兴业沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

2026 年中期报告

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:中信银行股份有限公司

送出日期:2026 年 08 月 29 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年08月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年01月01日起至06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 6
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 9
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 11
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的真实、准确和完整发表意见 12
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 13
6.1 资产负债表 13
6.2 利润表 14
6.3 净资产变动表 16
6.4 报表附注 18
§7 投资组合报告 37
7.1 期末基金资产组合情况 37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 50
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 50
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 50
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 50
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 51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 51
7.12 投资组合报告附注 51
§8 基金份额持有人信息 52

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 53
§9 开放式基金份额变动 53
§10 重大事件揭示 53
10.1 基金份额持有人大会决议 53
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 53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 54
10.4 基金投资策略的改变 54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 54
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 54
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 54
10.8 其他重大事件 55
§11 影响投资者决策的其他重要信息 57
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 57
§12 备查文件目录 57
12.1 备查文件目录 57
12.2 存放地点 58
12.3 查阅方式 58

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴业沪深300交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	兴业沪深300ETF（证券简称：兴业300；扩位证券简称：沪深300ETF兴业）
场内简称	兴业300（扩位证券简称：沪深300ETF兴业）
基金主代码	510370
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020年09月11日
基金管理人	兴业基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	78,258,111.00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10月27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、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。
业绩比较基准	沪深300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	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张顺国	滕菲菲
	联系电话	021-22211888	4006800000
	电子邮箱	zhaoyue@cib-fund.com.cn	tengfeifei@citicbank.com
客户服务电话		40000-95561	95558
传真		021-22211997	010-85230024
注册地址		福建省福州市鼓楼区湖东路154号中山大厦A座5层507室	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
办公地址		上海市浦东新区银城路167号13、14层	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
邮政编码		200120	100020
法定代表人		刘宗治	方合英

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.cib-fund.com.cn
基金中期报告置备地点	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 （2026年01月01日- 2026年06月30日）
本期已实现收益	4,791,324.04
本期利润	7,403,190.37
加权平均基金份额本期利润	0.0838
本期加权平均净值利润率	7.95%
本期基金份额净值增长率	7.83%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 （2026年06月30日）
期末可供分配利润	8,835,424.65
期末可供分配基金份额利润	0.1129
期末基金资产净值	87,093,535.65
期末基金份额净值	1.1129
3.1.3 累计期末指标	报告期末 （2026年06月30日）
基金份额累计净值增长率	11.29%

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	12.46%	1.24%	11.90%	1.26%	0.56%	-0.02%
过去六个月	7.83%	1.12%	7.55%	1.13%	0.28%	-0.01%
过去一年	27.36%	1.01%	26.51%	1.02%	0.85%	-0.01%
过去三年	34.95%	1.08%	29.59%	1.11%	5.36%	-0.03%
过去五年	1.13%	1.09%	-4.68%	1.12%	5.81%	-0.03%
自基金合同生效起至今	11.29%	1.09%	8.67%	1.13%	2.62%	-0.04%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深300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，是兴业银行控股下的全国性基金管理公司。公司注册资本人民币12亿元，其中，兴业银行股份有限公司出资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%。公司业务范围主要包括基金募集、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。2015年兴业基金成功核准获批QDII资格；2017年2月，兴业基金获批受托管理保险资金资格。目前，兴业基金已设立了北京、上海、深圳、福州四个分公司，并设立基金子公司-兴业财富资产管理有限公司。截至2026年6月30日，兴业基金共管理128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		
张诗悦	基金经理	2024-06-21	-	10年	中国籍，硕士学位，具有证券投资基金从业资格。2015年7月加入兴业基金管理有限公司，现任基金经理。
徐成城	多元业务部/指数与量化业务部总经理助理、基金经理	2025-05-22	-	22年	中国籍，硕士学位，具有证券投资基金从业资格。曾就职于闽发证券有限责任公司、国泰基金管理有限公司，历任交易员、基金经理助理、基金经理。2023年11月加入兴业基金管理有限公司，现任多元业务部/指数与量化业务部总经理助理、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 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

2026年上半年，市场正常表现较好，中证全指的涨幅为10.69%，分市值来看，中盘指数表现最为突出，沪深300、中证500、中证1000和中证2000的涨跌幅分别为7.55%、20.97%、15.99%、9.10%。从风格来看，市场分化较为强烈，科创50和创业板指的涨幅分别为64.25%，35.58%，而中证红利指数的涨跌幅为-8.75%。

伴随着中国经济结构转型和科技行业的发展，宽基的行业权重分布也发生了较大变化。截至6月末，沪深300的前三大行业为电子、通信和银行，占比分别为23.7%、10.5%和9.5%，对比25年末，电子行业的权重提升约10%，通信的权重提升约4%。相比于2020年，沪深300的主要权重行业为非银金融、银行和食品饮料，宽基背后的资产已经发生了重大的结构性变化。

从估值的角度看，当前沪深300的PE-TTM分位数为14.5，加权PE-TTM为70。站在当前，我们看到科技成长的叙事仍在延续，市场热度仍在高位，高收益下的高波动也将给投资者带来更大的挑战。站在大类资产配置的角度看，A股的长期投资属性仍在，宽基指数也在跟随市场的变化调整其内涵，有望成为投资者长期投资的工具。

沪深 300 指数由沪深市场中规模大、流动性好的最具代表性的300 只证券组成，可以反映沪深市场头部上市公司证券的整体表现，金融、制造与科技、消费医药等行业贡献较为均衡，和经济的相关性较强。

