动时, 将对基金净值产生的影响。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款和其他金融负债等, 其账面价值与公允价值相若。

##### (b) 以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日, 本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为

人民币 1,730,163,928.37 元，第二层次的余额为人民币 213,349,316.50 元，第三层次的余额为人民币 6,710,000.00 元。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

本基金交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、资产支持证券和私募债除外)本期采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值，相关固定收益品种的公允价值层次归入第二层次。

(iii) 第三层次公允价值计量的金融工具

无。

(2) 根据《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》(财会[2017]7 号)、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》(财会[2017]8 号)、《企业会计准则第 24 号—套期会计》(财会[2017]9 号)、《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(财会[2017]14 号)(以下简称“新金融工具准则”)和《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》(财会[2020]22 号)等新金融工具相关会计准则及规定，本基金自 2022 年 1 月 1 日起开始执行新金融工具准则。

经评估，新金融工具准则预期不会对本基金财务报表产生重大影响。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,832,300,496.37	91.95
	其中：股票	1,832,300,496.37	91.95
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	117,922,748.50	5.92
	其中：债券	117,922,748.50	5.92
	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	3,624,043.31	0.18
8	其他各项资产	38,795,889.83	1.95
9	合计	1,992,643,178.01	100.00

注：本基金本报告期末参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 160,975,727.00 元，占基金资产净值比例 8.45%。本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 24,139,165.79 元，占净值比例 1.27%。

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末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	-	-
B	采矿业	42,319,975.81	2.22
C	制造业	693,315,960.87	36.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,550,412.20	1.66
E	建筑业	33,995,000.00	1.78
F	批发和零售业	21,113,671.00	1.11
G	交通运输、仓储和邮政业	38,676,428.00	2.03
H	住宿和餐饮业	4,928,260.00	0.26
I	信息传输、软件和信息技术服务业	110,879,995.70	5.82
J	金融业	373,018,498.92	19.57
K	房地产业	39,867,360.96	2.09
L	租赁和商务服务业	60,403,573.00	3.17
M	科学研究和技术服务业	6,805,695.62	0.36
N	水利、环境和公共设施管理业	12,874,012.12	0.68
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	45,731,658.65	2.40
R	文化、体育和娱乐业	25,267,742.24	1.33
S	综合	-	-
	合计	1,540,748,245.09	80.83

### 8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	5,816,000.00	0.31
C	制造业	194,263,409.64	10.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,250,000.00	0.33
E	建筑业	16,321,041.19	0.86
F	批发和零售业	9,177.84	0.00
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	44,718,920.12	2.35
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	26,122.06	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	8,414.64	0.00
S	综合	-	-
	合计	267,413,085.49	14.03

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	-	-
非日常生活消费品	-	-
日常消费品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	-	-
信息技术	9,274,674.53	0.49

通信服务	14,864,491.26	0.78
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	24,139,165.79	1.27

