兴业中证500指数增强型证券投资基金

2026年第2季度报告

2026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:国泰海通证券股份有限公司

报告送出日期:2026年07月21日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人国泰海通证券股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年07月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年04月01日起至06月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	兴业中证500指数增强
基金主代码	015507
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年06月07日
报告期末基金份额总额	313,230,684.58份
投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。本基金力求控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年化跟踪误差不超过7.75%。
投资策略	本基金为股票指数增强型基金，在标的指数成份股权重的基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。 主要投资策略为大类资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略。
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+银行活期存款税后利率

	×5%	
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金，具有与标的指数以及标的指数所代表的组合相似的风险收益特征。	
基金管理人	兴业基金管理有限公司	
基金托管人	国泰海通证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	兴业中证500指数增强A	兴业中证500指数增强C
下属分级基金的交易代码	015507	015508
报告期末下属分级基金的份额总额	95,375,130.47份	217,855,554.11份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2026年04月01日 - 2026年06月30日)	
	兴业中证500指数增强A	兴业中证500指数增强C
1.本期已实现收益	9,294,594.09	25,731,852.22
2.本期利润	22,299,766.85	64,191,427.01
3.加权平均基金份额本期利润	0.2127	0.2072
4.期末基金资产净值	151,417,044.80	341,701,315.89
5.期末基金份额净值	1.5876	1.5685

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。

3.2 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

兴业中证500指数增强A净值表现

阶段	净值增长率①	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	①-③	②-④

				④		
过去三个月	15.45%	1.54%	17.61%	1.56%	-2.16%	-0.02%
过去六个月	17.79%	1.51%	19.93%	1.58%	-2.14%	-0.07%
过去一年	49.60%	1.29%	49.68%	1.35%	-0.08%	-0.06%
过去三年	64.59%	1.33%	48.15%	1.41%	16.44%	-0.08%
自基金合同生效起至今	58.76%	1.22%	43.96%	1.30%	14.80%	-0.08%

兴业中证500指数增强C净值表现

阶段	净值增长率①	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	15.36%	1.54%	17.61%	1.56%	-2.25%	-0.02%
过去六个月	17.62%	1.51%	19.93%	1.58%	-2.31%	-0.07%
过去一年	49.15%	1.29%	49.68%	1.35%	-0.53%	-0.06%
过去三年	63.13%	1.33%	48.15%	1.41%	14.98%	-0.08%
自基金合同生效起至今	56.85%	1.22%	43.96%	1.30%	12.89%	-0.08%

本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业	说明

		任职日期	离任日期	年限	
楼华锋	基金经理	2022-06-07	-	16年	中国籍，上海交通大学通信与信息系统专业硕士学历，具有证券投资基金从业资格。曾就职于东方证券研究所担任金工分析师、光大证券信用业务部担任高级经理、方正证券研究所担任金融工程高级分析师；曾任银河基金管理有限公司量化与指数工作室负责人。2021年6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《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法律法规、基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内，本基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金是指数增强基金，在日常运作阶段本基金以追求相对指数的超额收益为主要投资目标，组合配置目前以多因子模型为基础，辅以事件驱动的子策略获取超额收益，因子配置上各类因子配置较为分散，根据因子历史绩效水平确定权重，组合相对基准的预期跟踪误差5%左右，目前组合风格配置较为均衡，成长价值，大小盘均无显著暴露。二季度市场出现了K型分化，成长价值分化之下，均衡配置的组合获取超额的难度增加，适度增加了成长风格。展望三季度，市场风格有望从“极致分化”走向“动态平衡”。随着科技板块拥挤度攀升至历史高位，获利回吐压力增大，资金存在高低切换需求，但是对于科技成长中期市场仍然看好，市场有望走向“动态均衡”。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴业中证500指数增强A基金份额净值为1.5876元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为15.45%，同期业绩比较基准收益率为17.61%；截至报告期末兴业中证500指数增强C基金份额净值为1.5685元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为15.36%，同期业绩比较基准收益率为17.61%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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或者基金资产净值低于五千万的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	416,802,830.72	83.60
	其中：股票	416,802,830.72	83.60
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	27,275,659.97	5.47
	其中：债券	27,275,659.97	5.47
	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	48,343,642.44	9.70

