

# 兴业中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

## 2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:兴业基金管理有限公司

基金托管人:中国银行股份有限公司

送出日期:2023 年 08 月 31 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年1月1日起至2023年6月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	60
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	60
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	60
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
7.12 投资组合报告附注	61
§8 基金份额持有人信息	62

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	62
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	62
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	63
8.4 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 .....	63
§9 开放式基金份额变动 .....	63
§10 重大事件揭示 .....	63
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	63
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	64
10.4 基金投资策略的改变 .....	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	64
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	64
10.8 其他重大事件 .....	65
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	66
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	67
§12 备查文件目录 .....	67
12.1 备查文件目录 .....	67
12.2 存放地点 .....	67
12.3 查阅方式 .....	67

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	兴业中证500ETF（证券简称：兴业500；扩位证券简称：兴业中证500ETF）
场内简称	兴业中证500ETF（证券简称：兴业500；扩位证券简称：兴业中证500ETF）
基金主代码	510570
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020年06月30日
基金管理人	兴业基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	60,560,583.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020年08月12日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，即完全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，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。主要投资策略包括资产配置策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略。
业绩比较基准	中证500指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险

	水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为交易型开放式指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
--	---

## 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		兴业基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张玲菡	许俊
	联系电话	021-22211888	010-66596688
	电子邮箱	zhaoyue@cib-fund.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		40000-95561	95566
传真		021-22211997	010-66594942
注册地址		福建省福州市鼓楼区五四路137号信和广场25楼	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		上海市浦东新区银城路167号13、14层	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		叶文煌	葛海蛟

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.cib-fund.com.cn
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区银城路167号13、14层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2023年01月01日-2023年06月30日)
本期已实现收益	-709,757.04
本期利润	-621,740.15
加权平均基金份额本期利润	-0.0265
本期加权平均净值利润率	-2.84%
本期基金份额净值增长率	3.47%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023年06月30日)
期末可供分配利润	-5,178,209.57
期末可供分配基金份额利润	-0.0855
期末基金资产净值	55,382,373.43
期末基金份额净值	0.9145
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023年06月30日)
基金份额累计净值增长率	-8.55%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

#### 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

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标	业绩比较 基准收益	业绩比较 基准收益	①-③	②-④

		准差②	率③	率标准差④		
过去一个月	0.36%	0.90%	-0.81%	0.93%	1.17%	-0.03%
过去三个月	-4.18%	0.79%	-5.38%	0.83%	1.20%	-0.04%
过去六个月	3.47%	0.76%	2.29%	0.79%	1.18%	-0.03%
过去一年	-5.47%	0.92%	-7.06%	0.96%	1.59%	-0.04%
过去三年	-8.51%	1.06%	2.29%	1.19%	-10.80%	-0.13%
自基金合同生效起至今	-8.55%	1.06%	4.10%	1.19%	-12.65%	-0.13%

注：本基金的业绩比较基准为标的指数，即中证500指数收益率。

### 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



## §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



兴业基金管理有限公司（以下简称“兴业基金”或“公司”）成立于2013年4月17日，是兴业银行控股的全国性基金管理公司。公司注册资本12亿元人民币，其中，兴业银行出资10.8亿元，持股比例90%，中海集团投资有限公司出资1.2亿元，持股比例10%。公司业务范围包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。目前，兴业基金已在北京、上海、深圳、福州等地设立分公司，并全资拥有基金子公司--兴业财富资产管理有限公司。

站在新时代的潮头浪尖，兴业基金坚守“受人之托、代客理财”的初心本源，坚守“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化，以“市场化、专业化、数字化”为转型方向，不断提升主动管理能力，打磨产品线，强化核心竞争力，提升权益投资能力，巩固扩大固收优势并增强特色业务，致力于为广大投资者创造长期良好收益，为中国实体经济健康发展贡献自身应有力量。截至2023年6月30日，兴业基金共管理87只公募基金。

#### 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		
那赛男	基金经理	2020-06-30	-	13年	中国籍，硕士学位，具有证券投资基金从业资格。2009年8月至2013年3月在博时基金管理有限公司ETF及量化投资部担任投资分析员；2013年4月至2015年6月在长盛基金管理有限公司权益投资部担任ETF专员；2015年7月至2016年11月在创金合信基金管理有限公司产品开发部从事相关研究工作；2016年11月至2018年4月在创金合信基金管理有限公司指数策略研究投资部历任研究员、基金经理助理，主要

					从事指数基金投资研究工作。2018年4月加入兴业基金管理有限公司，现任基金经理。
--	--	--	--	--	--

1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期，除首任基金经理外，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

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

#### 4.2 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守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无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 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的基金和投资组合。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

#### 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

上半年，A股市场核心指数方面，创业板综上涨5.68%，科创50、东方财富全A上涨4.71%、4.46%，深证综指、A股指数、上证指数涨超3%；上证50、创业板指跌超5%，科创创业50大跌6.14%。行业指数涨跌互现，通信、传媒领涨，涨幅高达50.66%、42.75%，计算机上涨27.57%，机械设备、家用电器、电子涨超10%；商贸零售领跌，跌幅达23.44%，房地产、美容护理、建筑材料跌幅超过10%。

本基金作为被动投资的指数基金，其投资目标是通过跟踪、复制中证500指数，为投资者获取市场长期的平均收益。报告期内我们严格按照基金合同规定，原则上采取完

全复制的方法进行投资管理，努力拟合标的指数，减小跟踪误差，将基金跟踪误差控制在较低范围之内。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴业中证500ETF（证券简称：兴业500；扩位证券简称：兴业中证500ETF）基金份额净值为0.9145元，本报告期内，基金份额净值增长率为3.47%，同期业绩比较基准收益率为2.29%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

7月政治局会议定调稳经济之后，近期各类稳增长政策密集出台，房地产以及消费领域，我们都已经看到明确的大力度的政策支持。持续有力的政策支持将托举经济逐步走出二季度以来的快速下行，市场信心也将逐步筑底。美元加息以及海外流动性对A股市场的冲击我们认为也已经告一段落，美国经济当前仍保持了相当的韧性，但在7月加息之后，我们认为美联储加息的拐点已经出现。海外流动性的变化叠加国内政策的变化，我们近期已经看到北向资金重新大幅流入。在当前政策、经济以及企业盈利的三重底部，我们认为下半年A股市场有望逐步走出2022年至今整体偏困难的状态，并逐步为更长周期的牛市打好基础。我们当前已值得更加乐观的看待未来市场。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。

估值委员会设主任委员一名，由分管运营的公司领导担任，副主任委员一名，由分管合规的公司领导担任，专业委员若干名，由研究部、投资管理部门（视会议议题内容选择相关投资方向部门）、风险部门、监察稽核部门、基金运营部门负责人或其指定人员组成。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。

估值委员会主要工作职责如下：制定合理、公允的估值方法；对估值方法进行讨论并作出评价，在发生了影响估值公允性及合理性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用；评价现有估值方法对新投资策略或新投资品种的适用性，对新投资策略或新投资品种采用的估值方法作出决定；讨论、决定其他与估值相关的重大问题。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。

本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

会计师事务所对相关估值模型、假设及参数的适当性出具意见。

定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金合同》，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。  
本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。  
本报告期没有应分配但尚未分配的利润。

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

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

本报告期内，本基金自2023年01月01日起至2023年06月18日止基金资产净值低于五千万。本报告期末，本基金基金资产净值已不低于五千万。

### §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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### 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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### §6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	3,399,554.84	288,500.31
结算备付金		71,974.92	-
存出保证金		15,646.77	1,204.07
交易性金融资产	6.4.7.2	51,966,997.85	9,101,036.45
其中：股票投资		51,964,254.48	9,098,486.26
基金投资		-	-
债券投资		2,743.37	2,550.19
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		55,454,174.38	9,390,740.83
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>