本基金为指数型基金，基金管理人将继续按照基金合同的要求，坚持指数化投资策略，拟合指数收益表现，在确保基金产品平稳运行的前提下，努力将基金的跟踪误差控制在较低水平，以达成投资人的投资目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴业沪深300ETF（证券简称：兴业300；扩位证券简称：沪深300ETF兴业）基金份额净值为1.1129元，本报告期内，基金份额净值增长率为7.83%，同期业绩比较基准收益率为7.55%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场上半年的演绎较为分化，7月份市场进行了一次再平衡，红利类资产有所修复，科技成长类资产有所回落。展望后市，我们认为市场仍处在上行的通道中，中国科技、制造等领域的优势仍在强化，科技成长的叙事需要等待产业的突破带动，科技对经济发展的带动值得期待。同时，红利价值类资产作为市场的基本盘，持续带来稳定的回报，起到了稳定器的作用,提升了A股市场的配置价值。宽基指数伴随着市场的演绎，行业配置也在同步调整，有望更好的帮助投资者配置市场。

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

1）每一基金份额享有同等分配权；

2）本基金收益分配方式为现金分红；

3）当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到1%以上时，可进行收益分配；

4）本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；

5）若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；

6）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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或者基金资产净值低于五千万的情形。

§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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对兴业沪深300交易型开放式指数证券投资基金报告期的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，兴业基金管理有限公司在兴业沪深300交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，兴业基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的报告期内的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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：兴业沪深300交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	1,040,321.05	3,236,642.16
结算备付金		38,152.59	60,233.17
存出保证金		29,256.11	64,731.23
交易性金融资产	6.4.7.2	86,449,927.18	116,496,880.00
其中：股票投资		86,449,927.18	116,496,880.00
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	13,001,970.60
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		87,557,656.93	132,860,457.16
负债和净资产	**附注号**	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
负 债：			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		339,930.87	14,708,115.17
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		35,623.08	51,808.45
应付托管费		7,124.63	10,361.72
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	81,442.70	165,549.29
负债合计		464,121.28	14,935,834.63
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	78,258,111.00	114,258,111.00
未分配利润	6.4.7.8	8,835,424.65	3,666,511.53
净资产合计		87,093,535.65	117,924,622.53
负债和净资产总计		87,557,656.93	132,860,457.16

注：报告截止日2026年06月30日，基金份额净值1.1129元，基金份额总额78,258,111.00份。

6.2 利润表

会计主体：兴业沪深300交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
一、营业总收入		7,757,605.35	1,484,290.06

1.利息收入		512.12	574.24
其中：存款利息收入	6.4.7.9	512.12	574.24
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）		5,119,307.26	2,126,717.20
其中：股票投资收益	6.4.7.10	4,281,486.67	684,900.81
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	837,820.59	1,441,816.39
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	2,611,866.33	-650,606.96
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	25,919.64	7,605.58
减：二、营业总支出		354,414.98	445,973.06
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	231,190.47	281,053.84
2.托管费	6.4.10.2.2	46,238.05	56,210.79
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	76,986.46	108,708.43
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,403,190.37	1,038,317.00
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,403,190.37	1,038,317.00
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		7,403,190.37	1,038,317.00

6.3 净资产变动表

会计主体：兴业沪深300交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	114,258,111.00	3,666,511.53	117,924,622.53
二、本期期初净资产	114,258,111.00	3,666,511.53	117,924,622.53
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-36,000,000.00	5,168,913.12	-30,831,086.88
（一）、综合收益总额	-	7,403,190.37	7,403,190.37
（二）、本期基金份额交易产生的净	-36,000,000.00	-2,234,277.25	-38,234,277.25

资产变动数（净资产减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	6,000,000.00	449,372.32	6,449,372.32
2.基金赎回款	-42,000,000.00	-2,683,649.57	-44,683,649.57
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	78,258,111.00	8,835,424.65	87,093,535.65
项 目	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	138,258,111.00	-18,394,243.54	119,863,867.46
二、本期期初净资产	138,258,111.00	-18,394,243.54	119,863,867.46
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-18,000,000.00	3,219,915.81	-14,780,084.19
（一）、综合收益总额	-	1,038,317.00	1,038,317.00
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-18,000,000.00	2,181,598.81	-15,818,401.19
其中：1.基金申购款	9,000,000.00	-1,452,985.22	7,547,014.78
2.基金赎回款	-27,000,000.00	3,634,584.03	-23,365,415.97

（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	120,258,111.00	-15,174,327.73	105,083,783.27

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:

刘宗治	蒲延杰	楼怡斐
_____	_____	_____
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

兴业沪深300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》、《兴业沪深300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[2020]773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216,258,111.00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2000593号验资报告。《兴业沪深300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9月11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，基金托管人为中信银行股份有限公司。

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《兴业沪深300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，即沪深300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”)、中国证监会发布的关于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2026年06月30日的财务状况以及2026年01月01日至2026年06月30日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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》、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[2021]33号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2024]8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税

政策的公告》、国务院令第826号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》、财税[2026]12号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)自2026年1月1日至2027年12月31日，公开募集证券投资基金管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，可以选择适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对公募证券投资基金(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、债券取得的收入以及金融同业往来利息收入免征增值税。

(2)对证券投资基金取得的自2025年8月8日之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税；取得的在2025年8月8日之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在2025年8月8日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