注：以上分类采用全球行业分类标准(Global Industry Classification Standard, GICS)。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 8.3.1 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	58,500	119,925,000.00	6.29
2	600741	华域汽车	3,636,867	102,923,336.10	5.40
3	601601	中国太保	3,748,507	101,659,509.84	5.33
4	601888	中国中免	275,300	60,403,573.00	3.17
5	601318	中国平安	1,149,000	57,921,090.00	3.04
6	600036	招商银行	1,160,000	56,503,600.00	2.96
7	000895	双汇发展	1,550,800	48,927,740.00	2.57
8	600718	东软集团	3,471,978	47,080,021.68	2.47
9	002044	美年健康	5,825,689	45,731,658.65	2.40
10	600195	中牧股份	3,380,880	44,188,101.60	2.32
11	600161	天坛生物	1,518,700	43,981,552.00	2.31
12	000001	平安银行	2,470,600	40,715,488.00	2.14
13	601166	兴业银行	2,118,800	40,341,952.00	2.12
14	600584	长电科技	1,188,584	36,869,875.68	1.93
15	000858	五粮液	160,700	35,781,462.00	1.88
16	600900	长江电力	1,389,886	31,550,412.20	1.66
17	000100	TCL 科技	5,003,000	30,868,510.00	1.62
18	601668	中国建筑	5,500,000	27,500,000.00	1.44
19	601009	南京银行	2,999,968	26,879,713.28	1.41
20	000651	格力电器	699,300	25,895,079.00	1.36
21	002415	海康威视	488,000	25,532,160.00	1.34
22	600352	浙江龙盛	1,905,700	24,068,991.00	1.26
23	300383	光环新网	1,526,717	21,465,641.02	1.13
24	600028	中国石化	4,999,947	21,149,775.81	1.11
25	002739	万达电影	1,231,088	19,057,242.24	1.00
26	001979	招商蛇口	1,399,300	18,666,662.00	0.98
27	002555	三七互娱	703,000	18,582,560.00	0.97
28	000568	泸州老窖	66,800	16,958,516.00	0.89
29	601006	大秦铁路	2,645,790	16,933,056.00	0.89
30	000069	华侨城 A	2,398,664	16,886,594.56	0.89
31	000157	中联重科	2,100,000	15,057,000.00	0.79

32	002422	科伦药业	708,889	13,419,268.77	0.70
33	601398	工商银行	2,800,000	12,964,000.00	0.68
34	600009	上海机场	258,800	12,083,372.00	0.63
35	002050	三花智控	456,300	11,544,390.00	0.61
36	600153	建发股份	1,200,300	10,886,721.00	0.57
37	600690	海尔智家	358,300	10,709,587.00	0.56
38	600299	安迪苏	862,900	10,630,928.00	0.56
39	300070	碧水源	1,461,348	10,507,092.12	0.55
40	601816	京沪高铁	2,000,000	9,660,000.00	0.51
41	601997	贵阳银行	1,399,121	9,108,277.71	0.48
42	603799	华友钴业	80,000	8,824,800.00	0.46
43	002202	金风科技	500,000	8,235,000.00	0.43
44	002624	完美世界	385,100	7,821,381.00	0.41
45	600000	浦发银行	888,853	7,581,916.09	0.40
46	600487	亨通光电	475,475	7,189,182.00	0.38
47	600019	宝钢股份	1,000,000	7,160,000.00	0.38
48	601360	三六零	558,800	7,107,936.00	0.37
49	000333	美的集团	96,100	7,093,141.00	0.37
50	000425	徐工机械	1,180,000	7,068,200.00	0.37
51	601658	邮储银行	1,330,000	6,783,000.00	0.36
52	688099	晶晨股份	52,000	6,770,400.00	0.36
53	002572	索菲亚	300,000	6,660,000.00	0.35
54	601088	中国神华	290,000	6,530,800.00	0.34
55	601225	陕西煤业	500,000	6,100,000.00	0.32
56	601628	中国人寿	200,000	6,018,000.00	0.32
57	603259	药明康德	49,989	5,927,695.62	0.31
58	600522	中天科技	308,807	5,237,366.72	0.27
59	000999	华润三九	144,100	4,933,984.00	0.26
60	600754	锦江酒店	84,100	4,928,260.00	0.26
61	601899	紫金矿业	500,000	4,850,000.00	0.25
62	600985	淮北矿业	330,000	3,689,400.00	0.19
63	601336	新华保险	92,900	3,611,952.00	0.19
64	600655	豫园股份	339,300	3,494,790.00	0.18
65	600521	华海药业	156,500	3,389,790.00	0.18
66	601098	中南传媒	350,000	3,349,500.00	0.18
67	601939	建设银行	500,000	2,930,000.00	0.15
68	601390	中国中铁	500,000	2,895,000.00	0.15
69	300413	芒果超媒	50,000	2,861,000.00	0.15
70	600729	重庆百货	100,000	2,602,000.00	0.14
71	601200	上海环境	188,000	2,366,920.00	0.12
72	601186	中国铁建	300,000	2,340,000.00	0.12
73	600062	华润双鹤	170,000	2,272,900.00	0.12