		2023年06月30日	2022年12月31日
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		14,662.33	4,072.64
应付托管费		2,932.45	814.53
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	54,206.17	52,075.90
负债合计		71,800.95	56,963.07
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	60,560,583.00	10,560,583.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-5,178,209.57	-1,226,805.24
净资产合计		55,382,373.43	9,333,777.76
负债和净资产总计		55,454,174.38	9,390,740.83

注：报告截止日2023年06月30日，基金份额净值0.9145元，基金份额总额60,560,583.00份。

## 6.2 利润表

会计主体：兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
----	-----	----	---------

		2023年01月01日至 2023年06月30日	2022年01月01日至202 2年06月30日
<b>一、营业总收入</b>		-526,834.59	-881,519.02
1.利息收入		1,981.75	1,126.32
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,981.75	1,126.32
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-583,362.63	-177,773.80
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-927,015.98	-306,389.19
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	2.38	293.09
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	343,650.97	128,322.30
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	88,016.89	-727,760.68
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-33,470.60	22,889.14
<b>减：二、营业总支出</b>		94,905.56	58,457.86

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	54,886.29	26,549.78
2. 托管费	6.4.10.2.2	10,977.26	5,309.96
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.18	29,042.01	26,598.12
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-621,740.15	-939,976.88
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-621,740.15	-939,976.88
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-621,740.15	-939,976.88

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	10,560,583.00	-	-1,226,805.24	9,333,777.76
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差	-	-	-	-



错更正				
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	10,560,583.00	-	-1,226,805.24	9,333,777.76
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	50,000,000.00	-	-3,951,404.33	46,048,595.67
（一）、综合收益总额	-	-	-621,740.15	-621,740.15
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	50,000,000.00	-	-3,329,664.18	46,670,335.82
其中：1.基金申购款	85,000,000.00	-	-5,311,856.75	79,688,143.25
2.基金赎回款	-35,000,000.00	-	1,982,192.57	-33,017,807.43
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	60,560,583.00	-	-5,178,209.57	55,382,373.43
项目	上年度可比期间			

	2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	10,560,583.00	-	898,996.80	11,459,579.80
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	10,560,583.00	-	898,996.80	11,459,579.80
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-	-1,243,402.21	-1,243,402.21
（一）、综合收益总额	-	-	-939,976.88	-939,976.88
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-303,425.33	-303,425.33
其中：1.基金申购款	2,500,000.00	-	-488,249.67	2,011,750.33
2.基金赎回款	-2,500,000.00	-	184,824.34	-2,315,175.66
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少	-	-	-	-

以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	10,560,583.00	-	-344,405.41	10,216,177.59

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

叶文煌

张顺国

夏鹏

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人兴业基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]2463号文准予公开募集注册。本基金为交易型开放式基金,存续期限为不定期。本基金首次设立募集基金份额为218,060,583.00份,经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为毕马威华振验字第2000445号验资报告。《兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于2020年6月30日正式生效。本基金的基金管理人为兴业基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的《兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括标的指数的成份股及其备选成份股、其他股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、股指期货、债券(包括国债、地方政府债、政府支持机构债券、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、同业存单、现金,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)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净

值的90%，且不低于非现金基金资产的80%。如法律法规或中国证监会允许，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。在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年跟踪误差不超过2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。本基金的业绩比较基准为标的指数，即中证500指数收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表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2023年06月30日的财务状况以及自2023年1月1日起至2023年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 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。

#### 6.4.6 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[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]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]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，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。

(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，受让方不再缴纳印花税。

(5)本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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
活期存款	3,399,554.84
等于：本金	3,399,191.81
加：应计利息	363.03
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-

其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	3,399,554.84

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	53,211,087.67	-	51,964,254.48	-1,246,833.19	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	2,000.00	3.17	2,743.37	740.20
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,000.00	3.17	2,743.37	740.20
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	53,213,087.67	3.17	51,966,997.85	-1,246,092.99	

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付交易费用	27,036.26
其中：交易所市场	27,036.26
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	24,795.19
应付指数使用费	2,374.72
合计	54,206.17

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,560,583.00	10,560,583.00
本期申购	85,000,000.00	85,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-35,000,000.00	-35,000,000.00
本期末	60,560,583.00	60,560,583.00

注：申购份额含红利再投、转换入及分级份额调增份额；赎回份额含转换出及分级份额调减份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	880,864.67	-2,107,669.91	-1,226,805.24
本期利润	-709,757.04	88,016.89	-621,740.15
本期基金份额交易产生的变动数	2,768,805.94	-6,098,470.12	-3,329,664.18
其中：基金申购款	5,225,640.69	-10,537,497.44	-5,311,856.75
基金赎回款	-2,456,834.75	4,439,027.32	1,982,192.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,939,913.57	-8,118,123.14	-5,178,209.57

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
活期存款利息收入	1,541.84
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	374.20
其他	65.71
合计	1,981.75

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-652,216.65
股票投资收益——赎回差价收入	-274,799.33
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-927,015.98



### 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
卖出股票成交总额	17,742,427.02
减：卖出股票成本总额	18,329,310.33
减：交易费用	65,333.34
买卖股票差价收入	-652,216.65

### 6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
赎回基金份额对价总额	33,017,807.43
减：现金支付赎回款总额	17,314,410.43
减：赎回股票成本总额	15,978,196.33
减：交易费用	-
赎回差价收入	-274,799.33

### 6.4.7.11 债券投资收益

#### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
债券投资收益——利息收入	2.38
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	2.38

#### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无买卖债券差价收入。

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.13 衍生工具收益

##### 6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益--买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益--其他投资收益。

#### 6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	343,650.97
基金投资产生的股利收益	-
合计	343,650.97

#### 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
1.交易性金融资产	88,016.89
——股票投资	87,826.09
——债券投资	190.80
——资产支持证券投资	-
——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	88,016.89

#### 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
基金赎回费收入	-
ETF基金替代损益	-33,470.60
合计	-33,470.60

#### 6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期内未发生信用减值损失。

#### 6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	-
汇划手续费	953.68
其他费用_指数使用费	3,293.14
合计	29,042.01

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至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。

## 6.4.9 关联方关系

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

本报告期间存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
兴业基金管理有限公司(以下简称"兴业基金")	基金管理人
中国银行股份有限公司(以下简称"中国银行")	基金托管人
兴业银行股份有限公司(以下简称"兴业银行")	基金管理人的控股股东
中海集团投资有限公司(以下简称"中海集团")	基金管理人的股东
兴业财富资产管理有限公司(以下简称"兴业财富")	基金管理人控制的公司
兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	本基金的联接基金

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。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	54,886.29	26,549.78
其中：支付销售机构的客户维护费	4,549.84	-

注：支付基金管理人兴业基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.50%÷当年天数。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	10,977.26	5,309.96

注：支付基金托管人中国银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当年天数。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

本基金本报告期内及上年度可比期间均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

#### 6.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023年06月30日		上年度末 2022年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
兴业中证 500 交易型开放式指数证券投资基金	50,000,000.00	82.56%	0.00	0.00%

#### 6.4.10.5 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 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	3,399,554.84	1,541.84	380,155.28	843.41

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率或协议利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023年06月30日）本基金持有的流通受限证券