(3)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，暂不征收企业所得税。

(4)对证券投资基金取得的股票股息红利所得，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。其中，对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股，解禁后取得的股息红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(5)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；自2023年8月28日起，出让方减按0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。

(6)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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日

活期存款	1,040,321.05
等于：本金	1,040,307.81
加：应计利息	13.24
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	1,040,321.05

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		76,322,206.80	-	86,449,927.18	10,127,720.38
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-

合计	76,322,206.80	-	86,449,927.18	10,127,720.38

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 2026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	4,579.24
其中：交易所市场	4,579.24
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	76,863.46
合计	81,442.70

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	114,258,111.00	114,258,111.00
本期申购	6,000,000.00	6,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-42,000,000.00	-42,000,000.00
本期末	78,258,111.00	78,258,111.00

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
上年度末	32,334,464.83	-28,667,953.30	3,666,511.53
本期期初	32,334,464.83	-28,667,953.30	3,666,511.53
本期利润	4,791,324.04	2,611,866.33	7,403,190.37
本期基金份额交易产生的变动数	-10,870,450.85	8,636,173.60	-2,234,277.25
其中：基金申购款	1,946,855.82	-1,497,483.50	449,372.32
基金赎回款	-12,817,306.67	10,133,657.10	-2,683,649.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	26,255,338.02	-17,419,913.37	8,835,424.65

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
活期存款利息收入	313.42
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	106.39
其他	92.31
合计	512.12

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 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	2,564,402.22
股票投资收益——赎回差价收入	1,717,084.45
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	4,281,486.67

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 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出股票成交总额	25,611,441.47
减：卖出股票成本总额	23,024,416.98
减：交易费用	22,622.27
买卖股票差价收入	2,564,402.22

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 2026年01月01日至2026年06月30日
赎回基金份额对价总额	44,683,649.57
减：现金支付赎回款总额	18,036,099.57
减：赎回股票成本总额	24,930,465.55
减：交易费用	-
赎回差价收入	1,717,084.45

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

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

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	837,820.59
基金投资产生的股利收益	-
合计	837,820.59

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
1.交易性金融资产	2,611,866.33
——股票投资	2,611,866.33
——债券投资	-
——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	2,611,866.33

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期

	2026年01月01日至2026年06月30日
基金赎回费收入	-
ETF基金替代损益	25,919.64
合计	25,919.64

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期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 2026年01月01日至2026年06月30日
审计费用	17,356.09
信息披露费	59,507.37
汇划手续费	123.00
合计	76,986.46

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、关联关系

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

本报告期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
中信银行股份有限公司(以下简称"中信银行")	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
兴业沪深300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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期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 2026年01月01日至2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	231,190.47	281,053.84
其中：应支付销售机构的客户维护费	12,335.45	4,513.47

应支付基金管理人的净管理费	218,855.02	276,540.37

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的0.50%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 2026年01月01日至2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	46,238.05	56,210.79

注：支付基金托管人中信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 2026年06月30日		上年度末 2025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
兴业沪深	45,803,900.00	58.53%	69,584,800.00	60.90%

300交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金				

注：关联方投资本基金采用公允费率，即按照基金法律文件条款执行。

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 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025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
中信银行股份有限公司	1,040,321.05	313.42	1,777,795.04	476.06

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中信银行保管，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

本报告期末，本基金持有基金管理人的股东发行的股票兴业银行(601166.SH)51,500股，占本基金资产净值的0.98%(上年度末：76,900股，占本基金资产净值的1.37%)；本报告期末，本基金持有基金托管人发行的股票中信银行(601998.SH)16,100股，占本基金资产净值的0.13%(上年度末：25,800股，占本基金资产净值的0.17%)。

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（2026年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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
688072	拓荆科技	2026-06-29	-	832.00	2026-07-13	890.99	600	404,466.14	499,200.00	-

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市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.13 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工作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公司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。

除国债、央行票据、政策性金融债外，本基金报告期末及上年度末未持有按信用评级列示的债券。

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，按照穿透原则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2026年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,040,321.05	-	-	-	1,040,321.05
结算备付金	38,152.59	-	-	-	38,152.59
存出保	29,256.11	-	-	-	29,256.11

证金					
交易性金融资产	-	-	-	86,449,927.18	86,449,927.18
资产总计	1,107,729.75	-	-	86,449,927.18	87,557,656.93
负债					
应付清算款	-	-	-	339,930.87	339,930.87
应付管理人报酬	-	-	-	35,623.08	35,623.08
应付托管费	-	-	-	7,124.63	7,124.63
其他负债	-	-	-	81,442.70	81,442.70
负债总计	-	-	-	464,121.28	464,121.28
利率敏感度缺口	1,107,729.75	-	-	85,985,805.90	87,093,535.65
上年度末2025年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,236,642.16	-	-	-	3,236,642.16
结算备付金	60,233.17	-	-	-	60,233.17
存出保证金	64,731.23	-	-	-	64,731.23
交易性金融资产	-	-	-	116,496,880.00	116,496,880.00
应收清	-	-	-	13,001,970.60	13,001,970.60

算款					
资产总计	3,361,606.56	-	-	129,498,850.60	132,860,457.16
负债					
应付清算款	-	-	-	14,708,115.17	14,708,115.17
应付管理人报酬	-	-	-	51,808.45	51,808.45
应付托管费	-	-	-	10,361.72	10,361.72
其他负债	-	-	-	165,549.29	165,549.29
负债总计	-	-	-	14,935,834.63	14,935,834.63
利率敏感度缺口	3,361,606.56	-	-	114,563,015.97	117,924,622.53