74	600438	通威股份	50,000	2,248,000.00	0.12
75	600446	金证股份	143,300	2,052,056.00	0.11
76	600325	华发股份	300,000	1,806,000.00	0.09
77	600383	金地集团	138,200	1,792,454.00	0.09
78	002867	周大生	100,000	1,778,000.00	0.09
79	600297	广汇汽车	500,000	1,335,000.00	0.07
80	600170	上海建工	350,000	1,260,000.00	0.07
81	002508	老板电器	30,000	1,080,600.00	0.06
82	600276	恒瑞医药	20,000	1,014,200.00	0.05
83	601607	上海医药	50,000	993,500.00	0.05
84	600739	辽宁成大	50,000	976,000.00	0.05
85	300676	华大基因	10,000	878,000.00	0.05
86	600859	王府井	30,580	825,660.00	0.04
87	000402	金融街	126,440	715,650.40	0.04
88	002252	上海莱士	100,000	682,000.00	0.04
89	600585	海螺水泥	10,000	403,000.00	0.02
90	002705	新宝股份	16,000	395,200.00	0.02
91	600372	中航电子	10,000	223,900.00	0.01
92	600597	光明乳业	10,000	145,200.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002773	康弘药业	2,258,511	45,960,698.85	2.41
2	002182	云海金属	1,950,000	44,733,000.00	2.35
3	300292	吴通控股	9,687,767	38,654,190.33	2.03
4	300123	亚光科技	3,672,500	33,309,575.00	1.75
5	002728	特一药业	1,831,501	29,047,605.86	1.52
6	300506	名家汇	2,380,952	16,309,521.20	0.86
7	002792	通宇通讯	1,036,392	15,887,889.36	0.83
8	00700	腾讯控股	39,800	14,864,491.26	0.78
9	300793	佳禾智能	564,971	10,949,137.98	0.57
10	01810	小米集团-W	600,200	9,274,674.53	0.49
11	300439	美康生物	338,583	7,215,203.73	0.38
12	600674	川投能源	500,000	6,250,000.00	0.33
13	002558	巨人网络	500,000	5,985,000.00	0.31
14	600395	盘江股份	800,000	5,816,000.00	0.31
15	300293	蓝英装备	430,664	5,232,567.60	0.27
16	000423	东阿阿胶	18,800	916,500.00	0.05
17	600997	开滦股份	100,000	712,000.00	0.04
18	301155	海力风电	1,054	101,974.50	0.01
19	688038	中科通达	2,132	39,911.04	0.00

20	301221	光庭信息	280	24,841.60	0.00
21	301096	百诚医药	272	21,360.16	0.00
22	301093	华兰股份	409	20,388.65	0.00
23	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.00
24	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
25	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
26	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
27	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
28	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
29	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
30	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
31	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
32	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
33	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
34	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
35	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
36	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
37	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
38	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
39	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
40	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
41	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
42	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
43	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
44	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
45	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
46	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	601601	中国太保	144,516,969.87	7.58
2	600519	贵州茅台	133,272,410.01	6.99
3	601318	中国平安	130,284,479.00	6.84
4	601166	兴业银行	121,298,545.60	6.36
5	600741	华域汽车	107,231,309.41	5.63
6	000895	双汇发展	84,244,755.76	4.42
7	601888	中国中免	83,730,749.00	4.39
8	002773	康弘药业	78,020,726.57	4.09
9	300123	亚光科技	68,068,800.00	3.57
10	600161	天坛生物	66,587,362.00	3.49