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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601298	青岛港	2023-06-28	-	6.97	2023-07-03	7.40	5,200	34,646.48	36,244.00	-

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末持有的债券中无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的与本基金所投资金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金基金管理人从事风险管理的主要目标是在有效控制上述风险的前提下，通过对各类市场影响因素分析以及投资组合积极主动管理，力争获得超过业绩比较基准的长期稳定收益，使本基金在风险和收益之间取得最佳平衡。

本基金基金管理人按照"自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工"的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。本基金基金管理人建立的风险管理体系由三层风险防范等级构成：

一级风险防范是指公司董事会层面对公司的风险进行的预防和控制。董事会下设审计与风险管理委员会，负责公司审计风险的控制、管理、监督和评价；对公司经营的合法、合规性进行监控和检查，对经营活动进行审计。

二级风险防范是指公司内部控制与风险管理委员会、投资决策委员会和风险管理部层次对公司风险进行的预防和控制。管理层下设内部控制与风险管理委员会，对公司在

经营管理和基金运作中的风险进行研究、分析与评估，制定相应风险控制制度并监督其执行，全面、及时、有效地防范公司经营过程中可能面临的各类风险。

三级风险防范是指公司各部门对自身业务风险进行的自我检查和控制。公司各部门根据经营计划、业务规则及部门具体情况，制定本部门业务流程及风险控制措施。

针对金融工具所面临的相关风险，本基金基金管理人主要通过定性与定量分析相结合的方法进行管理，即依据定性分析以判断风险损失的严重程度及同类风险损失的发生频度，凭借定量分析以确定风险损失的限度及相应的置信程度，进而及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，以确保将风险控制在可承受范围内。

#### **6.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金所投资证券的发行人出现违约或拒绝支付到期利息、本金，或基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任等，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金基金管理人建立了较为完善的信用风险管理流程，通过对信用债券发行人基本面调研分析，结合流动性、信用利差、信用评级、违约风险等方面的综合评估结果，选取具有价格优势和套利机会的优质信用债券产品进行投资。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。本基金通过对银行间同业市场交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，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基金管理人旗下其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的10%。本基金的交易所交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手，并完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。

本基金报告期末及上年度末债券投资按短期信用评级及长期信用评级列示的情况如下，其中不包括本基金所持有的国债、央行票据、政策性金融债。

##### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本基金报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

##### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

##### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元



长期信用评级	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA以下	2,743.37	2,550.19
未评级	0.00	0.00
合计	2,743.37	2,550.19

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易相对不活跃导致基金投资资产无法以适当价格及时变现，进而无法应对债务到期偿付或投资者赎回款按时支付的风险。

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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本报告期内，基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理。本基金所持大部分证券在证券交易所上市或银行间同业市场交易，不存在具有重大流动性风险的投资品种。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度，对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

截止本报告期末及上年度末，本基金无重大流动性风险。

### 6.4.13.4 市场风险

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

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指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、结算备付金及债券投资等。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金基金管理人主要通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年0 6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,399,554.84	-	-	-	3,399,554.84
结算备付金	71,974.92	-	-	-	71,974.92
存出保证金	15,646.77	-	-	-	15,646.77
交易性金融资产	2,743.37	-	-	51,964,254.48	51,966,997.85
资产总计	3,489,919.90	-	-	51,964,254.48	55,454,174.38
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	14,662.33	14,662.33
应付托管费	-	-	-	2,932.45	2,932.45
其他负债	-	-	-	54,206.17	54,206.17
负债总计	-	-	-	71,800.95	71,800.95
利率敏感度缺	3,489,919.90	-	-	51,892,453.53	55,382,373.43

口					
上年度末 2022 年 1 2 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	288,500.31	-	-	-	288,500.31
存出保证金	1,204.07	-	-	-	1,204.07
交易性金融资产	2,550.19	-	-	9,098,486.26	9,101,036.45
资产总计	292,254.57	-	-	9,098,486.26	9,390,740.83
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	4,072.64	4,072.64
应付托管费	-	-	-	814.53	814.53
其他负债	-	-	-	52,075.90	52,075.90
负债总计	-	-	-	56,963.07	56,963.07
利率敏感度缺口	292,254.57	-	-	9,041,523.19	9,333,777.76

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
假设	2、利率曲线平行移动		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	市场利率上升25个基点	-36.98	-37.01

	市场利率下降25个基点	37.59	37.66
--	-------------	-------	-------

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他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，所面临的其他价格风险可来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项，也可来源于市场整体波动。

本基金基金管理人在构建和管理投资组合过程中，通过对宏观经济情况及政策分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金基金管理人定期结合宏观及微观环境变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行动态修正，以主动应对可能发生的其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，基金管理人对本基金所持仓证券价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量，以测试本基金所面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	51,964,254.48	93.83	9,098,486.26	97.00
交易性金融资产—基金投资	0.00	-	0.00	-
交易性金融资产—债券投资	0.00	-	0.00	-
交易性金融资	-	-	-	-

产—贵金属投资				
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	0.00	-	0.00	-
合计	51,964,254.48	93.83	9,098,486.26	97.00

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除股票价格以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	股票价格上升5%	2,598,212.72	454,924.31
	股票价格下降5%	-2,598,212.72	-454,924.31

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	51,930,753.85	9,066,488.45
第二层次	36,244.00	34,548.00
第三层次	-	-
合计	51,966,997.85	9,101,036.45

#### 6.4.14.2 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可转换债券，若出现重大事项停牌、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不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括货币资金、应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相等。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	51,964,254.48	93.71
	其中：股票	51,964,254.48	93.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,743.37	0.00
	其中：债券	2,743.37	0.00
	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	3,471,529.76	6.26
8	其他各项资产	15,646.77	0.03
9	合计	55,454,174.38	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	418,642.00	0.76
B	采矿业	2,178,369.50	3.93
C	制造业	32,546,948.12	58.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,641,618.10	2.96
E	建筑业	598,840.00	1.08
F	批发和零售业	1,780,717.36	3.22
G	交通运输、仓储和邮政业	845,413.00	1.53
H	住宿和餐饮业	90,960.00	0.16
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,252,418.00	5.87
J	金融业	4,753,453.90	8.58
K	房地产业	766,761.00	1.38
L	租赁和商务服务业	697,803.00	1.26
M	科学研究和技术服务业	607,800.00	1.10
N	水利、环境和公共设施管理业	315,576.80	0.57
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	289,124.00	0.52
R	文化、体育和娱乐业	769,182.00	1.39
S	综合	312,819.70	0.56
	合计	51,866,446.48	93.65

### 7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	50,078.00	0.09
C	制造业	47,730.00	0.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
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	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	97,808.00	0.18

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例
----	------	------	-------	---------	-----------