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

本基金本报告期末及上年度末未持有债券投资及资产支持证券，因此市场利率变动而导致的利率敏感性资产的公允价值变动对基金资产净值的影响不重大。

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 2026年06月30日		上年度末 2025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	86,449,927.18	99.26	116,496,880.00	98.79
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	86,449,927.18	99.26	116,496,880.00	98.79

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	上年度末

		2026年06月30日	2025年12月31日
	股票价格上升5%	4,322,496.36	5,824,945.95
	股票价格下降5%	-4,322,496.36	-5,824,945.95

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

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	85,950,727.18	115,598,994.20
第二层次	499,200.00	897,885.80
第三层次	-	-
合计	86,449,927.18	116,496,880.00

6.4.14.2.2 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	86,449,927.18	98.73
	其中：股票	86,449,927.18	98.73
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,078,473.64	1.23
8	其他各项资产	29,256.11	0.03
9	合计	87,557,656.93	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	490,700.80	0.56
B	采矿业	3,623,442.00	4.16
C	制造业	55,286,905.32	63.48

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,142,988.00	2.46
E	建筑业	990,481.80	1.14
F	批发和零售业	131,096.00	0.15
G	交通运输、仓储和邮政业	2,086,200.80	2.40
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,762,388.65	5.47
J	金融业	15,162,493.21	17.41
K	房地产业	279,275.12	0.32
L	租赁和商务服务业	396,950.00	0.46
M	科学研究和技术服务业	933,825.00	1.07
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	114,384.48	0.13
R	文化、体育和娱乐业	48,796.00	0.06
S	综合	-	-
	合计	86,449,927.18	99.26

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	3,400	4,318,000.00	4.96

2	300750	宁德时代	8,119	3,190,848.19	3.66
3	300502	新易盛	4,308	2,614,956.00	3.00
4	600519	贵州茅台	1,900	2,252,431.00	2.59
5	688256	寒武纪	1,047	1,670,540.85	1.92
6	603986	兆易创新	2,020	1,646,300.00	1.89
7	601318	中国平安	32,800	1,565,872.00	1.80
8	600036	招商银行	37,600	1,334,800.00	1.53
9	601899	紫金矿业	50,200	1,262,028.00	1.45
10	002371	北方华创	1,300	1,149,928.00	1.32
11	000333	美的集团	15,100	1,140,503.00	1.31
12	688008	澜起科技	3,500	1,084,650.00	1.25
13	002475	立讯精密	15,400	1,084,160.00	1.24
14	688041	海光信息	2,900	1,073,870.00	1.23
15	688012	中微公司	2,286	1,070,991.00	1.23
16	002384	东山精密	4,000	1,049,400.00	1.20
17	688981	中芯国际	6,300	1,000,566.00	1.15
18	600900	长江电力	37,300	987,331.00	1.13
19	000725	京东方 A	110,500	959,140.00	1.10
20	603259	药明康德	7,500	933,825.00	1.07
21	601138	工业富联	12,000	865,800.00	0.99
22	600030	中信证券	29,905	859,170.65	0.99
23	601166	兴业银行	51,500	852,840.00	0.98
24	300059	东方财富	38,535	785,343.30	0.90
25	600183	生益科技	4,400	762,960.00	0.88
26	300274	阳光电源	4,520	718,770.40	0.83
27	600276	恒瑞医药	13,600	707,744.00	0.81
28	601398	工商银行	98,400	695,688.00	0.80
29	300408	三环集团	4,100	684,290.00	0.79
30	002594	比亚迪	8,300	661,510.00	0.76
31	300476	胜宏科技	1,900	658,217.00	0.76
32	002463	沪电股份	4,200	641,760.00	0.74

33	601211	国泰海通	34,854	634,342.80	0.73
34	300394	天孚通信	1,944	588,409.92	0.68
35	000988	华工科技	3,100	572,291.00	0.66
36	301308	江波龙	800	563,040.00	0.65
37	600176	中国巨石	7,359	536,323.92	0.62
38	601288	农业银行	87,400	530,518.00	0.61
39	601328	交通银行	82,500	530,475.00	0.61
40	600522	中天科技	8,500	515,780.00	0.59
41	000651	格力电器	13,700	513,750.00	0.59
42	688072	拓荆科技	600	499,200.00	0.57
43	600919	江苏银行	45,740	493,077.20	0.57
44	688521	芯原股份	1,300	482,482.00	0.55
45	600150	中国船舶	13,986	472,586.94	0.54
46	603019	中科曙光	4,400	471,812.00	0.54
47	603993	洛阳钼业	26,600	466,830.00	0.54
48	600887	伊利股份	19,300	462,428.00	0.53
49	600584	长电科技	4,400	455,620.00	0.52
50	000338	潍柴动力	16,400	446,900.00	0.51
51	000858	五粮液	5,900	436,600.00	0.50
52	601816	京沪高铁	89,200	404,076.00	0.46
53	600309	万华化学	5,700	389,937.00	0.45
54	002415	海康威视	11,200	383,040.00	0.44
55	300124	汇川技术	5,750	381,397.50	0.44
56	000100	TCL科技	65,310	380,104.20	0.44
57	600111	北方稀土	7,700	369,985.00	0.42
58	601688	华泰证券	17,800	367,036.00	0.42
59	002916	深南电路	800	366,320.00	0.42
60	000063	中兴通讯	9,800	354,662.00	0.41
61	600089	特变电工	15,400	346,500.00	0.40
62	600000	浦发银行	40,100	345,261.00	0.40
63	601857	中国石油	39,200	340,256.00	0.39