11	002044	美年健康	61,873,157.94	3.25
12	000001	平安银行	60,902,214.00	3.20
13	600036	招商银行	55,560,986.00	2.91
14	600584	长电科技	49,999,987.20	2.62
15	002555	三七互娱	46,265,725.95	2.43
16	002739	万达电影	41,728,924.24	2.19
17	000858	五粮液	41,214,944.74	2.16
18	600195	中牧股份	39,677,856.96	2.08
19	000651	格力电器	38,311,688.60	2.01
20	000100	TCL 科技	38,005,216.00	1.99

注：“买入金额”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。

#### 8.4.2 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	601166	兴业银行	85,390,520.53	4.48
2	601318	中国平安	56,843,185.60	2.98
3	300123	亚光科技	42,095,332.98	2.21
4	002555	三七互娱	32,490,872.84	1.70
5	601601	中国太保	30,073,241.00	1.58
6	600446	金证股份	28,161,061.47	1.48
7	600519	贵州茅台	26,484,209.00	1.39
8	600161	天坛生物	24,624,241.61	1.29
9	002786	银宝山新	23,710,453.14	1.24
10	601006	大秦铁路	22,307,822.00	1.17
11	601169	北京银行	22,266,745.00	1.17
12	600584	长电科技	18,204,634.00	0.96
13	002739	万达电影	17,280,842.50	0.91
14	601997	贵阳银行	16,948,488.72	0.89
15	300070	碧水源	14,007,200.50	0.73
16	002558	巨人网络	13,320,823.80	0.70
17	000001	平安银行	11,679,650.00	0.61
18	600522	中天科技	11,050,133.88	0.58
19	000895	双汇发展	11,047,314.00	0.58
20	601398	工商银行	10,176,000.00	0.53

注：“卖出金额”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。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,508,388,509.66
卖出股票收入（成交）总额	711,969,531.88

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考

考虑相关交易费用。

## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	33,031,300.00	1.73
2	央行票据	-	-
3	金融债券	63,255,900.00	3.32
	其中：政策性金融债	63,255,900.00	3.32
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	21,635,548.50	1.14
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	117,922,748.50	6.19

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	190407	19 农发 07	600,000	60,234,000.00	3.16
2	019649	21 国债 01	120,000	12,002,400.00	0.63
3	019664	21 国债 16	100,000	10,004,000.00	0.52
4	113050	南银转债	77,690	9,192,280.80	0.48
5	019641	20 国债 11	90,000	9,022,500.00	0.47

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：按照基金合同的约定，本基金不投资贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：按照基金合同的约定，本基金不投资权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指

期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以萃取相应债券组合的超额收益。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司具有在报告编制日前一年内受到监管部门处罚的情形；本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

前十名证券发行主体中，未见其他发行主体有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	362,019.26
2	应收证券清算款	37,024,528.99
3	应收股利	-
4	应收利息	1,381,863.57
5	应收申购款	27,478.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	38,795,889.83

## 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113050	南银转债	9,192,280.80	0.48
2	110045	海澜转债	3,509,400.00	0.18
3	110079	杭银转债	1,188,111.60	0.06
4	123107	温氏转债	654,653.00	0.03
5	113051	节能转债	99,291.50	0.01

## 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

## 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	600195	中牧股份	19,644,210.00	1.03	转融通流通受限
2	600718	东软集团	8,239,056.00	0.43	转融通流通受限
3	000895	双汇发展	4,511,650.00	0.24	转融通流通受限
4	601888	中国中免	2,194,100.00	0.12	转融通流通受限

## 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	002728	特一药业	29,047,605.86	1.52	非公开发行流通受限
2	002182	云海金属	14,865,120.00	0.78	转融通流通受限
3	002773	康弘药业	10,789,570.00	0.57	转融通流通受限
4	300123	亚光科技	4,469,696.00	0.23	转融通流通受限