					(%)
1	300308	中际旭创	4,800	707,760.00	1.28
2	002384	东山精密	12,000	310,800.00	0.56
3	300418	昆仑万维	7,600	306,128.00	0.55
4	002850	科达利	2,300	304,175.00	0.55
5	000988	华工科技	7,600	288,876.00	0.52
6	300012	华测检测	14,400	280,800.00	0.51
7	600372	中航电子	18,400	279,312.00	0.50
8	002340	格林美	40,000	276,400.00	0.50
9	002422	科伦药业	9,200	273,056.00	0.49
10	300724	捷佳伟创	2,400	269,640.00	0.49
11	603688	石英股份	2,300	261,832.00	0.47
12	600079	人福医药	9,600	258,624.00	0.47
13	300037	新宙邦	4,800	249,072.00	0.45
14	600487	亨通光电	16,800	246,288.00	0.44
15	600489	中金黄金	23,000	237,590.00	0.43
16	000423	东阿阿胶	4,400	235,180.00	0.42
17	601555	东吴证券	33,160	230,130.40	0.42
18	300474	景嘉微	2,550	229,474.50	0.41
19	300003	乐普医疗	10,100	228,361.00	0.41
20	600885	宏发股份	7,120	226,772.00	0.41
21	600482	中国动力	9,600	225,024.00	0.41
22	002028	思源电气	4,800	224,256.00	0.40
23	000009	中国宝安	18,510	223,415.70	0.40
24	002738	中矿资源	4,360	222,098.40	0.40
25	000807	云铝股份	17,400	221,502.00	0.40
26	601058	赛轮轮胎	19,200	218,688.00	0.39
27	600486	扬农化工	2,400	209,808.00	0.38
28	600536	中国软件	4,395	206,037.60	0.37
29	002156	通富微电	9,100	205,660.00	0.37
30	600415	小商品城	24,100	205,573.00	0.37

31	300487	蓝晓科技	3,250	202,865.00	0.37
32	300866	安克创新	2,300	201,250.00	0.36
33	300058	蓝色光标	20,700	200,169.00	0.36
34	002185	华天科技	21,700	199,640.00	0.36
35	300285	国瓷材料	7,200	197,280.00	0.36
36	002624	完美世界	11,500	194,235.00	0.35
37	601108	财通证券	26,800	194,032.00	0.35
38	600352	浙江龙盛	20,700	193,545.00	0.35
39	600765	中航重机	7,200	190,872.00	0.34
40	002407	多氟多	9,460	187,875.60	0.34
41	600161	天坛生物	6,900	187,335.00	0.34
42	002966	苏州银行	28,560	187,068.00	0.34
43	300146	汤臣倍健	7,800	187,044.00	0.34
44	000783	长江证券	32,100	186,180.00	0.34
45	601077	渝农商行	51,700	185,603.00	0.34
46	002463	沪电股份	8,800	184,272.00	0.33
47	000630	铜陵有色	63,500	183,515.00	0.33
48	002385	大北农	27,800	183,480.00	0.33
49	002625	光启技术	12,000	183,120.00	0.33
50	601233	桐昆股份	13,800	182,850.00	0.33
51	000066	中国长城	13,200	182,556.00	0.33
52	603596	伯特利	2,300	182,298.00	0.33
53	600862	中航高科	7,200	182,232.00	0.33
54	600418	江淮汽车	14,400	181,296.00	0.33
55	600109	国金证券	20,600	178,602.00	0.32
56	600060	海信视像	7,200	178,200.00	0.32
57	600988	赤峰黄金	13,200	177,672.00	0.32
58	000975	银泰黄金	15,020	175,734.00	0.32
59	603816	顾家家居	4,600	175,490.00	0.32
60	002409	雅克科技	2,400	174,912.00	0.32
61	600298	安琪酵母	4,800	173,808.00	0.31

62	002008	大族激光	6,600	172,920.00	0.31
63	002223	鱼跃医疗	4,800	172,752.00	0.31
64	600027	华电国际	25,700	171,933.00	0.31
65	300144	宋城演艺	13,800	171,120.00	0.31
66	002497	雅化集团	9,600	170,688.00	0.31
67	600705	中航产融	44,500	170,435.00	0.31
68	002138	顺络电子	7,100	169,761.00	0.31
69	605358	立昂微	4,600	168,958.00	0.31
70	603893	瑞芯微	2,300	167,555.00	0.30
71	002568	百润股份	4,600	167,210.00	0.30
72	300024	机器人	10,000	166,700.00	0.30
73	603882	金城医学	2,200	166,100.00	0.30
74	300390	天华新能	4,630	165,754.00	0.30
75	600160	巨化股份	12,000	165,360.00	0.30
76	000932	华菱钢铁	34,500	164,565.00	0.30
77	603939	益丰药房	4,400	162,800.00	0.29
78	002797	第一创业	28,400	162,448.00	0.29
79	601128	常熟银行	23,800	162,316.00	0.29
80	600096	云天化	9,500	162,165.00	0.29
81	300253	卫宁健康	14,900	161,218.00	0.29
82	601162	天风证券	53,800	160,324.00	0.29
83	600141	兴发集团	7,200	159,984.00	0.29
84	002683	广东宏大	5,400	158,976.00	0.29
85	002465	海格通信	15,300	158,202.00	0.29
86	300568	星源材质	9,200	158,148.00	0.29
87	603267	鸿远电子	2,400	156,720.00	0.28
88	600066	宇通客车	10,600	156,244.00	0.28
89	600879	航天电子	18,400	156,216.00	0.28
90	601168	西部矿业	14,800	155,548.00	0.28
91	600839	四川长虹	30,700	155,035.00	0.28
92	002439	启明星辰	5,200	154,752.00	0.28

93	600392	盛和资源	12,000	154,440.00	0.28
94	002078	太阳纸业	14,400	153,936.00	0.28
95	000021	深科技	7,700	153,923.00	0.28
96	002192	融捷股份	2,300	153,709.00	0.28
97	300136	信维通信	7,600	152,608.00	0.28
98	002430	杭氧股份	4,400	151,184.00	0.27
99	000729	燕京啤酒	12,100	150,887.00	0.27
100	002294	信立泰	4,800	149,712.00	0.27
101	600177	雅戈尔	23,700	149,547.00	0.27
102	600497	驰宏锌锗	29,700	149,094.00	0.27
103	601696	中银证券	13,900	148,174.00	0.27
104	000998	隆平高科	9,600	147,360.00	0.27
105	600642	申能股份	21,000	146,790.00	0.27
106	600325	华发股份	14,900	146,765.00	0.27
107	002025	航天电器	2,300	146,740.00	0.26
108	601990	南京证券	17,800	145,604.00	0.26
109	000683	远兴能源	20,200	145,238.00	0.26
110	000728	国元证券	22,100	144,092.00	0.26
111	300676	华大基因	2,400	143,976.00	0.26
112	600873	梅花生物	16,100	143,773.00	0.26
113	000933	神火股份	11,000	143,000.00	0.26
114	603026	胜华新材	2,400	142,200.00	0.26
115	000831	中国稀土	4,800	142,080.00	0.26
116	300832	新产业	2,400	141,600.00	0.26
117	600637	东方明珠	18,000	140,760.00	0.25
117	000629	钒钛股份	36,000	140,760.00	0.25
119	600153	建发股份	12,900	140,739.00	0.25
120	002240	盛新锂能	4,400	140,228.00	0.25
121	300776	帝尔激光	2,160	140,184.00	0.25
122	002195	二三四五	48,500	140,165.00	0.25
123	603000	人民网	4,800	140,160.00	0.25

