兴业中证500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:中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国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 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 36
7.1 期末基金资产组合情况 36
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 54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 56
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 57
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 57
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 57
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 57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 57
7.12 投资组合报告附注 57
§8 基金份额持有人信息 58

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 59
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 59
§9 开放式基金份额变动 59
§10 重大事件揭示 59
10.1 基金份额持有人大会决议 59
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 59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 60
10.4 基金投资策略的改变 60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 60
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 60
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 60
10.8 其他重大事件 62
§11 影响投资者决策的其他重要信息 63
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 63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 64
§12 备查文件目录 64
12.1 备查文件目录 64
12.2 存放地点 64
12.3 查阅方式 64

§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：中证500ETF兴业）
场内简称	兴业500（扩位证券简称：中证500ETF兴业）
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	28,060,583.00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	张顺国	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湖东路154号中山大厦A座5层507室	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		刘宗治	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	8,596,489.51
本期利润	9,721,835.42
加权平均基金份额本期利润	0.2732
本期加权平均净值利润率	21.11%
本期基金份额净值增长率	21.57%
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	11,620,159.16
期末可供分配基金份额利润	0.4141
期末基金资产净值	39,931,213.06
期末基金份额净值	1.4230
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	42.30%

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	19.36%	1.63%	18.56%	1.65%	0.80%	-0.02%
过去六个月	21.57%	1.62%	20.97%	1.66%	0.60%	-0.04%
过去一年	53.13%	1.40%	52.68%	1.42%	0.45%	-0.02%
过去三年	55.60%	1.41%	50.55%	1.49%	5.05%	-0.08%
过去五年	40.03%	1.30%	32.65%	1.36%	7.38%	-0.06%
自基金合同生效起至今	42.30%	1.25%	56.73%	1.34%	-14.43%	-0.09%

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。
丁小丰	基金经理助理	2026-05-28	-	8年	中国籍，硕士学位，具有证券投资基金从业资格，2018年3月起先后在国泰基金管理有限公司、招商基金管理有限公司从事行业研究和策略研究等工作，2025年8月加入兴业基金管理有限公司担任指数与量化业务

					团队研究员，现任基金经理助理。

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%。

截至6月末，中证500的前五大权重行业为电子、电力设备、机械设备、医药生物和通信，权重分别为28.7%、9.1%、6.7%、6.5%和6%，电子行业的占比显著突出。相比25年末，电子行业的权重提升了约12%。从估值的角度看，当前中证500的PE-TTM分位数为42，加权PE-TTM为411.7。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。

中证500指数在经历了10多年的发展后，伴随着A股股票的成长，中证500逐步成为了中盘股的代表，其中科技、制造、医药等成长属性强的行业贡献最为显著，和市场风险偏好也更为相关。

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

截至报告期末兴业中证500ETF（证券简称：兴业500；扩位证券简称：中证500ETF兴业）基金份额净值为1.4230元，本报告期内，基金份额净值增长率为21.57%，同期业绩比较基准收益率为20.97%。

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

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。

本基金自2023年07月06日起至2026年03月31日止净值低于五千万，已连续六十个工作日以上，本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

本报告期内，本基金在迷你期间，信息披露费、审计费、银行间账户维护费、持有人大会费用等各类固定费用由基金管理人自主承担。

§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，完全尽职尽责的履行了应尽的义务。

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的复核，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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、准确和完整。

§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：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	418,699.80	1,097,115.42
结算备付金		16,707.48	21,836.80
存出保证金		36,115.38	6,555.23
交易性金融资产	6.4.7.2	39,350,926.04	22,956,604.69
其中：股票投资		39,350,926.04	22,956,604.69
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		2,009,082.22	-
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		41,831,530.92	24,082,112.14
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		1,679,051.20	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		20,351.97	10,514.79
应付托管费		4,070.41	2,102.96
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	196,844.28	3,765.66
负债合计		1,900,317.86	16,383.41
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	28,060,583.00	20,560,583.00
未分配利润	6.4.7.8	11,870,630.06	3,505,145.73
净资产合计		39,931,213.06	24,065,728.73
负债和净资产总计		41,831,530.92	24,082,112.14

注：报告截止日2026年06月30日，基金份额净值1.4230元，基金份额总额28,060,583.00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：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		9,866,634.14	1,297,131.65
1.利息收入		2,492.35	1,850.02
其中：存款利息收入	6.4.7.9	2,492.35	1,850.02
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）		8,477,342.55	472,294.59
其中：股票投资收益	6.4.7.10	8,150,080.97	262,840.10
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	327,261.58	209,454.49
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	1,125,345.91	793,440.57
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	261,453.33	29,546.47
减：二、营业总支出		144,798.72	75,077.40
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	112,868.73	60,745.42
2.托管费	6.4.10.2.2	22,573.77	12,149.05
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	9,356.22	2,182.93
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,721,835.42	1,222,054.25
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,721,835.42	1,222,054.25
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		9,721,835.42	1,222,054.25

6.3 净资产变动表

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：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	20,560,583.00	3,505,145.73	24,065,728.73
二、本期期初净资产	20,560,583.00	3,505,145.73	24,065,728.73
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	7,500,000.00	8,365,484.33	15,865,484.33
（一）、综合收益总额	-	9,721,835.42	9,721,835.42
（二）、本期基金	7,500,000.00	-1,356,351.09	6,143,648.91

份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	57,500,000.00	13,657,874.89	71,157,874.89
2.基金赎回款	-50,000,000.00	-15,014,225.98	-65,014,225.98
（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	28,060,583.00	11,870,630.06	39,931,213.06
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	30,560,583.00	-3,273,235.64	27,287,347.36
二、本期期初净资产	30,560,583.00	-3,273,235.64	27,287,347.36
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-7,500,000.00	1,643,200.91	-5,856,799.09
（一）、综合收益总额	-	1,222,054.25	1,222,054.25
（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）	-7,500,000.00	421,146.66	-7,078,853.34
其中：1.基金申购款	30,000,000.00	-4,243,314.74	25,756,685.26
2.基金赎回	-37,500,000.00	4,664,461.40	-32,835,538.60