## 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

## 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
兴全中证 800 六个月持有指数 A	45,943	36,360.10	120,214,302.71	7.20	1,550,277,648.21	92.80
兴全中证 800 六个月持有指数 C	11,258	16,627.52	820,129.50	0.44	186,372,501.94	99.56
合计	57,201	32,476.44	121,034,432.21	6.52	1,736,650,150.15	93.48

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	兴全中证 800 六个月持有指数 A	2,068,858.20	0.1238
	兴全中证 800 六个月持有指数 C	8,010.70	0.0043
	合计	2,076,868.90	0.1118

注：“占基金总份额比例”对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用合计份额。

分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总数）。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	兴全中证 800 六个月持有指数 A	0
	兴全中证 800 六个月持有指数 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	兴全中证 800 六个月持有指数 A	>100
	兴全中证 800 六个月持有指数 C	0
	合计	>100

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	兴全中证 800 六个月持有指数 A	兴全中证 800 六个月持有指数 C
基金合同生效日（2021 年 2 月 9 日）基金份额总额	2,502,409,679.69	374,745,419.98
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	99,864,726.95	5,097,334.93
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	931,782,455.72	192,650,123.47
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,670,491,950.92	187,192,631.44

注：总申购份额含红利再投资、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

## 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。

(2) 自 2021 年 10 月 27 日起，刘波先生不再担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

## 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日（2021 年 2 月 9 日）起聘请德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。本年度应支付给所聘任的会计师事务所 6 万元人民币。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门的稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东吴证券	2	893,271,282.70	30.91%	563,833.28	26.66%	-
兴业证券	3	874,460,701.29	30.26%	815,384.52	38.55%	-
广发证券	4	387,190,861.23	13.40%	248,342.92	11.74%	-
中信证券	3	283,481,857.21	9.81%	179,347.28	8.48%	-
安信证券	2	263,383,168.06	9.11%	192,613.35	9.11%	-
中泰证券	4	162,939,871.17	5.64%	103,786.32	4.91%	-

东方财富	2	19,408,868.60	0.67%	8,371.26	0.40%	-
国盛证券	1	5,492,418.72	0.19%	3,467.27	0.16%	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
摩根大通 证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证 券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信建投 证券	3	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力、客户服务质量的基础上，选择基金专用交易席位。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易
------	------	--------	------

	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东吴证券	988,158.41	0.14%	8,088,800,000.00	25.39%	-	-
兴业证券	474,161,248.00	69.48%	21,221,244,000.00	66.61%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	55,137,861.20	8.08%	1,073,600,000.00	3.37%	-	-
安信证券	70,970,500.20	10.40%	1,102,500,000.00	3.46%	-	-
中泰证券	70,052,478.08	10.26%	-	-	-	-
东方财富	-	-	2,900,000.00	0.01%	-	-
国盛证券	1,139,143.80	0.17%	370,300,000.00	1.16%	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	10,004,550.00	1.47%	500,000.00	0.00%	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金基金合同	上海证券报、规定互联网站	2021-01-12
2	兴全中证 800 六个月持有期指数增	上海证券报、规定互联	2021-01-12