124	300017	网宿科技	19,700	140,067.00	0.25
125	002673	西部证券	22,000	139,700.00	0.25
126	002299	圣农发展	7,200	137,880.00	0.25
127	002444	巨星科技	6,300	137,844.00	0.25
128	600166	福田汽车	40,400	137,360.00	0.25
129	002273	水晶光电	11,500	137,310.00	0.25
130	600563	法拉电子	1,000	137,300.00	0.25
131	002600	领益智造	19,800	136,818.00	0.25
132	600499	科达制造	12,000	136,320.00	0.25
133	002065	东华软件	19,300	136,258.00	0.25
134	000997	新大陆	7,200	136,080.00	0.25
135	300699	光威复材	4,400	135,740.00	0.25
136	002372	伟星新材	6,600	135,564.00	0.24
137	600118	中国卫星	4,800	135,408.00	0.24
138	600521	华海药业	7,300	134,393.00	0.24
139	000591	太阳能	19,800	134,244.00	0.24
140	600699	均胜电子	7,600	134,064.00	0.24
141	002268	电科网安	4,800	133,776.00	0.24
142	603712	七一二	4,400	132,924.00	0.24
143	300595	欧普康视	4,400	132,836.00	0.24
144	002131	利欧股份	57,500	132,250.00	0.24
145	603456	九洲药业	4,800	131,424.00	0.24
146	002056	横店东磁	7,200	131,112.00	0.24
147	002373	千方科技	9,600	130,944.00	0.24
148	600516	方大炭素	21,100	130,820.00	0.24
149	600529	山东药玻	4,800	130,656.00	0.24
150	600867	通化东宝	12,500	130,500.00	0.24
151	000519	中兵红箭	7,200	130,248.00	0.24
152	600170	上海建工	48,300	129,927.00	0.23
153	600143	金发科技	14,800	129,204.00	0.23
154	300088	长信科技	21,400	129,042.00	0.23

155	300383	光环新网	12,000	129,000.00	0.23
156	600704	物产中大	26,000	128,440.00	0.23
157	603589	口子窖	2,600	128,310.00	0.23
158	600549	厦门钨业	6,700	127,501.00	0.23
159	600399	抚顺特钢	12,400	126,480.00	0.23
160	600739	辽宁成大	9,600	126,240.00	0.23
161	600271	航天信息	9,200	125,948.00	0.23
162	601997	贵阳银行	24,400	125,904.00	0.23
163	603077	和邦生物	51,700	125,631.00	0.23
164	601577	长沙银行	16,100	124,936.00	0.23
165	002507	涪陵榨菜	6,800	124,508.00	0.22
166	000738	航发控制	5,100	124,440.00	0.22
167	603658	安图生物	2,400	124,152.00	0.22
168	002368	太极股份	3,000	123,510.00	0.22
169	000623	吉林敖东	7,700	123,508.00	0.22
170	603338	浙江鼎力	2,200	123,222.00	0.22
171	600481	双良节能	8,800	123,024.00	0.22
171	300244	迪安诊断	4,800	123,024.00	0.22
173	603233	大参林	4,372	122,459.72	0.22
174	600970	中材国际	9,600	122,400.00	0.22
175	600380	健康元	9,600	122,016.00	0.22
176	601016	节能风电	33,170	121,733.90	0.22
177	603737	三棵树	1,860	121,681.20	0.22
178	002508	老板电器	4,800	121,392.00	0.22
179	002203	海亮股份	10,100	121,301.00	0.22
180	601198	东兴证券	15,100	121,102.00	0.22
181	300073	当升科技	2,400	120,792.00	0.22
182	002353	杰瑞股份	4,800	120,624.00	0.22
183	002739	万达电影	9,600	120,384.00	0.22
184	600348	华阳股份	15,150	119,836.50	0.22
185	600998	九州通	11,473	119,089.74	0.22

186	002532	天山铝业	19,800	118,602.00	0.21
187	603156	养元饮品	4,800	118,560.00	0.21
188	600021	上海电力	11,000	118,470.00	0.21
189	000960	锡业股份	7,600	118,180.00	0.21
190	002152	广电运通	10,000	117,200.00	0.21
191	300558	贝达药业	2,400	115,272.00	0.21
192	000703	恒逸石化	17,000	115,260.00	0.21
193	300001	特锐德	5,500	114,290.00	0.21
194	600863	内蒙华电	27,300	113,295.00	0.20
195	300296	利亚德	17,300	112,969.00	0.20
196	300118	东方日升	4,400	112,772.00	0.20
197	600580	卧龙电驱	7,700	112,497.00	0.20
198	601636	旗滨集团	13,000	112,060.00	0.20
199	300182	捷成股份	17,700	111,687.00	0.20
200	000636	风华高科	7,200	110,448.00	0.20
201	600655	豫园股份	16,100	110,446.00	0.20
202	600909	华安证券	23,590	110,165.30	0.20
203	603826	坤彩科技	2,200	110,000.00	0.20
203	002032	苏泊尔	2,200	110,000.00	0.20
205	600546	山煤国际	7,600	109,972.00	0.20
206	002506	协鑫集成	37,300	109,289.00	0.20
207	300604	长川科技	2,300	109,227.00	0.20
208	000750	国海证券	32,600	109,210.00	0.20
209	000400	许继电气	4,700	108,335.00	0.20
210	300395	菲利华	2,200	108,240.00	0.20
211	600329	达仁堂	2,400	107,736.00	0.19
212	002092	中泰化学	16,700	107,715.00	0.19
213	600008	首创环保	37,390	107,683.20	0.19
214	600535	天士力	7,400	107,374.00	0.19
215	002926	华西证券	12,900	107,199.00	0.19
216	300682	朗新科技	4,600	107,088.00	0.19

217	600820	隧道股份	17,800	106,978.00	0.19
218	600859	王府井	5,400	106,866.00	0.19
219	600435	北方导航	9,300	106,857.00	0.19
220	603160	汇顶科技	2,300	106,375.00	0.19
221	600369	西南证券	29,100	106,215.00	0.19
222	000878	云南铜业	9,600	106,080.00	0.19
223	600390	五矿资本	19,700	105,986.00	0.19
224	600498	烽火通信	5,200	105,924.00	0.19
225	300438	鹏辉能源	2,200	105,688.00	0.19
226	002531	天顺风能	6,900	105,087.00	0.19
227	600528	中铁工业	10,600	104,728.00	0.19
228	603127	昭衍新药	2,560	104,704.00	0.19
229	000060	中金岭南	22,000	104,500.00	0.19
230	002281	光迅科技	2,800	103,852.00	0.19
231	000039	中集集团	15,000	103,350.00	0.19
232	002429	兆驰股份	18,700	102,850.00	0.19
233	300677	英科医疗	4,660	102,520.00	0.19
234	300529	健帆生物	4,400	101,992.00	0.18
235	603885	吉祥航空	6,600	101,838.00	0.18
236	002985	北摩高科	2,300	101,476.00	0.18
237	000830	鲁西化工	9,600	101,376.00	0.18
238	300070	碧水源	18,900	101,304.00	0.18
239	600511	国药股份	2,600	101,010.00	0.18
240	000893	亚钾国际	4,400	100,936.00	0.18
241	600895	张江高科	7,200	100,224.00	0.18
242	000547	航天发展	10,000	100,000.00	0.18
243	300861	美畅股份	2,300	99,751.00	0.18
244	002557	洽洽食品	2,400	99,720.00	0.18
245	603858	步长制药	4,800	98,832.00	0.18
246	002500	山西证券	17,700	98,766.00	0.18
247	002936	郑州银行	42,720	98,256.00	0.18