款			
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	23,060,583.00	-1,630,034.73	21,430,548.27

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”)、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06月30日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	418,699.80
等于：本金	418,601.20
加：应计利息	98.60
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	418,699.80

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		35,058,933.61	-	39,350,926.04	4,291,992.43
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	35,058,933.61	-	39,350,926.04	4,291,992.43

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	18,697.90
其中：交易所市场	18,697.90
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	8,725.99
可退替代款	26,181.71
应退替代款	143,238.68
合计	196,844.28

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	20,560,583.00	20,560,583.00
本期申购	57,500,000.00	57,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-50,000,000.00	-50,000,000.00
本期末	28,060,583.00	28,060,583.00

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	3,798,841.16	-293,695.43	3,505,145.73
本期期初	3,798,841.16	-293,695.43	3,505,145.73
本期利润	8,596,489.51	1,125,345.91	9,721,835.42
本期基金份额交易产生的变动数	-775,171.51	-581,179.58	-1,356,351.09
其中：基金申购款	13,597,327.59	60,547.30	13,657,874.89
基金赎回款	-14,372,499.10	-641,726.88	-15,014,225.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,620,159.16	250,470.90	11,870,630.06

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	2,340.68
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	119.37
其他	32.30
合计	2,492.35

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	6,142,789.59
股票投资收益——赎回差价收入	2,007,291.38
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	8,150,080.97

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	52,015,205.05
减：卖出股票成本总额	45,818,428.68
减：交易费用	53,986.78
买卖股票差价收入	6,142,789.59

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	65,014,225.98
减：现金支付赎回款总额	34,080,055.98
减：赎回股票成本总额	28,926,878.62
减：交易费用	-
赎回差价收入	2,007,291.38

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

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 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	327,261.58
基金投资产生的股利收益	-
合计	327,261.58

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	1,125,345.91
——股票投资	1,125,345.91
——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	1,125,345.91

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	261,453.33
合计	261,453.33

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 2026年01月01日至2026年06月30日
审计费用	8,725.99
信息披露费	-
汇划手续费	630.23
合计	9,356.22

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
中远海运发展股份有限公司(以下简称"中远海发")	基金管理人股东中海集团的控股股东

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 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	112,868.73	60,745.42
其中：应支付销售机构的客户维护费	6,716.88	4,086.39
应支付基金管理人的净管理费	106,151.85	56,659.03

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 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	22,573.77	12,149.05

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

本基金本报告期间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 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
兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	16,278,500.00	58.01%	11,861,600.00	57.69%

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
中国银行股份有限公司	418,699.80	2,340.68	311,430.98	1,709.70

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

本报告期末，本基金持有基金管理人的非控股股东关联方发行的股票中远海发(601866.SH)12,600股，占本基金资产净值的0.0697%(上年度末：8,400股，占本基金资产净值的0.09%)。

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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

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，本基金本报告期末及上年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	418,699.80	-	-	-	418,699.80
结算备付金	16,707.48	-	-	-	16,707.48
存出保证金	36,115.38	-	-	-	36,115.38
交易性金融资产	-	-	-	39,350,926.04	39,350,926.04
应收清算款	-	-	-	2,009,082.22	2,009,082.22
资产总	471,522.66	-	-	41,360,008.26	41,831,530.92

计					
负债					
应付清算款	-	-	-	1,679,051.20	1,679,051.20
应付管理人报酬	-	-	-	20,351.97	20,351.97
应付托管费	-	-	-	4,070.41	4,070.41
其他负债	-	-	-	196,844.28	196,844.28
负债总计	-	-	-	1,900,317.86	1,900,317.86
利率敏感度缺口	471,522.66	-	-	39,459,690.40	39,931,213.06
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	1,097,115.42	-	-	-	1,097,115.42
结算备付金	21,836.80	-	-	-	21,836.80
存出保证金	6,555.23	-	-	-	6,555.23
交易性金融资产	-	-	-	22,956,604.69	22,956,604.69
资产总计	1,125,507.45	-	-	22,956,604.69	24,082,112.14
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	10,514.79	10,514.79

应付托管费	-	-	-	2,102.96	2,102.96
其他负债	-	-	-	3,765.66	3,765.66
负债总计	-	-	-	16,383.41	16,383.41
利率敏感度缺口	1,125,507.45	-	-	22,940,221.28	24,065,728.73

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

截至本报告期末及上年度末，本基金未持有交易性债券资产投资和交易性资产支持证券投资，因此市场利率变动对于本基金资产净值无重大影响。

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	39,350,926.04	98.55	22,956,604.69	95.39
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	39,350,926.04	98.55	22,956,604.69	95.39

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 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
	股票价格上升5%	1,967,546.30	1,147,830.23
	股票价格下降5%	-1,967,546.30	-1,147,830.23

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	39,350,926.04	22,956,604.69
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	39,350,926.04	22,956,604.69

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	39,350,926.04	94.07
	其中：股票	39,350,926.04	94.07
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	435,407.28	1.04
8	其他各项资产	2,045,197.60	4.89
9	合计	41,831,530.92	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	131,226.00	0.33
B	采矿业	1,198,178.50	3.00
C	制造业	29,727,291.67	74.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	943,991.40	2.36
E	建筑业	221,989.00	0.56
F	批发和零售业	753,293.05	1.89
G	交通运输、仓储和邮政业	457,123.00	1.14
H	住宿和餐饮业	35,980.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,543,111.96	6.37