	强型证券投资基金托管协议	网网站	
3	兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金招募说明书	上海证券报、规定互联网网站	2021-01-12
4	兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金份额发售公告	上海证券报、规定互联网网站	2021-01-12
5	关于增加兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金销售机构的公告	上海证券报、规定互联网网站	2021-01-14
6	关于开展兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金网上直销认购费率优惠活动的公告	上海证券报、规定互联网网站	2021-01-22
7	关于增加兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金销售机构的公告	上海证券报、规定互联网网站	2021-01-28
8	兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	上海证券报、规定互联网网站	2021-02-10
9	关于调整网上直销招行直连借记卡基金转换优惠费率的公告	上海证券报、规定互联网网站	2021-03-19
10	关于旗下部分基金投资锦江酒店(600754)非公开发行股票的公告	上海证券报、规定互联网网站	2021-03-25
11	关于旗下部分基金投资金证股份(600446)非公开发行股票的公告	上海证券报、规定互联网网站	2021-03-31
12	关于旗下部分基金投资美康生物(300439)非公开发行股票的公告	上海证券报、规定互联网网站	2021-03-31
13	关于旗下部分基金修改基金合同的公告	上海证券报、规定互联网网站	2021-03-31
14	关于旗下部分基金投资银宝山新(002786)非公开发行股票的公告	上海证券报、规定互联网网站	2021-04-15
15	关于旗下部分基金投资天坛生物(600161)非公开发行股票的公告	上海证券报、规定互联网网站	2021-04-28
16	关于旗下部分基金投资古越龙山(600059)非公开发行股票的公告	上海证券报、规定互联网网站	2021-04-30
17	兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金开放日常申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	上海证券报、规定互联网网站	2021-04-30
18	关于旗下部分基金投资长电科技(600584)非公开发行股票的公告	上海证券报、规定互联网网站	2021-05-06
19	关于兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金参加部分销售机构申购、定投费率优惠活动的公告	上海证券报、规定互联网网站	2021-05-06
20	关于旗下部分基金投资惠伦晶体	上海证券报、规定互联网网站	2021-05-11

	(300460)非公开发行的公告	网网站	
21	关于增加中国建设银行为兴全兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金 C 份额销售机构的公告	上海证券报、规定互联网网站	2021-05-12
22	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报、规定互联网网站	2021-05-19
23	关于兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金增聘基金经理的公告	上海证券报、规定互联网网站	2021-05-24
24	兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金招募说明书、产品资料概要更新提示性公告	上海证券报、规定互联网网站	2021-05-25
25	关于旗下部分基金投资吴通控股(300292)非公开发行的公告	上海证券报、规定互联网网站	2021-05-26
26	关于旗下部分基金投资彩讯股份(300634)非公开发行的公告	上海证券报、规定互联网网站	2021-06-12
27	关于增加北京新浪仓石基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报、规定互联网网站	2021-06-16
28	关于增加泛华普益基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报、规定互联网网站	2021-06-17
29	关于调整网上直销基金转换、赎回转购、汇款交易优惠费率率的公告	上海证券报、规定互联网网站	2021-06-18
30	关于调整旗下基金在交通银行股份有限公司费率优惠活动的公告	上海证券报、规定互联网网站	2021-07-01
31	关于增加腾安基金销售为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报、规定互联网网站	2021-07-23
32	关于兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金投资关联方证券的公告	上海证券报、规定互联网网站	2021-07-28
33	关于兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金投资关联方证券的公告	上海证券报、规定互联网网站	2021-08-03
34	关于放开我司转换补差费折扣及开展网上直销平台基金转换补差费率优惠活动的公告	上海证券报、规定互联网网站	2021-08-04
35	兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金基金开放日常赎回、转换转出业务的公告	上海证券报、规定互联网网站	2021-08-05
36	关于兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金暂停接受大额申购(含定投)、大额转换转入申请的公告	上海证券报、规定互联网网站	2021-08-09

37	关于增加上海基煜基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报、规定互联 网网站	2021-10-15
38	关于旗下部分基金投资蓝英装备(300293)非公开发行的公告	上海证券报、规定互联 网网站	2021-11-18
39	关于增加北京汇成基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报、规定互联 网网站	2021-11-22
40	关于增加旗下部分基金销售机构并调整旗下基金在东方证券费率优惠活动的公告	上海证券报、规定互联 网网站	2021-11-24
41	关于旗下部分基金投资特一药业(002728)非公开发行的公告	上海证券报、规定互联 网网站	2021-12-01
42	关于旗下部分基金投资通宇通讯(002792)非公开发行的公告	上海证券报、规定互联 网网站	2021-12-09
43	关于旗下部分基金投资佳禾智能(300793)非公开发行的公告	上海证券报、规定互联 网网站	2021-12-10
44	关于调整网上直销基金转换、赎回转购、汇款交易优惠费率率的公告	上海证券报、规定互联 网网站	2021-12-10
45	关于旗下公开募集证券投资基金投资北交所股票的风险提示性公告	上海证券报、规定互联 网网站	2021-12-24
46	关于旗下部分基金投资名家汇(300506)非公开发行的公告	上海证券报、规定互联 网网站	2021-12-30
47	关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的公告(兴业转债)	上海证券报、规定互联 网网站	2021-12-30
48	关于旗下部分基金投资光环新网(300383)非公开发行的公告	上海证券报、规定互联 网网站	2021-12-31