248	601966	玲珑轮胎	4,400	97,768.00	0.18
249	000513	丽珠集团	2,500	97,275.00	0.18
250	000970	中科三环	7,580	97,175.60	0.18
251	600131	国网信通	4,800	96,912.00	0.17
252	601179	中国西电	17,800	96,298.00	0.17
253	600827	百联股份	7,200	96,264.00	0.17
254	300009	安科生物	9,620	96,200.00	0.17
255	002153	石基信息	6,860	96,040.00	0.17
256	601717	郑煤机	7,700	95,865.00	0.17
257	600398	海澜之家	13,900	95,632.00	0.17
258	600038	中直股份	2,400	95,568.00	0.17
259	002128	电投能源	7,200	95,184.00	0.17
260	301029	怡合达	2,120	94,721.60	0.17
261	002080	中材科技	4,600	94,392.00	0.17
262	000887	中鼎股份	7,200	94,248.00	0.17
263	603927	中科软	2,420	93,315.20	0.17
264	300373	扬杰科技	2,300	93,311.00	0.17
265	601880	辽港股份	59,500	92,820.00	0.17
266	300026	红日药业	17,100	92,682.00	0.17
267	600056	中国医药	7,120	92,417.60	0.17
268	000027	深圳能源	14,000	92,260.00	0.17
269	000050	深天马 A	10,000	91,800.00	0.17
270	002595	豪迈科技	2,600	91,338.00	0.16
271	603218	日月股份	4,800	91,152.00	0.16
272	600258	首旅酒店	4,800	90,960.00	0.16
273	300888	稳健医疗	2,180	90,840.60	0.16
274	600848	上海临港	7,600	90,820.00	0.16
275	002408	齐翔腾达	14,200	90,454.00	0.16
276	002939	长城证券	11,100	90,243.00	0.16
277	600673	东阳光	12,400	89,404.00	0.16
278	600208	新湖中宝	36,000	89,280.00	0.16

279	603517	绝味食品	2,400	89,160.00	0.16
280	002670	国盛金控	10,100	88,678.00	0.16
281	002244	滨江集团	10,000	88,200.00	0.16
282	002518	科士达	2,200	88,022.00	0.16
283	601000	唐山港	24,900	87,897.00	0.16
284	002155	湖南黄金	7,200	87,840.00	0.16
285	300212	易华录	2,640	87,727.20	0.16
286	600282	南钢股份	26,000	87,620.00	0.16
287	600171	上海贝岭	4,800	87,600.00	0.16
288	600985	淮北矿业	7,600	87,552.00	0.16
289	600582	天地科技	15,000	87,450.00	0.16
290	601991	大唐发电	26,400	87,384.00	0.16
291	600667	太极实业	12,000	87,120.00	0.16
292	600316	洪都航空	3,700	86,765.00	0.16
293	600259	广晟有色	2,400	86,736.00	0.16
294	601666	平煤股份	11,500	86,710.00	0.16
295	600378	昊华科技	2,300	86,572.00	0.16
296	300850	新强联	2,300	85,974.00	0.16
297	300115	长盈精密	7,200	85,752.00	0.15
298	002572	索菲亚	4,900	85,358.00	0.15
299	000739	普洛药业	4,800	85,152.00	0.15
300	600517	国网英大	14,900	84,930.00	0.15
301	601958	金钼股份	7,600	84,740.00	0.15
302	002019	亿帆医药	5,800	84,680.00	0.15
303	002249	大洋电机	14,800	84,360.00	0.15
304	600416	湘电股份	4,400	83,996.00	0.15
305	601866	中远海发	34,000	83,980.00	0.15
306	601456	国联证券	9,200	83,720.00	0.15
307	603568	伟明环保	4,780	83,697.80	0.15
308	002958	青农商行	30,700	83,504.00	0.15
309	002266	浙富控股	20,000	82,600.00	0.15

310	601928	凤凰传媒	7,200	82,080.00	0.15
311	600755	厦门国贸	10,600	82,044.00	0.15
312	000778	新兴铸管	20,100	82,008.00	0.15
313	300251	光线传媒	10,100	81,709.00	0.15
314	300357	我武生物	2,400	80,712.00	0.15
315	000709	河钢股份	35,600	80,456.00	0.15
316	000598	兴蓉环境	14,800	80,364.00	0.15
317	002511	中顺洁柔	7,200	80,280.00	0.14
318	603225	新凤鸣	7,212	79,692.60	0.14
319	000155	川能动力	5,500	79,200.00	0.14
320	000883	湖北能源	17,300	78,888.00	0.14
321	603650	彤程新材	2,400	78,720.00	0.14
322	002221	东华能源	9,100	78,715.00	0.14
323	003035	南网能源	11,000	78,320.00	0.14
324	300618	寒锐钴业	2,400	77,784.00	0.14
325	600959	江苏有线	23,000	77,740.00	0.14
326	002432	九安医疗	2,200	77,462.00	0.14
327	600737	中粮糖业	9,600	77,280.00	0.14
328	000987	越秀资本	12,160	77,216.00	0.14
329	600718	东软集团	7,200	76,752.00	0.14
330	002030	达安基因	7,660	76,370.20	0.14
331	000825	太钢不锈	19,700	76,239.00	0.14
332	601992	金隅集团	34,900	76,082.00	0.14
333	000581	威孚高科	4,800	75,600.00	0.14
334	600906	财达证券	10,400	74,880.00	0.14
335	002468	申通快递	6,900	74,658.00	0.13
336	603883	老百姓	2,498	74,565.30	0.13
337	601106	中国一重	22,100	74,256.00	0.13
338	601098	中南传媒	6,400	74,240.00	0.13
339	002326	永太科技	4,800	73,392.00	0.13
340	002183	怡亚通	14,300	72,930.00	0.13

341	600967	内蒙一机	7,200	72,720.00	0.13
342	601665	齐鲁银行	18,400	72,128.00	0.13
343	600297	广汇汽车	34,500	71,760.00	0.13
344	600155	华创云信	11,500	71,530.00	0.13
345	000012	南玻 A	12,000	71,520.00	0.13
346	601778	晶科科技	14,400	71,136.00	0.13
347	600663	陆家嘴	7,200	71,064.00	0.13
348	300363	博腾股份	2,400	71,016.00	0.13
349	603529	爱玛科技	2,200	70,884.00	0.13
350	603866	桃李面包	6,998	70,819.76	0.13
351	000401	冀东水泥	9,600	70,752.00	0.13
352	600566	济川药业	2,400	69,696.00	0.13
353	600315	上海家化	2,400	69,624.00	0.13
354	601231	环旭电子	4,600	68,816.00	0.12
355	600373	中文传媒	5,100	67,932.00	0.12
356	002487	大金重工	2,200	67,848.00	0.12
357	300442	润泽科技	2,200	67,672.00	0.12
358	601118	海南橡胶	14,900	66,752.00	0.12
359	600500	中化国际	12,000	66,720.00	0.12
360	600598	北大荒	5,000	66,650.00	0.12
361	000930	中粮科技	8,200	66,420.00	0.12
362	002745	木林森	7,200	66,240.00	0.12
363	300748	金力永磁	2,200	65,824.00	0.12
364	603707	健友股份	4,871	65,758.50	0.12
365	002690	美亚光电	2,550	65,662.50	0.12
366	600764	中国海防	2,400	65,328.00	0.12
367	002010	传化智联	12,100	64,372.00	0.12
368	300482	万孚生物	2,410	64,178.30	0.12
369	600871	石化油服	32,200	63,756.00	0.12
370	002831	裕同科技	2,600	63,414.00	0.11
371	001227	兰州银行	22,000	62,920.00	0.11