64	601088	中国神华	8,600	335,744.00	0.39
65	300433	蓝思科技	6,200	332,692.00	0.38
66	002028	思源电气	1,900	328,700.00	0.38
67	600031	三一重工	18,300	316,224.00	0.36
68	002142	宁波银行	10,310	306,103.90	0.35
69	601601	中国太保	10,700	305,164.00	0.35
70	002050	三花智控	6,900	302,427.00	0.35
71	300014	亿纬锂能	4,600	299,138.00	0.34
72	000792	盐湖股份	9,900	298,881.00	0.34
73	000001	平安银行	29,600	297,480.00	0.34
74	002714	牧原股份	8,320	291,116.80	0.33
75	600549	厦门钨业	3,400	289,680.00	0.33
76	600406	国电南瑞	12,415	283,682.75	0.33
77	002353	杰瑞股份	1,800	274,500.00	0.32
78	601668	中国建筑	62,800	272,552.00	0.31
79	000657	中钨高新	2,800	268,016.00	0.31
80	601229	上海银行	30,800	267,344.00	0.31
81	601939	建设银行	26,300	253,269.00	0.29
82	601919	中远海控	19,080	253,000.80	0.29
83	002602	世纪华通	17,900	252,390.00	0.29
84	600660	福耀玻璃	5,000	252,200.00	0.29
85	601728	中国电信	48,200	250,158.00	0.29
86	603501	豪威集团	2,605	247,084.25	0.28
87	601988	中国银行	42,900	245,388.00	0.28
88	002230	科大讯飞	6,000	245,040.00	0.28
89	600999	招商证券	11,600	244,760.00	0.28
90	300760	迈瑞医疗	1,800	244,494.00	0.28
91	601012	隆基绿能	18,460	242,195.20	0.28
92	601225	陕西煤业	11,800	240,130.00	0.28
93	600016	民生银行	74,200	238,924.00	0.27
94	600941	中国移动	2,700	232,551.00	0.27

95	603799	华友钴业	4,750	229,235.00	0.26
96	002352	顺丰控股	7,300	228,198.00	0.26
97	600690	海尔智家	11,100	226,551.00	0.26
98	002460	赣锋锂业	3,460	226,284.00	0.26
99	601985	中国核电	25,000	225,750.00	0.26
100	600926	杭州银行	15,400	222,530.00	0.26
101	002709	天赐材料	4,300	221,149.00	0.25
102	601169	北京银行	45,100	220,990.00	0.25
103	000776	广发证券	9,300	217,620.00	0.25
104	600160	巨化股份	4,100	217,341.00	0.25
105	000977	浪潮信息	3,100	217,000.00	0.25
106	300033	同花顺	900	216,900.00	0.25
107	002938	鹏鼎控股	2,000	210,760.00	0.24
108	000425	徐工机械	25,500	206,295.00	0.24
109	600938	中国海油	7,500	203,625.00	0.23
110	688126	沪硅产业	5,094	203,199.66	0.23
111	000938	紫光股份	7,000	202,020.00	0.23
112	600028	中国石化	45,100	201,146.00	0.23
113	002202	金风科技	8,400	200,760.00	0.23
114	300498	温氏股份	16,200	199,584.00	0.23
115	300442	润泽科技	2,400	199,368.00	0.23
116	002600	领益智造	11,400	197,676.00	0.23
117	601600	中国铝业	24,000	197,280.00	0.23
118	600460	士兰微	3,600	196,776.00	0.23
119	002466	天齐锂业	3,200	196,224.00	0.23
120	601766	中国中车	37,600	195,520.00	0.22
121	600050	中国联通	48,600	194,400.00	0.22
122	601009	南京银行	19,200	189,888.00	0.22
123	300661	圣邦股份	1,300	186,524.00	0.21
124	002837	英维克	2,300	182,988.00	0.21
125	601628	中国人寿	5,000	176,750.00	0.20

126	002049	紫光国微	1,980	175,725.00	0.20
127	601872	招商轮船	10,000	175,700.00	0.20
128	002179	中航光电	3,766	173,989.20	0.20
129	601006	大秦铁路	37,600	173,336.00	0.20
130	601100	恒立液压	1,600	172,096.00	0.20
131	601658	邮储银行	34,800	171,564.00	0.20
132	002241	歌尔股份	7,600	171,228.00	0.20
133	000568	泸州老窖	2,200	170,544.00	0.20
134	603288	海天味业	4,951	164,175.16	0.19
135	601818	光大银行	56,200	162,418.00	0.19
136	601888	中国中免	3,000	161,130.00	0.19
137	600905	三峡能源	43,400	161,014.00	0.18
138	600489	中金黄金	8,900	160,645.00	0.18
139	000408	藏格矿业	2,300	159,436.00	0.18
140	605117	德业股份	1,500	159,270.00	0.18
141	688082	盛美上海	367	158,544.00	0.18
142	002625	光启技术	5,200	157,664.00	0.18
143	600893	航发动力	4,100	157,194.00	0.18
144	600809	山西汾酒	1,420	155,305.40	0.18
145	601127	赛力斯	2,500	153,125.00	0.18
146	002027	分众传媒	31,300	151,492.00	0.17
147	600958	东方证券	15,944	150,511.36	0.17
148	601689	拓普集团	2,650	149,513.00	0.17
149	600010	包钢股份	67,000	149,410.00	0.17
150	601336	新华保险	2,500	149,150.00	0.17
151	600118	中国卫星	1,800	147,690.00	0.17
152	688396	华润微	1,500	146,325.00	0.17
153	000630	铜陵有色	23,000	146,280.00	0.17
154	600760	中航沈飞	3,544	145,658.40	0.17
155	600019	宝钢股份	26,500	143,895.00	0.17
156	688271	联影医疗	1,400	141,722.00	0.16