J	金融业	2,062,891.70	5.17
K	房地产业	155,176.00	0.39
L	租赁和商务服务业	418,880.80	1.05
M	科学研究和技术服务业	293,587.00	0.74
N	水利、环境和公共设施管理业	138,308.88	0.35
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	95,496.08	0.24
R	文化、体育和娱乐业	174,401.00	0.44
S	综合	-	-
	合计	39,350,926.04	98.55

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	688498	源杰科技	300	565,800.00	1.42
2	001309	德明利	600	565,740.00	1.42
3	300604	长川科技	1,500	512,130.00	1.28
4	688347	华虹宏力	1,500	504,450.00	1.26
5	002281	光迅科技	1,800	462,492.00	1.16
6	688120	华海清科	1,400	451,052.00	1.13
7	300857	协创数据	1,300	441,870.00	1.11
8	002008	大族激光	2,900	435,319.00	1.09
9	688361	中科飞测	1,000	430,000.00	1.08

10	300136	信维通信	3,600	429,300.00	1.08
11	300475	香农芯创	1,200	360,000.00	0.90
12	002436	兴森科技	6,500	331,175.00	0.83
13	300223	北京君正	1,300	323,570.00	0.81
14	002851	麦格米特	1,800	300,924.00	0.75
15	300666	江丰电子	800	294,880.00	0.74
16	300054	鼎龙股份	2,600	275,522.00	0.69
17	600105	永鼎股份	4,000	269,920.00	0.68
18	300285	国瓷材料	2,600	268,268.00	0.67
19	688777	中控技术	2,200	258,500.00	0.65
20	300548	长芯博创	900	250,200.00	0.63
21	300757	罗博特科	400	247,600.00	0.62
22	002409	雅克科技	1,100	246,950.00	0.62
23	000021	深科技	3,800	244,226.00	0.61
24	300346	南大光电	2,600	240,890.00	0.60
25	300620	光库科技	600	226,920.00	0.57
26	300567	精测电子	700	222,320.00	0.56
27	688313	仕佳光子	1,200	221,580.00	0.55
28	688037	芯源微	500	219,525.00	0.55
29	601869	长飞光纤	400	218,360.00	0.55
30	688002	睿创微纳	1,400	216,566.00	0.54
31	600498	烽火通信	2,900	213,440.00	0.53
32	688200	华峰测控	400	210,040.00	0.53
33	002138	顺络电子	2,800	204,680.00	0.51
34	300373	扬杰科技	1,300	204,399.00	0.51
35	688019	安集科技	600	203,676.00	0.51
36	002185	华天科技	8,800	196,328.00	0.49
37	300390	天华新能	2,030	189,825.30	0.48
38	688629	华丰科技	1,000	187,510.00	0.47
39	600879	航天电子	8,800	187,352.00	0.47
40	300395	菲利华	1,400	187,222.00	0.47

41	002407	多氟多	3,700	185,851.00	0.47
42	603256	宏和科技	700	185,731.00	0.47
43	300058	蓝色光标	13,280	182,732.80	0.46
44	688469	芯联集成	16,900	179,309.00	0.45
45	301526	国际复材	3,800	177,346.00	0.44
46	300037	新宙邦	1,900	176,415.00	0.44
47	300751	迈为股份	600	169,476.00	0.42
48	688172	燕东微	2,000	167,320.00	0.42
49	688017	绿的谐波	400	167,144.00	0.42
50	301377	鼎泰高科	300	165,270.00	0.41
51	688099	晶晨股份	1,600	164,640.00	0.41
52	002273	水晶光电	4,500	159,660.00	0.40
53	688702	盛科通信	400	155,996.00	0.39
54	605358	立昂微	2,000	155,200.00	0.39
55	600885	宏发股份	4,468	154,101.32	0.39
56	002126	银轮股份	3,000	149,400.00	0.37
57	300570	太辰光	600	148,026.00	0.37
58	688411	海博思创	500	145,600.00	0.36
59	600988	赤峰黄金	5,500	144,760.00	0.36
60	000831	中国稀土	2,600	144,274.00	0.36
61	301200	大族数控	400	144,260.00	0.36
62	001389	广合科技	600	142,350.00	0.36
63	600141	兴发集团	3,000	140,910.00	0.35
64	000960	锡业股份	3,300	140,877.00	0.35
65	605589	圣泉集团	2,200	139,854.00	0.35
66	301358	湖南裕能	1,800	136,566.00	0.34
67	002812	恩捷股份	2,000	133,820.00	0.34
68	688608	恒玄科技	800	133,752.00	0.33
69	002850	科达利	700	132,510.00	0.33
70	600711	盛屯矿业	12,000	131,640.00	0.33
71	601179	中国西电	8,800	131,296.00	0.33

72	600392	盛和资源	4,400	130,988.00	0.33
73	600497	驰宏锌锗	10,700	129,577.00	0.32
74	002195	岩山科技	19,800	129,492.00	0.32
75	003031	中瓷电子	700	126,210.00	0.32
76	600601	方正科技	9,000	124,560.00	0.31
77	002261	拓维信息	4,400	123,244.00	0.31
78	600157	永泰能源	75,900	122,199.00	0.31
79	002738	中矿资源	2,060	121,519.40	0.30
80	688234	天岳先进	700	121,457.00	0.30
81	600378	昊华科技	1,600	120,608.00	0.30
82	688213	思特威	1,100	117,777.00	0.29
83	002340	格林美	17,600	116,336.00	0.29
84	688052	纳芯微	400	115,324.00	0.29
85	300017	网宿科技	8,800	114,488.00	0.29
86	600143	金发科技	7,400	114,330.00	0.29
87	002821	凯莱英	700	113,400.00	0.28
88	601555	东吴证券	14,260	112,939.20	0.28
89	300759	康龙化成	3,900	112,827.00	0.28
90	002131	利欧股份	23,100	109,725.00	0.27
91	688578	艾力斯	1,000	109,200.00	0.27
92	301611	珂玛科技	600	108,042.00	0.27
93	002966	苏州银行	15,460	107,601.60	0.27
94	000783	长江证券	11,000	107,250.00	0.27
95	688122	西部超导	1,700	106,777.00	0.27
96	600909	华安证券	9,490	105,433.90	0.26
97	688387	信科移动	5,270	104,556.80	0.26
98	300458	全志科技	2,620	103,385.20	0.26
99	600352	浙江龙盛	8,500	102,935.00	0.26
100	002601	龙佰集团	6,200	102,176.00	0.26
101	688235	百济神州	400	101,844.00	0.26
102	688027	国盾量子	200	100,802.00	0.25