372	601608	中信重工	14,900	62,729.00	0.11
373	600556	天下秀	8,800	62,392.00	0.11
374	600801	华新水泥	5,000	61,750.00	0.11
375	603228	景旺电子	2,400	61,560.00	0.11
376	002867	周大生	3,450	61,341.00	0.11
376	000785	居然之家	16,100	61,341.00	0.11
378	000937	冀中能源	9,600	61,248.00	0.11
379	601611	中国核建	7,200	60,840.00	0.11
380	002250	联化科技	5,800	60,668.00	0.11
381	600339	中油工程	14,900	60,643.00	0.11
382	601598	中国外运	12,900	60,114.00	0.11
383	000156	华数传媒	6,900	60,030.00	0.11
384	601156	东航物流	4,600	59,800.00	0.11
385	600707	彩虹股份	12,500	59,500.00	0.11
386	601718	际华集团	19,700	58,509.00	0.11
387	600901	江苏金租	14,140	58,398.20	0.11
388	002081	金螳螂	12,900	58,179.00	0.11
389	000559	万向钱潮	10,600	57,770.00	0.10
390	002423	中粮资本	7,200	57,600.00	0.10
391	600782	新钢股份	15,500	57,505.00	0.10
392	000089	深圳机场	8,200	56,990.00	0.10
393	002505	鹏都农牧	30,100	56,889.00	0.10
394	002653	海思科	2,400	56,640.00	0.10
395	603379	三美股份	2,400	56,424.00	0.10
396	600195	中牧股份	4,800	56,064.00	0.10
397	600507	方大特钢	12,100	56,023.00	0.10
398	000537	广宇发展	4,800	56,016.00	0.10
399	000898	鞍钢股份	20,100	55,878.00	0.10
400	000869	张裕 A	1,800	55,188.00	0.10
401	600126	杭钢股份	12,600	54,684.00	0.10
402	600409	三友化工	10,000	54,500.00	0.10

403	600597	光明乳业	5,200	54,080.00	0.10
404	600095	湘财股份	6,900	53,820.00	0.10
405	600167	联美控股	7,700	53,669.00	0.10
406	600968	海油发展	17,300	53,111.00	0.10
407	000563	陕国投 A	17,300	52,765.00	0.10
408	600808	马钢股份	20,100	51,657.00	0.09
409	001203	大中矿业	4,600	51,106.00	0.09
410	601187	厦门银行	10,100	50,702.00	0.09
411	603638	艾迪精密	2,460	50,479.20	0.09
412	002608	江苏国信	6,600	49,962.00	0.09
413	000415	渤海租赁	23,500	49,350.00	0.09
414	603444	吉比特	100	49,111.00	0.09
415	600062	华润双鹤	2,800	48,776.00	0.09
416	601568	北元集团	9,200	48,484.00	0.09
417	000967	盈峰环境	9,500	47,975.00	0.09
418	002925	盈趣科技	2,460	47,724.00	0.09
419	000958	电投产融	11,000	47,630.00	0.09
420	000402	金融街	10,100	45,652.00	0.08
421	603317	天味食品	3,096	45,232.56	0.08
422	600377	宁沪高速	4,600	45,218.00	0.08
423	002563	森马服饰	7,200	44,784.00	0.08
424	601828	美凯龙	9,200	44,068.00	0.08
425	002705	新宝股份	2,400	43,272.00	0.08
426	600623	华谊集团	6,900	42,987.00	0.08
427	002110	三钢闽光	10,000	42,200.00	0.08
428	001914	招商积余	2,800	42,140.00	0.08
429	000959	首钢股份	11,900	41,650.00	0.08
430	001872	招商港口	2,400	41,448.00	0.07
431	300257	开山股份	2,600	39,442.00	0.07
432	600927	永安期货	2,400	39,024.00	0.07
433	600928	西安银行	10,600	37,312.00	0.07

434	603056	德邦股份	2,400	37,008.00	0.07
435	601228	广州港	11,400	36,822.00	0.07
436	000031	大悦城	10,000	36,600.00	0.07
437	601298	青岛港	5,200	36,244.00	0.07
438	601139	深圳燃气	4,800	34,992.00	0.06
439	002761	浙江建投	2,200	33,396.00	0.06
440	002945	华林证券	2,400	32,832.00	0.06
441	601969	海南矿业	4,800	31,584.00	0.06
442	601136	首创证券	2,200	31,174.00	0.06
443	600350	山东高速	4,800	30,576.00	0.06
444	002399	海普瑞	2,600	29,822.00	0.05
445	000553	安道麦A	3,500	29,540.00	0.05
446	688009	中国通号	5,000	29,000.00	0.05
447	600032	浙江新能	2,300	28,888.00	0.05
448	601158	重庆水务	4,600	25,576.00	0.05
449	600995	南网储能	2,200	24,222.00	0.04
450	600956	新天绿能	2,400	20,928.00	0.04
451	600299	安迪苏	2,600	20,722.00	0.04
452	601869	长飞光纤	500	18,505.00	0.03
453	002791	坚朗五金	200	12,942.00	0.02
454	300741	华宝股份	500	10,710.00	0.02
455	603786	科博达	100	6,570.00	0.01
456	603868	飞科电器	100	6,309.00	0.01
457	603355	莱克电气	200	5,082.00	0.01
458	002901	大博医疗	100	3,108.00	0.01

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

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	600256	广汇能源	7,300	50,078.00	0.09

2	600522	中天科技	3,000	47,730.00	0.09
---	--------	------	-------	-----------	------

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300308	中际旭创	649,728.00	6.96
2	300418	昆仑万维	481,072.00	5.15
3	002384	东山精密	476,105.00	5.10
4	002850	科达利	435,351.00	4.66
5	002340	格林美	432,559.00	4.63
6	300012	华测检测	404,221.00	4.33
7	002422	科伦药业	392,679.00	4.21
8	300724	捷佳伟创	366,044.00	3.92
9	300003	乐普医疗	365,733.00	3.92
10	300474	景嘉微	350,061.00	3.75
11	300037	新宙邦	339,205.00	3.63
12	000807	云铝股份	318,480.00	3.41
13	002738	中矿资源	317,973.00	3.41
14	000988	华工科技	317,612.00	3.40
15	002028	思源电气	313,014.00	3.35
16	002407	多氟多	306,735.00	3.29
17	300058	蓝色光标	304,311.00	3.26
18	002185	华天科技	302,967.00	3.25
19	002624	完美世界	299,980.00	3.21
20	002966	苏州银行	296,295.00	3.17
21	300285	国瓷材料	284,570.00	3.05
22	000009	中国宝安	282,770.00	3.03
23	002156	通富微电	281,755.00	3.02
24	002625	光启技术	275,373.00	2.95



25	002497	雅化集团	273,645.00	2.93
26	002385	大北农	273,448.00	2.93
27	000630	铜陵有色	268,674.00	2.88
28	300146	汤臣倍健	266,918.00	2.86
29	002192	融捷股份	266,785.00	2.86
30	300144	宋城演艺	263,769.00	2.83
31	300866	安克创新	260,448.00	2.79
32	002568	百润股份	259,516.00	2.78
33	000975	银泰黄金	257,204.00	2.76
34	002138	顺络电子	255,792.00	2.74
35	000783	长江证券	255,160.60	2.73
36	000932	华菱钢铁	251,692.00	2.70
37	300568	星源材质	248,114.00	2.66
38	000683	远兴能源	245,254.00	2.63
39	002078	太阳纸业	233,563.00	2.50
40	300390	天华新能	232,625.95	2.49
41	002797	第一创业	232,536.00	2.49
42	002294	信立泰	232,306.00	2.49
43	002268	电科网安	227,732.00	2.44
44	000729	燕京啤酒	224,200.00	2.40
45	000629	钒钛股份	223,767.00	2.40
46	300253	卫宁健康	222,225.00	2.38
47	002273	水晶光电	221,208.00	2.37
48	000831	中国稀土	221,009.00	2.37
49	002223	鱼跃医疗	220,707.00	2.36
50	002299	圣农发展	218,507.00	2.34
51	000998	隆平高科	217,854.00	2.33
52	002439	启明星辰	217,202.00	2.33
53	000423	东阿阿胶	216,990.00	2.32
54	002409	雅克科技	212,357.00	2.28
55	002195	二三四五	210,937.00	2.26