157	601838	成都银行	8,000	141,600.00	0.16
158	600104	上汽集团	14,500	141,520.00	0.16
159	600362	江西铜业	3,200	138,560.00	0.16
160	300450	先导智能	3,400	138,448.00	0.16
161	000807	云铝股份	6,200	137,268.00	0.16
162	601727	上海电气	19,300	135,100.00	0.16
163	002422	科伦药业	3,500	134,820.00	0.15
164	600989	宝丰能源	6,600	134,178.00	0.15
165	600875	东方电气	4,600	132,342.00	0.15
166	601390	中国中铁	31,300	130,521.00	0.15
167	002001	新 和 成	4,584	130,277.28	0.15
168	601995	中金公司	3,600	130,140.00	0.15
169	601377	兴业证券	21,470	129,678.80	0.15
170	600547	山东黄金	5,600	129,304.00	0.15
171	600795	国电电力	27,600	128,892.00	0.15
172	000538	云南白药	2,720	128,846.40	0.15
173	601825	沪农商行	17,000	127,330.00	0.15
174	600585	海螺水泥	7,500	127,125.00	0.15
175	600015	华夏银行	19,700	125,883.00	0.14
176	603296	华勤技术	1,680	124,773.60	0.14
177	601669	中国电建	26,200	123,140.00	0.14
178	688111	金山办公	573	122,077.65	0.14
179	000166	申万宏源	27,600	121,440.00	0.14
180	300316	晶盛机电	2,000	120,800.00	0.14
181	601916	浙商银行	45,800	120,454.00	0.14
182	002648	卫星化学	5,120	120,268.80	0.14
183	688183	生益电子	900	119,160.00	0.14
184	601698	中国卫通	3,900	117,975.00	0.14
185	601066	中信建投	4,000	116,280.00	0.13
186	600482	中国动力	3,500	114,800.00	0.13
187	601868	中国能建	42,900	114,543.00	0.13

188	300015	爱尔眼科	13,848	114,384.48	0.13
189	603893	瑞芯微	600	113,016.00	0.13
190	300418	昆仑万维	2,800	113,008.00	0.13
191	601998	中信银行	16,100	111,573.00	0.13
192	002311	海大集团	2,500	111,525.00	0.13
193	002558	巨人网络	4,000	110,240.00	0.13
194	600066	宇通客车	4,100	109,921.00	0.13
195	600346	恒力石化	6,200	109,802.00	0.13
196	000157	中联重科	15,600	108,732.00	0.12
197	000625	长安汽车	15,082	108,137.94	0.12
198	600426	华鲁恒升	4,500	107,640.00	0.12
199	600221	海航控股	78,200	105,570.00	0.12
200	002532	天山铝业	9,800	105,154.00	0.12
201	600011	华能国际	13,400	101,706.00	0.12
202	300803	指南针	1,100	100,837.00	0.12
203	002236	大华股份	6,100	100,589.00	0.12
204	600115	中国东航	26,400	100,584.00	0.12
205	600048	保利发展	21,700	100,471.00	0.12
206	688036	传音控股	1,700	100,215.00	0.12
207	605499	东鹏饮料	810	99,978.30	0.11
208	688506	百利天恒	340	99,970.20	0.11
209	600886	国投电力	7,500	99,825.00	0.11
210	600570	恒生电子	4,684	99,253.96	0.11
211	601077	渝农商行	16,200	98,982.00	0.11
212	002493	荣盛石化	9,200	98,900.00	0.11
213	600438	通威股份	8,156	98,769.16	0.11
214	600436	片仔癀	900	98,352.00	0.11
215	600188	兖矿能源	5,400	95,958.00	0.11
216	000301	东方盛虹	8,100	92,745.00	0.11
217	601058	赛轮轮胎	8,000	92,240.00	0.11
218	601360	三六零	10,600	92,114.00	0.11