103	002203	海亮股份	4,400	100,540.00	0.25
104	688385	复旦微电	1,400	99,806.00	0.25
105	002472	双环传动	2,400	99,624.00	0.25
106	688220	翱捷科技	800	99,456.00	0.25
107	300207	欣旺达	5,100	96,849.00	0.24
108	603308	应流股份	1,600	96,640.00	0.24
109	300339	润和软件	2,500	96,275.00	0.24
110	603659	璞泰来	3,300	95,469.00	0.24
111	601233	桐昆股份	4,400	95,260.00	0.24
112	002517	恺英网络	5,800	94,250.00	0.24
113	002797	第一创业	14,300	93,951.00	0.24
114	300496	中科创达	1,500	92,685.00	0.23
115	300115	长盈精密	3,300	92,202.00	0.23
116	002432	九安医疗	1,300	91,884.00	0.23
117	300919	中伟新材	2,100	91,875.00	0.23
118	601108	财通证券	10,600	91,690.00	0.23
119	603920	世运电路	1,900	91,276.00	0.23
119	300073	当升科技	1,900	91,276.00	0.23
120	000423	东阿阿胶	2,000	90,720.00	0.23
121	601991	大唐发电	12,800	90,624.00	0.23
121	002756	永兴材料	1,600	90,624.00	0.23
121	000733	振华科技	1,600	90,624.00	0.23
122	000703	恒逸石化	6,600	89,562.00	0.22
123	002252	上海莱士	20,500	88,970.00	0.22
124	603650	彤程新材	900	88,182.00	0.22
125	300474	景嘉微	1,450	87,696.00	0.22
126	601198	东兴证券	6,400	86,976.00	0.22
127	002487	大金重工	1,500	86,955.00	0.22
128	600884	杉杉股份	6,400	86,720.00	0.22
129	300454	深信服	900	86,580.00	0.22
130	600060	海信视像	3,100	86,397.00	0.22

131	601162	天风证券	25,500	85,935.00	0.22
132	688676	金盘科技	1,000	84,640.00	0.21
133	601958	金钼股份	3,000	84,330.00	0.21
134	002465	海格通信	6,600	84,282.00	0.21
135	002130	沃尔核材	4,400	83,424.00	0.21
136	000060	中金岭南	11,000	83,270.00	0.21
137	300001	特锐德	2,200	83,226.00	0.21
138	300012	华测检测	6,000	83,160.00	0.21
139	603688	石英股份	1,000	82,610.00	0.21
140	688343	云天励飞	1,000	81,660.00	0.20
141	600021	上海电力	5,400	81,378.00	0.20
142	300763	锦浪科技	900	81,315.00	0.20
143	300024	机器人	4,200	81,186.00	0.20
144	300623	捷捷微电	1,800	80,982.00	0.20
145	002414	高德红外	6,100	80,886.00	0.20
146	002155	湖南黄金	3,360	80,203.20	0.20
147	000661	长春高新	1,200	79,920.00	0.20
148	601665	齐鲁银行	13,800	79,626.00	0.20
149	002271	东方雨虹	6,600	78,342.00	0.20
150	688322	奥比中光	600	78,330.00	0.20
151	002444	巨星科技	2,500	77,750.00	0.19
152	688599	天合光能	5,500	77,660.00	0.19
153	002402	和而泰	3,000	77,490.00	0.19
154	301536	星宸科技	600	77,226.00	0.19
155	601099	太平洋	22,900	77,173.00	0.19
156	002429	兆驰股份	7,400	76,886.00	0.19
157	300677	英科医疗	1,960	76,773.20	0.19
158	603129	春风动力	300	76,740.00	0.19
159	603979	金诚信	1,300	76,739.00	0.19
160	000034	神州数码	2,760	76,590.00	0.19
161	600563	法拉电子	400	76,320.00	0.19

162	600256	广汇能源	15,400	76,076.00	0.19
163	600298	安琪酵母	2,100	76,020.00	0.19
164	603379	三美股份	1,000	75,890.00	0.19
165	600699	均胜电子	3,500	75,635.00	0.19
166	601615	明阳智能	6,500	75,205.00	0.19
167	002078	太阳纸业	6,000	74,940.00	0.19
168	603179	新泉股份	1,500	74,475.00	0.19
169	688301	奕瑞科技	600	74,400.00	0.19
170	600109	国金证券	8,400	73,752.00	0.18
171	002157	正邦科技	26,200	73,622.00	0.18
172	688728	格科微	3,479	73,198.16	0.18
173	002056	横店东磁	2,400	73,152.00	0.18
174	000878	云南铜业	4,600	73,048.00	0.18
175	300432	富临精工	3,600	72,324.00	0.18
176	601577	长沙银行	8,300	72,293.00	0.18
177	000786	北新建材	3,900	70,551.00	0.18
178	688266	泽璟制药	600	69,996.00	0.18
179	000893	亚钾国际	1,700	69,513.00	0.17
180	300142	沃森生物	5,300	68,847.00	0.17
181	603156	养元饮品	1,400	68,698.00	0.17
182	688187	时代电气	1,000	68,660.00	0.17
183	300748	金力永磁	2,220	68,487.00	0.17
184	603087	甘李药业	1,200	68,112.00	0.17
185	601696	中银证券	5,300	67,045.00	0.17
186	300953	震裕科技	500	66,850.00	0.17
187	603119	浙江荣泰	1,000	66,340.00	0.17
188	002831	裕同科技	1,864	66,283.84	0.17
189	300679	电连技术	1,100	65,989.00	0.17
190	603606	东方电缆	1,580	65,585.80	0.16
191	688331	荣昌生物	500	65,130.00	0.16
192	600707	彩虹股份	3,800	64,182.00	0.16