56	000519	中兵红箭	209,388.00	2.24
57	300383	光环新网	208,080.00	2.23
58	300136	信维通信	207,547.00	2.22
59	002465	海格通信	207,369.00	2.22
60	300676	华大基因	206,735.00	2.21
61	000728	国元证券	206,208.00	2.21
62	300487	蓝晓科技	206,146.00	2.21
63	300017	网宿科技	205,696.00	2.20
64	002065	东华软件	205,305.00	2.20
65	002683	广东宏大	205,223.00	2.20
66	300832	新产业	203,592.00	2.18
67	002532	天山铝业	201,418.00	2.16
68	300699	光威复材	199,712.00	2.14
69	000591	太阳能	198,946.00	2.13
70	002025	航天电器	198,563.00	2.13
71	002673	西部证券	197,181.00	2.11
72	002056	横店东磁	193,382.00	2.07
73	300088	长信科技	193,295.00	2.07
74	002372	伟星新材	192,992.92	2.07
75	002463	沪电股份	192,968.00	2.07
76	002131	利欧股份	190,808.00	2.04
77	000066	中国长城	190,344.00	2.04
78	300244	迪安诊断	189,446.00	2.03
79	000703	恒逸石化	188,007.00	2.01

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300418	昆仑万维	220,925.00	2.37

2	300308	中际旭创	211,048.00	2.26
3	002603	以岭药业	209,613.00	2.25
4	002384	东山精密	186,576.00	2.00
5	002850	科达利	185,239.00	1.98
6	002340	格林美	179,604.00	1.92
7	002422	科伦药业	167,204.00	1.79
8	300003	乐普医疗	165,648.00	1.77
9	300012	华测检测	163,824.00	1.76
10	300168	万达信息	159,066.00	1.70
11	000999	华润三九	156,583.00	1.68
12	300724	捷佳伟创	153,905.00	1.65
13	300474	景嘉微	146,446.00	1.57
14	300037	新宙邦	139,133.00	1.49
15	603345	安井食品	137,700.00	1.48
16	002624	完美世界	134,565.00	1.44
17	000807	云铝股份	132,694.00	1.42
18	300058	蓝色光标	130,709.00	1.40
19	002966	苏州银行	130,404.20	1.40
20	603605	珀莱雅	130,124.00	1.39

注：本项"卖出金额"均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	41,010,339.79
卖出股票收入（成交）总额	17,742,427.02

注：本项"买入股票的成本（成交）总额"和"卖出股票的收入（成交）总额"均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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)	2,743.37	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,743.37	0.00

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	113063	赛轮转债	20	2,743.37	0.00

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包含国债期货

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金投资范围不包含国债期货

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券发行主体中，2023年3月26日，昆仑万维因未依法履行其他职责收到来自深圳交易所的监管函。

本基金为指数型基金，上述股票系标的指数成分股，投资决策程序符合公司投资制度的规定。

7.12.2 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。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	15,646.77
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,646.77

### 7.12.4 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	113063	赛轮转债	2,743.37	0.00

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
454	133,393.35	50,170,000.00	82.8427%	10,390,583.00	17.1573%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中国银行股份有限公司-兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	50,000,000.00	82.56%
2	许安澜	1,100,000.00	1.82%
3	许梅蓉	1,060,000.00	1.75%
4	陈建仁	1,027,400.00	1.70%
5	高芸	500,000.00	0.83%
6	杨儒超	293,000.00	0.48%
7	安景文	200,000.00	0.33%
8	陈伟君	200,000.00	0.33%
9	蒋慧	200,000.00	0.33%
10	李仁豪	199,400.00	0.33%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	0.00	0.00%

### 8.4 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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年06月30日)基金份额总额	218,060,583.00
本报告期期初基金份额总额	10,560,583.00
本报告期基金总申购份额	85,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	35,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	60,560,583.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、2023年4月17日，官恒秋先生离任兴业基金管理有限公司董事长、法定代表人，由叶文煌先生担任公司董事长、法定代表人。详见本公司于2023年4月19日发布的《兴业基金管理有限公司关于董事长变更的公告》。

2、2023年6月9日，胡斌先生离任兴业基金管理有限公司总经理，由董事长叶文煌先生代任公司总经理职务。详见本公司于2023年6月10日发布的《兴业基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。

3、本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、本基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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	
安信证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	41,937,134.19	71.38%	30,669.31	71.38%	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	16,815,632.62	28.62%	12,297.29	28.62%	-
华安	2	-	-	-	-	-



证券						
华创 证券	2	-	-	-	-	-
天风 证券	2	-	-	-	-	-
兴业 证券	2	-	-	-	-	-
中泰 证券	2	-	-	-	-	-
太平 洋证 券	4	-	-	-	-	-

①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

- i 资历雄厚，信誉良好，注册资本不少于3 亿元人民币。
- ii 财务状况良好，经营行为规范，最近一年未因发生重大违规行为而受到有关管理机关处罚。
- iii 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需  
要，并能为本基金提供全面的信息服务。
- iv 投研交综合实力较强。
- v 其他因素(综合能力一般，但在某些特色领域或行业，研究能力、深度和质量在行业  
领先)。

②券商专用交易单元选择程序：

- i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估  
本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和  
研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。
- ii 协议签署及通知托管人  
本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③在上述租用的券商交易单元中，本期无新增交易单元，无剔除交易单元。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	兴业中证500交易型开放式 指数证券投资基金2022年第 4季度报告	中国证监会规定的媒介	2023-01-20

2	兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）（2023年第1号）	中国证监会规定的媒介	2023-03-03
3	兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金2022年年度报告	中国证监会规定的媒介	2023-03-31
4	兴业基金管理有限公司关于董事长变更的公告	中国证监会规定的媒介	2023-04-19
5	兴业基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金风险评价结果的通知	中国证监会规定的媒介	2023-04-20
6	兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金2023年第一季度报告	中国证监会规定的媒介	2023-04-21
7	兴业基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会规定的媒介	2023-06-10
8	兴业基金管理有限公司关于提醒投资者谨防金融诈骗活动的特别提示公告	中国证监会规定的媒介	2023-06-29

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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	1	20230324-20230426	0.00	45,146,000.00	45,076,000.00	70,000.00	0.12%
	2	20230324-20230402	0.00	22,547,400.00	22,547,400.00	0.00	0.00%
联接基金	1	20230417-20230630	0.00	50,000,000.00	0.00	50,000,000.00	82.56%

#### 产品特有风险

本基金本报告期出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。如果该类投资者集中赎回，可能会对本基金造成流动性压力；同时，该等集中赎回将可能产生（1）份额净值尾差风险；（2）基金净值波动的风险；（3）因引发基金本身的巨额赎回而导致中小投资者无法及时赎回的风险；（4）因基金资产净值低于5000万元从而影响投资目标实现或造成基金终止

等风险。管理人将在基金运作中保持合适的流动性水平，并对申购赎回进行合理的应对，加强防范流动性风险，保护持有人利益。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- （一）中国证监会准予兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件
- （二）《兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- （三）《兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- （四）法律意见书
- （五）基金管理人业务资格批件和营业执照
- （六）基金托管人业务资格批件和营业执照
- （七）中国证监会要求的其他文件

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的住所

### 12.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅。

网站：<http://www.cib-fund.com.cn>

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人兴业基金管理有限公司。

客户服务中心电话 4000095561

兴业基金管理有限公司  
二〇二三年八月三十一日