219	002736	国信证券	9,200	91,908.00	0.11
220	002074	国轩高科	3,300	90,783.00	0.10
221	003816	中国广核	23,100	90,321.00	0.10
222	601901	方正证券	12,500	90,000.00	0.10
223	600026	中远海能	5,000	89,700.00	0.10
224	000768	中航西飞	4,300	88,064.00	0.10
225	600009	上海机场	3,800	87,780.00	0.10
226	600196	复星医药	3,900	87,633.00	0.10
227	601788	光大证券	6,000	86,580.00	0.10
228	601111	中国国航	14,200	85,910.00	0.10
229	601186	中国铁建	14,400	85,680.00	0.10
230	600674	川投能源	6,000	85,020.00	0.10
231	000975	山金国际	5,000	85,000.00	0.10
232	600029	南方航空	16,400	84,952.00	0.10
233	600415	小商品城	8,300	84,328.00	0.10
234	601881	中国银河	6,700	84,219.00	0.10
235	601456	国联民生	9,500	83,980.00	0.10
236	601117	中国化学	11,400	83,790.00	0.10
237	301269	华大九天	700	83,594.00	0.10
238	600219	南山铝业	20,900	83,391.00	0.10
239	601877	正泰电器	3,300	82,731.00	0.09
240	600372	中航机载	7,500	81,375.00	0.09
241	601878	浙商证券	8,500	80,750.00	0.09
242	301236	软通动力	1,900	80,655.00	0.09
243	600233	圆通速递	5,000	78,750.00	0.09
244	000963	华东医药	2,800	78,736.00	0.09
245	600741	华域汽车	4,800	74,496.00	0.09
246	002920	德赛西威	900	73,350.00	0.08
247	300866	安克创新	700	73,150.00	0.08
248	688047	龙芯中科	468	72,385.56	0.08
249	000895	双汇发展	3,200	71,680.00	0.08

250	001979	招商蛇口	10,900	70,087.00	0.08
251	601898	中煤能源	5,700	69,426.00	0.08
252	002304	洋河股份	1,800	68,670.00	0.08
253	601319	中国人保	9,800	66,248.00	0.08
254	600023	浙能电力	12,500	65,750.00	0.08
255	601021	春秋航空	1,400	63,812.00	0.07
256	600039	四川路桥	8,040	62,872.80	0.07
257	601800	中国交建	10,900	62,239.00	0.07
258	000002	万科A	20,622	61,041.12	0.07
259	688223	晶科能源	12,500	59,375.00	0.07
260	001965	招商公路	6,400	58,624.00	0.07
261	600588	用友网络	6,300	57,834.00	0.07
262	600600	青岛啤酒	1,100	57,453.00	0.07
263	601633	长城汽车	3,800	57,342.00	0.07
264	601618	中国中冶	22,600	55,144.00	0.06
265	300628	亿联网络	1,620	54,788.40	0.06
266	603369	今世缘	2,300	54,533.00	0.06
267	600027	华电国际	12,000	53,400.00	0.06
268	603260	合盛硅业	1,100	53,086.00	0.06
269	302132	中航成飞	900	52,488.00	0.06
270	601607	上海医药	3,400	52,360.00	0.06
271	600918	中泰证券	9,700	51,604.00	0.06
272	600025	华能水电	5,800	51,562.00	0.06
273	600061	国投资本	7,764	50,854.20	0.06
274	300832	新产业	1,200	50,400.00	0.06
275	000617	中油资本	7,600	50,084.00	0.06
276	300251	光线传媒	4,400	48,796.00	0.06
277	601059	信达证券	3,000	48,570.00	0.06
278	600085	同仁堂	2,100	48,531.00	0.06
279	600930	华电新能	10,100	48,177.00	0.06
280	600515	海南机场	17,400	47,676.00	0.05

281	688472	阿特斯	4,400	47,608.00	0.05
282	000999	华润三九	2,019	45,407.31	0.05
283	600803	新奥股份	2,800	44,240.00	0.05
284	300896	爱美客	500	43,600.00	0.05
285	300122	智飞生物	3,600	42,084.00	0.05
286	300999	金龙鱼	1,800	41,868.00	0.05
287	600845	宝信软件	2,488	41,375.44	0.05
288	600018	上港集团	8,600	40,592.00	0.05
289	000596	古井贡酒	500	39,900.00	0.05
290	000708	中信特钢	3,100	39,122.00	0.04
291	601018	宁波港	12,100	38,115.00	0.04
292	688009	中国通号	7,662	36,471.12	0.04
293	601238	广汽集团	6,700	34,036.00	0.04
294	300413	芒果超媒	2,300	33,649.00	0.04
295	001280	中国铀业	500	33,350.00	0.04
296	688303	大全能源	1,900	33,117.00	0.04
297	301165	锐捷网络	400	32,180.00	0.04
298	603392	万泰生物	1,103	29,747.91	0.03
299	601136	首创证券	1,600	22,320.00	0.03
300	001391	国货航	4,300	17,501.00	0.02

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	300750	宁德时代	777,189.00	0.66
2	000988	华工科技	486,967.00	0.41

3	002371	北方华创	443,750.00	0.38
4	600519	贵州茅台	419,669.00	0.36
5	301308	江波龙	412,621.00	0.35
6	688072	拓荆科技	404,466.14	0.34
7	688041	海光信息	392,855.28	0.33
8	688521	芯原股份	299,734.00	0.25
9	002353	杰瑞股份	288,472.00	0.24
10	002602	世纪华通	273,139.00	0.23
11	000333	美的集团	257,704.00	0.22
12	600549	厦门钨业	236,706.00	0.20
13	000657	中钨高新	233,308.00	0.20
14	300308	中际旭创	218,987.00	0.19
15	300394	天孚通信	199,050.00	0.17
16	300476	胜宏科技	193,986.00	0.16
17	002202	金风科技	186,474.00	0.16
18	300502	新易盛	169,413.00	0.14
19	002837	英维克	163,457.00	0.14
20	002384	东山精密	159,790.00	0.14