193	601128	常熟银行	10,975	63,874.50	0.16
194	688615	合合信息	560	63,336.00	0.16
195	000728	国元证券	8,400	62,916.00	0.16
196	001203	大中矿业	2,100	62,895.00	0.16
197	688375	国博电子	600	62,580.00	0.16
198	688065	凯赛生物	1,300	62,205.00	0.16
199	002841	视源股份	1,800	62,154.00	0.16
200	002335	科华数据	1,455	61,764.75	0.15
201	603290	斯达半导	400	61,176.00	0.15
202	000415	渤海租赁	15,000	61,050.00	0.15
203	002025	航天电器	800	60,976.00	0.15
204	002624	完美世界	4,900	60,858.00	0.15
205	603806	福斯特	3,600	60,444.00	0.15
206	001696	宗申动力	2,900	60,349.00	0.15
207	600100	同方股份	8,800	60,280.00	0.15
208	300699	光威复材	2,100	60,165.00	0.15
209	601699	潞安环能	4,200	59,976.00	0.15
210	601717	中创智领	4,300	59,813.00	0.15
211	002064	华峰化学	6,300	59,787.00	0.15
212	688188	柏楚电子	560	59,752.00	0.15
213	000983	山西焦煤	10,300	59,740.00	0.15
214	600642	申能股份	6,800	59,364.00	0.15
215	600516	方大炭素	9,500	58,615.00	0.15
216	002683	广东宏大	2,000	58,580.00	0.15
217	688568	中科星图	1,400	58,058.00	0.15
218	600171	上海贝岭	1,800	57,492.00	0.14
219	603225	新凤鸣	2,912	57,220.80	0.14
220	688169	石头科技	600	56,982.00	0.14
221	000519	中兵红箭	2,700	56,889.00	0.14
222	002044	美年健康	11,300	56,839.00	0.14
223	600595	中孚实业	10,100	56,762.00	0.14

224	000623	吉林敖东	3,200	56,736.00	0.14
225	300724	捷佳伟创	800	56,480.00	0.14
226	002266	浙富控股	11,100	56,166.00	0.14
227	603345	安井食品	700	56,133.00	0.14
228	002430	杭氧股份	1,800	55,728.00	0.14
229	600177	雅戈尔	7,400	55,722.00	0.14
230	603160	汇顶科技	900	55,539.00	0.14
231	002085	万丰奥威	5,000	55,450.00	0.14
232	603699	纽威股份	1,100	55,330.00	0.14
233	002673	西部证券	8,500	55,165.00	0.14
234	000155	川能动力	4,600	55,108.00	0.14
235	603596	伯特利	2,200	54,648.00	0.14
236	688617	惠泰医疗	300	54,468.00	0.14
237	000750	国海证券	14,800	54,464.00	0.14
238	000559	万向钱潮	4,200	54,306.00	0.14
239	600637	东方明珠	6,500	54,015.00	0.14
240	603605	珀莱雅	900	53,928.00	0.14
241	002223	鱼跃医疗	2,100	53,886.00	0.13
242	601212	白银有色	10,600	53,848.00	0.13
243	000887	中鼎股份	3,000	53,670.00	0.13
244	002007	华兰生物	4,400	53,636.00	0.13
245	300383	光环新网	4,300	53,492.00	0.13
246	600536	中国软件	1,895	53,287.40	0.13
247	600521	华海药业	3,700	53,280.00	0.13
248	600316	洪都航空	1,900	53,086.00	0.13
249	002065	东华软件	7,400	52,836.00	0.13
250	600863	华能蒙电	11,200	52,640.00	0.13
251	002318	久立特材	2,200	52,580.00	0.13
252	000050	深天马A	5,300	52,523.00	0.13
253	603766	隆鑫通用	4,400	52,492.00	0.13
254	600499	科达制造	3,800	52,440.00	0.13

255	300972	万辰集团	300	52,023.00	0.13
256	600369	西南证券	12,800	51,456.00	0.13
257	688018	乐鑫科技	400	51,168.00	0.13
258	000039	中集集团	6,300	51,093.00	0.13
259	688114	华大智造	1,000	51,080.00	0.13
260	300003	乐普医疗	4,300	50,955.00	0.13
261	002739	儒意电影	5,300	50,880.00	0.13
262	688180	君实生物	1,500	50,730.00	0.13
263	600704	物产中大	10,600	50,032.00	0.13
264	688318	财富趋势	700	49,917.00	0.13
265	000400	许继电气	2,300	49,910.00	0.12
266	000032	深桑达A	2,000	49,900.00	0.12
267	688297	中无人机	1,200	49,860.00	0.12
268	000629	钒钛股份	14,800	49,432.00	0.12
269	000738	航发控制	2,700	49,383.00	0.12
270	601997	贵阳银行	9,600	49,248.00	0.12
271	300002	神州泰岳	6,300	49,203.00	0.12
272	600985	淮北矿业	3,500	49,175.00	0.12
273	601016	节能风电	12,670	49,159.60	0.12
274	600765	中航重机	3,800	49,096.00	0.12
275	688772	珠海冠宇	2,490	48,878.70	0.12
276	688692	达梦数据	200	48,858.00	0.12
277	601990	南京证券	7,400	48,618.00	0.12
278	600348	华阳股份	6,350	48,577.50	0.12
279	000683	博源化工	8,400	48,384.00	0.12
280	600153	建发股份	6,100	48,373.00	0.12
281	300627	华测导航	1,700	48,280.00	0.12
282	603077	和邦生物	20,800	48,256.00	0.12
283	600332	白云山	2,400	48,096.00	0.12
284	000062	深圳华强	1,500	47,730.00	0.12
285	601216	君正集团	10,600	47,276.00	0.12