	计		
8	其他资产	6,172,228.32	1.24
9	合计	498,594,361.45	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	18,912,819.00	3.84
C	制造业	281,183,521.07	57.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,323,303.00	0.88
E	建筑业	1,132,076.00	0.23
F	批发和零售业	2,910,000.00	0.59
G	交通运输、仓储和邮政业	3,475,472.00	0.70
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,472,873.00	4.96
J	金融业	17,081,051.00	3.46
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	10,398,127.00	2.11
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	363,889,242.07	73.79

5.2.2 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	36,149.82	0.01
C	制造业	44,149,859.36	8.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	240,345.03	0.05
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,651,207.00	1.15
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	2,443.98	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	2,832,000.00	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	52,913,588.65	10.73

5.3 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

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

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	300604	长川科技	21,800	7,442,956.00	1.51
2	002281	光迅科技	24,900	6,397,806.00	1.30

3	300857	协创数据	18,300	6,220,170.00	1.26
4	002273	水晶光电	150,900	5,353,932.00	1.09
5	300054	鼎龙股份	50,200	5,319,694.00	1.08
6	002436	兴森科技	103,300	5,263,135.00	1.07
7	600498	烽火通信	71,100	5,232,960.00	1.06
8	300223	北京君正	20,300	5,052,670.00	1.02
9	300346	南大光电	53,700	4,975,305.00	1.01
10	300567	精测电子	15,600	4,954,560.00	1.00

5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	000933	神火股份	188,500	3,996,200.00	0.81
2	002484	江海股份	30,100	3,160,500.00	0.64
3	600487	亨通光电	28,100	3,072,454.00	0.62
4	688208	道通科技	117,500	2,959,825.00	0.60
5	603990	麦迪科技	138,200	2,942,278.00	0.60

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	27,275,659.97	5.53
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	27,275,659.97	5.53

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	019827	26国债01	271,000	27,275,659.97	5.53

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动（元）	风险说明
IC2609	IC2609	2	3,504,560.00	387,240.00	-
IM2607	IM2607	15	26,068,800.00	696,200.00	-
IM2608	IM2608	2	3,434,160.00	54,920.00	-
IM2609	IM2609	5	8,485,000.00	835,240.00	-
公允价值变动总额合计（元）					1,973,600.00
股指期货投资本期收益（元）					3,997,924.19
股指期货投资本期公允价值变动（元）					4,348,120.00

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

以套期保值为目的配置股指期货，当期货价格相对现货贴水幅度较大时增加期货多头套保额度，当期货价格相对现货贴水幅度减少时，减少期货多头套保额度。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货，根据风险管理的原则，充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期未参与国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未参与国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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。

5.11.2 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

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,979,102.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,193,125.92
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	6,172,228.32

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 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无流通受限。

5.11.5.2 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

	兴业中证500指数增强A	兴业中证500指数增强C

报告期期初基金份额总额	112,976,414.70	376,212,275.69
报告期期间基金总申购份额	7,133,576.05	78,474,757.62
减：报告期期间基金总赎回份额	24,734,860.28	236,831,479.20
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	95,375,130.47	217,855,554.11

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

	兴业中证500指数增强A	兴业中证500指数增强C
报告期期初管理人持有的本基金份额	8,131,777.53	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	8,131,777.53	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	-	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	-	-

注：申购份额包括红利再投、转换入份额、因份额拆分而增加的份额；赎回份额包括转换出份额、因份额合并而减少的份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	转换出	2026-05-06	-8,131,777.53	-11,991,932.32	0
合计			-8,131,777.53	-11,991,932.32	

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

（一）中国证监会准予兴业中证500指数增强型证券投资基金募集注册的文件

（二）《兴业中证500指数增强型证券投资基金基金合同》

（三）《兴业中证500指数增强型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

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的住所

9.3 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

2026年07月21日