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	300750	宁德时代	2,228,759.00	1.89
2	300308	中际旭创	1,583,519.00	1.34
3	300502	新易盛	980,275.00	0.83
4	002371	北方华创	753,550.00	0.64
5	000333	美的集团	719,346.00	0.61
6	002475	立讯精密	560,799.00	0.48

7	300059	东方财富	499,048.00	0.42
8	300476	胜宏科技	463,231.00	0.39
9	300274	阳光电源	441,543.00	0.37
10	002594	比亚迪	434,198.00	0.37
11	300394	天孚通信	383,899.00	0.33
12	002384	东山精密	347,241.00	0.29
13	000725	京东方 A	339,290.00	0.29
14	000651	格力电器	333,926.00	0.28
15	000858	五粮液	326,546.00	0.28
16	688012	中微公司	283,543.07	0.24
17	002028	思源电气	272,580.00	0.23
18	000338	潍柴动力	270,987.00	0.23
19	300124	汇川技术	270,842.00	0.23
20	300760	迈瑞医疗	267,520.00	0.23

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	12,139,005.44
卖出股票收入（成交）总额	25,611,441.47

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

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 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在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

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。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票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	29,256.11
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	29,256.11

7.12.4 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。

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

§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		兴业沪深300交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,434	54,573.30	12,275,200.00	15.6855%	20,179,011.00	25.7852%	45,803,900.00	58.529

							3%

8.2 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%

8.3 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	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09月11日)基金份额总额	216,258,111.00
本报告期期初基金份额总额	114,258,111.00
本报告期基金总申购份额	6,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	42,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	78,258,111.00

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本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、2026年7月20日，黄文锋先生离任兴业基金管理有限公司副总经理。详见本公司于2026年7月21日发布的《兴业基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。

2、2026年7月20日，李辉先生离任兴业基金管理有限公司总经理，由董事长刘宗治先生代为履行总经理职务。详见本公司于2026年7月21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、2026年7月31日，周鸣女士担任兴业基金管理有限公司总经理助理。详见本公司于2026年8月3日发布的《兴业基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。

4、2026年6月，经中信银行研究决定，杨璋琪任中信银行运营管理部总经理，不再任中信银行资产托管部总经理职务。2026年6月，王坚任中信银行资产托管部总经理，待获得基金从业资格并履行备案程序后正式履职。上述事项对中信银行基金业务无影响。

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，无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期，基金托管人未受到调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期	佣金	占当期	

	单元数量		股票成交总额的比例		佣金总量的比例	
国盛证券	2	20,651,314.50	54.70%	4,045.69	54.70%	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	17,099,132.41	45.30%	3,350.11	45.30%	-

注：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资力雄厚,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法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,合规风控能力较强，并能满足各产品运作高度保密的要求。iv具备各标准化产品运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理各标准化产品进行证券交易的需要,并能为各标准化产品提供全面的信息服务，交易能力较强。v研究综合实力较强。vi其他因素（例如，虽综合能力一般，但在某些特色领域或行业，其研究能力、深度和质量在行业领先）。开立交易单元原则上券商应至少已提供两个季度以上的研究服务，并且在最近一季度服务评价评分中排名在前十名。

②券商专用交易单元选择程序：i本基金管理人组织相关人员依据上述标准评估及确定选用的券商。ii 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，本期未新增券商交易单元，本期未剔除券商交易单元。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期内无租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

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	兴业沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定的媒介	2026-01-19
2	兴业基金管理有限公司关于旗下部分ETF变更扩位证券简称的公告	中国证监会规定的媒介	2026-01-19

3	兴业沪深300交易型开放式指数证券投资基金2025年第四季度报告	中国证监会规定的媒介	2026-01-22
4	关于兴业基金旗下交易型开放式指数证券投资基金增加东莞证券股份有限公司为一级交易商的公告	中国证监会规定的媒介	2026-01-30
5	兴业沪深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书更新	中国证监会规定的媒介	2026-02-13
6	兴业基金管理有限公司旗下部分交易型开放式基金增加中国国际金融股份有限公司为一级交易商的公告	中国证监会规定的媒介	2026-03-23
7	兴业基金管理有限公司关于住所变更的公告	中国证监会规定的媒介	2026-03-27
8	兴业沪深300交易型开放式指数证券投资基金2025年年度报告	中国证监会规定的媒介	2026-03-28
9	兴业基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025年度）	中国证监会规定的媒介	2026-03-31
10	兴业沪深300交易型开放式指数证券投资基金2026年第一季度报告	中国证监会规定的媒介	2026-04-22
11	关于兴业基金旗下部分交易型开放式指数证券投资基金增加兴业证券股份有限公司为一级交易商的公告	中国证监会规定的媒介	2026-05-20
12	兴业基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理本公司旗	中国证监会规定的媒介	2026-06-16

	下基金销售业务的公告		
13	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及旗下部分基金风险等级调整的通知	中国证监会规定的媒介	2026-06-18
14	兴业沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定的媒介	2026-06-23

§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
联接基金	1	20260101-20260630	69,584,800.00	5,035,900.00	28,816,800.00	45,803,900.00	58.53%
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。							

上述份额占比为四舍五入，保留两位小数后的结果。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

自2026年1月19日起,兴业沪深300交易型开放式指数证券投资基金变更扩位证券简称。原扩位证券简称“300指数ETF”，变更后扩位简称“沪深300ETF兴业”。

§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沪深300交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件

（二）《兴业沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

（三）《兴业沪深300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
二〇二六年八月二十九日