286	688538	和辉光电	18,100	47,060.00	0.12
287	600873	梅花生物	6,400	47,040.00	0.12
288	601001	晋控煤业	2,700	46,953.00	0.12
289	600862	中航高科	2,600	46,878.00	0.12
290	601611	中国核建	4,200	46,830.00	0.12
291	000729	燕京啤酒	4,600	46,598.00	0.12
292	000591	太阳能	10,000	46,000.00	0.12
293	600166	福田汽车	15,800	45,978.00	0.12
294	603568	伟明环保	2,976	45,770.88	0.11
295	000830	鲁西化工	3,800	45,600.00	0.11
296	300558	贝达药业	700	45,549.00	0.11
297	300735	光弘科技	2,000	45,480.00	0.11
298	002939	长城证券	5,300	44,202.00	0.11
299	300487	蓝晓科技	750	44,137.50	0.11
300	600486	扬农化工	870	44,109.00	0.11
301	000921	海信家电	1,600	43,712.00	0.11
302	002926	华西证券	5,300	43,301.00	0.11
303	002410	广联达	5,300	43,248.00	0.11
304	000932	华菱钢铁	12,400	43,028.00	0.11
305	600038	中直股份	1,700	42,993.00	0.11
306	600363	联创光电	1,200	42,936.00	0.11
307	600161	天坛生物	3,700	42,846.00	0.11
308	603728	鸣志电器	700	42,644.00	0.11
309	603341	龙旗科技	1,000	42,490.00	0.11
310	600312	平高电气	2,400	42,384.00	0.11
311	000997	新大陆	2,600	42,380.00	0.11
312	600901	江苏金租	7,340	42,205.00	0.11
313	002603	以岭药业	2,800	42,000.00	0.11
314	000528	柳工	5,500	41,525.00	0.10
315	600578	京能电力	6,400	41,280.00	0.10
316	000987	越秀资本	5,260	41,133.20	0.10

317	600329	达仁堂	1,100	40,942.00	0.10
318	603486	科沃斯	800	40,600.00	0.10
319	603816	顾家家居	1,800	40,248.00	0.10
320	600170	上海建工	18,100	40,182.00	0.10
321	000967	盈峰环境	3,800	40,014.00	0.10
322	600008	首创环保	14,690	39,956.80	0.10
323	601106	中国一重	12,100	39,930.00	0.10
324	601000	唐山港	9,600	39,840.00	0.10
325	600998	九州通	8,481	39,775.89	0.10
326	600737	中粮糖业	3,200	39,456.00	0.10
327	002152	广电运通	4,200	39,396.00	0.10
328	002262	恩华药业	2,100	39,375.00	0.10
329	600995	南网储能	3,200	39,360.00	0.10
330	000009	中国宝安	6,310	39,311.30	0.10
331	600208	衢州发展	13,800	39,054.00	0.10
332	000951	中国重汽	2,000	39,020.00	0.10
333	600282	南钢股份	8,500	39,015.00	0.10
334	688582	芯动联科	600	39,000.00	0.10
335	600398	海澜之家	7,400	38,702.00	0.10
336	600763	通策医疗	1,141	38,657.08	0.10
337	300676	华大基因	1,100	38,566.00	0.10
338	600820	隧道股份	7,400	38,554.00	0.10
339	688166	博瑞医药	1,100	38,511.00	0.10
340	000737	北方铜业	2,900	38,338.00	0.10
341	002500	山西证券	7,400	38,184.00	0.10
342	601666	平煤股份	5,300	37,895.00	0.09
343	603939	益丰药房	2,100	37,758.00	0.09
344	000513	丽珠集团	1,300	37,557.00	0.09
345	601236	红塔证券	5,500	37,510.00	0.09
346	600583	海油工程	7,400	37,222.00	0.09
347	600132	重庆啤酒	900	37,170.00	0.09

348	600435	北方导航	3,300	36,960.00	0.09
349	600602	云赛智联	2,297	36,935.76	0.09
350	300718	长盛轴承	600	36,582.00	0.09
351	000582	北部湾港	3,400	36,482.00	0.09
352	688295	中复神鹰	600	36,324.00	0.09
353	603565	中谷物流	3,700	36,297.00	0.09
354	601799	星宇股份	400	36,248.00	0.09
355	600754	锦江酒店	2,000	35,980.00	0.09
356	688192	迪哲医药	900	35,937.00	0.09
357	601567	三星电气	2,400	35,856.00	0.09
358	603444	吉比特	100	35,842.00	0.09
359	603298	杭叉集团	1,500	35,790.00	0.09
360	688363	华熙生物	1,000	35,770.00	0.09
361	601865	福莱特	3,400	35,734.00	0.09
362	600685	中船防务	1,400	35,616.00	0.09
363	000723	美锦能源	10,500	35,175.00	0.09
364	000739	普洛药业	2,100	34,986.00	0.09
365	600546	山煤国际	3,200	34,976.00	0.09
366	601880	辽港股份	25,200	34,776.00	0.09
367	600483	福能股份	3,400	34,646.00	0.09
368	688248	南网科技	500	34,590.00	0.09
369	600801	华新建材	2,200	34,320.00	0.09
370	002312	川发龙蟒	3,700	33,929.00	0.08
371	601155	新城控股	3,300	33,858.00	0.08
372	601156	东航物流	2,100	33,852.00	0.08
372	600511	国药股份	1,300	33,852.00	0.08
373	600390	五矿资本	7,400	33,744.00	0.08
374	002120	韵达股份	5,300	33,708.00	0.08
375	003022	联泓新科	1,300	33,670.00	0.08
376	603737	三棵树	1,397	33,667.70	0.08
377	600967	内蒙一机	3,100	33,635.00	0.08