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，故不涉及本项特有风险。							

注：1、“申购金额”包含份额申购、转换转入、分红再投资等导致投资者持有份额增加的情形。

2、“赎回份额”包含份额赎回、转换转出等导致投资者持有份额减少的情形。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、为最大限度降低本基金投资的跟踪误差，保护基金份额持有人的权益，本基金分别于 2021 年 7 月 26 日、2021 年 7 月 30 日对托管行招商银行股份有限公司在上海证券交易所发行的招商银行（600036）股票进行交易。上述交易方式为上海证券交易所场内竞价交易，事先已经托管行批准。基金管理人严格按照法律法规和本基金《基金合同》约定，履行相关审批程序，确保交易价格公允，不存在利益输送情况。基金管理人已按照法律法规要求及时进行了公告，详情请见基金管理人公告。

2、报告期内，本基金参加了兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）公开发行 A 股可转换公司债券的优先配售。由于兴业银行该次可转换公司债券发行的联席主承销商兴业证券股份有限公司为本基金管理人的股东，因此该次优先配售涉及关联交易。基金管理人严格按照法律法规和本基金基金合同及招募说明书等规定，履行规定审批程序并经基金托管人同意后参与该次优先配售。基金管理人已按照法律法规要求及时进行了公告，详情请见基金管理人公告。

3、本基金每份基金份额的最短持有期为 6 个月。对于每份基金份额，最短持有期指基金合同生效日（对认购份额而言，下同）或基金份额申购确认日（对申购份额而言，下同）起（即最短持有期起始日），至基金合同生效日或基金份额申购申请日起满 6 个月（6 个月指 30 天乘以 6 的自然天数，下同）后的下一工作日（即最短持有期到期日）。本基金每份基金份额在其最短持有期到期日（不含该日）前，基金份额持有人不能提出赎回申请；自其最短持有期到期日（含该日）起，基金份额持有人方可就该基金份额提出赎回申请。因此，对于基金份额持有人而言，存在投资本基金后 6 个月内无法赎回的风险。

4、本基金投资范围包括北交所上市的股票。基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于北交所上市股票或选择不将基金资产投资于北交所上市股票，基金资产并非必然投资北交所上市股票。基金管理人提醒投资者注意基金因投资北交所上市股票所带来的风险：北交所上市企业为创新型中小企业，普遍具有初创性、技术新、研发投入大、前景不确定、业绩波动大、风险高等特征，相对于沪深交易所上市企业，北交所上市企业的经营风险、盈利风险、技术风险、流动性风险、退市风险、股价大幅波动风险等整体上更为突出，且在北交所投资还存在市场制度、交易规则等差异可能带来的风险。基金投资北交所上市股票的特有风险包括但不限于流动性风险、转板风险、投资集中风险、退市

风险、股价大幅波动风险、投资战略配售股票风险、政策风险等。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准本基金募集的文件
- 2、《兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金基金合同》
- 3、《兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 6、中国证监会规定的其他文件

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

### 13.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站 (<http://www.xqfunds.com>) 查阅, 或在营业时间内至基金管理人、基金托管人办公场所免费查阅。

基金管理人客户服务中心电话: 400-678-0099, 021-38824536。

兴证全球基金管理有限公司

2022 年 3 月 31 日