378	600977	中国电影	2,600	33,592.00	0.08
379	000598	兴蓉环境	5,200	33,384.00	0.08
380	300100	双林股份	1,200	33,336.00	0.08
381	601399	国机重装	9,500	33,250.00	0.08
382	600380	健康元	3,500	32,970.00	0.08
383	000883	湖北能源	7,600	32,832.00	0.08
384	688778	厦钨新能	600	32,640.00	0.08
385	600906	财达证券	4,300	32,078.00	0.08
386	002244	滨江集团	4,200	31,920.00	0.08
387	603885	吉祥航空	3,100	31,899.00	0.08
388	002299	圣农发展	2,100	31,836.00	0.08
389	600535	天士力	2,400	31,752.00	0.08
390	600095	湘财股份	4,200	31,626.00	0.08
391	600816	建元信托	12,800	31,232.00	0.08
392	000027	深圳能源	5,000	31,000.00	0.08
393	300144	宋城演艺	5,300	30,793.00	0.08
394	600131	国网信通	2,100	30,660.00	0.08
395	601118	海南橡胶	6,200	30,504.00	0.08
396	000800	一汽解放	5,100	30,345.00	0.08
397	688281	华秦科技	600	30,138.00	0.08
398	601608	中信重工	6,300	30,051.00	0.08
399	600970	中材国际	4,200	29,946.00	0.07
400	300146	汤臣倍健	3,300	29,832.00	0.07
401	603338	浙江鼎力	700	29,750.00	0.07
402	600562	国睿科技	1,400	29,708.00	0.07
403	603233	大参林	1,972	29,639.16	0.07
404	600871	石化油服	14,600	29,638.00	0.07
405	002583	海能达	3,800	29,222.00	0.07
406	002773	康弘药业	1,400	28,630.00	0.07
407	600004	白云机场	3,900	28,314.00	0.07
408	601866	中远海发	12,600	27,846.00	0.07

409	600350	山东高速	2,500	27,825.00	0.07
410	600126	杭钢股份	4,500	27,585.00	0.07
411	002984	森麒麟	2,100	27,447.00	0.07
412	688278	特宝生物	500	27,200.00	0.07
413	600598	北大荒	2,500	27,100.00	0.07
414	600566	济川药业	1,200	26,628.00	0.07
415	000709	河钢股份	13,700	26,578.00	0.07
416	688336	三生国健	500	26,550.00	0.07
417	600663	陆家嘴	4,200	26,376.00	0.07
418	002423	中粮资本	3,200	26,336.00	0.07
419	002508	老板电器	1,800	26,316.00	0.07
420	601598	中国外运	5,300	26,288.00	0.07
421	003021	兆威机电	300	26,205.00	0.07
422	603589	口子窖	1,400	26,152.00	0.07
423	600655	豫园股份	6,300	25,893.00	0.06
424	688349	三一重能	1,700	25,806.00	0.06
425	000088	盐 田 港	6,300	25,767.00	0.06
426	600517	国网英大	5,500	25,740.00	0.06
427	002568	百润股份	1,500	25,380.00	0.06
428	000825	太钢不锈	7,400	25,234.00	0.06
429	300957	贝泰妮	800	25,208.00	0.06
430	603000	人民网	1,700	25,143.00	0.06
431	603899	晨光股份	1,200	24,756.00	0.06
432	601098	中南传媒	2,500	24,600.00	0.06
433	003035	南网能源	4,200	24,444.00	0.06
434	600968	海油发展	7,300	24,309.00	0.06
435	688561	奇安信	1,000	23,980.00	0.06
436	600848	上海临港	3,200	23,968.00	0.06
437	002032	苏 泊 尔	600	23,760.00	0.06
438	600582	天地科技	5,300	23,585.00	0.06
439	601966	玲珑轮胎	2,300	23,437.00	0.06

440	603858	步长制药	1,600	23,360.00	0.06
441	001286	陕西能源	2,300	23,322.00	0.06
442	002670	国盛证券	2,100	23,100.00	0.06
443	688709	成都华微	600	22,854.00	0.06
444	601808	中海油服	2,100	22,701.00	0.06
445	600295	鄂尔多斯	2,100	22,512.00	0.06
446	600062	华润双鹤	1,400	22,456.00	0.06
447	000539	粤电力A	3,200	21,792.00	0.05
448	601298	青岛港	2,700	21,735.00	0.05
449	600688	上海石化	7,300	21,389.00	0.05
450	688425	铁建重工	5,300	21,306.00	0.05
451	601928	凤凰传媒	2,400	21,096.00	0.05
452	603833	欧派家居	700	21,077.00	0.05
453	600808	马钢股份	8,200	20,500.00	0.05
454	688563	航材股份	400	20,492.00	0.05
455	000429	粤高速A	1,500	20,475.00	0.05
456	600292	电投水电	1,700	20,468.00	0.05
457	688708	佳驰科技	400	20,320.00	0.05
458	600098	广州发展	3,400	20,094.00	0.05
459	000959	首钢股份	5,600	19,656.00	0.05
460	002153	石基信息	2,660	19,231.80	0.05
461	600764	中国海防	1,100	19,173.00	0.05
462	002265	建设工业	1,100	19,140.00	0.05
463	300888	稳健医疗	680	19,033.20	0.05
464	600339	中油工程	6,000	18,420.00	0.05
465	301606	绿联科技	300	18,306.00	0.05
466	000537	绿发电力	2,500	18,275.00	0.05
467	601139	深圳燃气	3,200	18,112.00	0.05
468	301301	川宁生物	2,200	17,468.00	0.04
469	603658	安图生物	600	17,412.00	0.04
470	600377	宁沪高速	1,500	17,355.00	0.04

471	002608	江苏国信	2,500	17,250.00	0.04
472	000785	居然智家	8,500	17,000.00	0.04
473	600606	绿地控股	13,700	16,577.00	0.04
474	603786	科博达	400	16,364.00	0.04
475	301498	乖宝宠物	400	16,236.00	0.04
476	600032	浙江新能	2,300	16,215.00	0.04
477	300140	节能环境	3,200	15,904.00	0.04
478	603529	爱玛科技	800	15,608.00	0.04
479	601228	广州港	5,200	14,664.00	0.04
480	000898	鞍钢股份	7,700	14,399.00	0.04
481	002461	珠江啤酒	1,900	14,383.00	0.04
482	600927	永安期货	1,100	13,695.00	0.03
483	688520	神州细胞	400	13,684.00	0.03
484	688475	萤石网络	500	13,675.00	0.03
485	603049	中策橡胶	300	13,443.00	0.03
486	601019	山东出版	2,100	13,440.00	0.03
487	000937	冀中能源	3,360	13,372.80	0.03
488	601112	振石股份	700	12,761.00	0.03
489	002945	华林证券	900	12,087.00	0.03
490	600299	安迪苏	1,400	10,990.00	0.03
491	603092	德力佳	200	10,794.00	0.03
492	603175	超颖电子	100	8,909.00	0.02
493	688819	天能股份	400	8,880.00	0.02
494	001386	马可波罗	300	4,248.00	0.01
495	001221	悍高集团	100	4,022.00	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

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	001309	德明利	967,958.00	4.02
2	688498	源杰科技	722,480.00	3.00
3	301308	江波龙	702,701.00	2.92
4	300751	迈为股份	681,919.00	2.83
5	002281	光迅科技	573,054.00	2.38
6	300857	协创数据	541,627.00	2.25
7	002008	大族激光	520,610.00	2.16
8	300136	信维通信	518,409.00	2.15
9	300604	长川科技	514,266.00	2.14
10	300666	江丰电子	495,941.00	2.06
11	002850	科达利	482,048.00	2.00
12	300620	光库科技	456,224.00	1.90
13	002202	金风科技	444,395.00	1.85
14	002353	杰瑞股份	440,502.00	1.83
15	300058	蓝色光标	430,266.00	1.79
16	300570	太辰光	427,382.00	1.78
17	688361	中科飞测	417,454.62	1.73
18	000426	兴业银锡	411,914.00	1.71
19	688313	仕佳光子	411,742.30	1.71
20	300548	长芯博创	399,306.00	1.66

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	600487	亨通光电	1,116,931.00	4.64

2	301308	江波龙	1,111,209.00	4.62
3	688525	佰维存储	911,283.92	3.79
4	002353	杰瑞股份	793,663.00	3.30
5	002281	光迅科技	768,800.00	3.19
6	002008	大族激光	635,339.00	2.64
7	002156	通富微电	629,709.00	2.62
8	300604	长川科技	613,462.00	2.55
9	000657	中钨高新	607,830.00	2.53
10	300751	迈为股份	575,374.00	2.39
11	001309	德明利	566,425.00	2.35
12	300857	协创数据	559,377.00	2.32
13	002837	英维克	554,877.20	2.31
14	002202	金风科技	531,101.00	2.21
15	000426	兴业银锡	511,134.00	2.12
16	300136	信维通信	504,358.00	2.10
17	600549	厦门钨业	463,640.00	1.93
18	300570	太辰光	455,158.00	1.89
19	002850	科达利	451,926.00	1.88
20	300450	先导智能	451,854.00	1.88

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	55,594,461.92
卖出股票收入（成交）总额	52,015,205.05

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

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 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。

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	36,115.38
2	应收清算款	2,009,082.22

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	2,045,197.60

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		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	
		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
377	74,431.25	7,122,083.00	25.3811%	4,660,000.00	16.6069%	16,278,500.00	58.0120%

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	20,560,583.00
本报告期基金总申购份额	57,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	50,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	28,060,583.00

§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、本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商	交	股票交易	应支付该券商的佣金	备

名称	易单元数量	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	注
长江证券	3	37,793,011.96	35.12%	7,403.47	35.12%	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国泰海通证券(原海通)	2	69,816,655.01	64.88%	13,677.28	64.88%	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-

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，本期新增交易单元：长江证券股份有限公司1个，剔除交易单元：太平洋证券股份有限公司1个。

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

本基金本报告期间无租用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	兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	中国证监会规定的媒介	2026-01-12
2	兴业中证500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
3	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
4	兴业中证500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
5	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
6	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	中国证监会规定的媒介	2026-02-13
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	兴业中证500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	兴业中证500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聘任基金经理助理的公告	中国证监会规定的媒介	2026-05-28
13	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下基金销售业务的公告	中国证监会规定的媒介	2026-06-16
14	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
15	兴业中证500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	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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

别		20%的时间区间					
联接基金	1	20260101-20260630	11,861,600.00	49,513,600.00	45,096,700.00	16,278,500.00	58.01%
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,兴业中证500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“兴业中证500ETF”，变更后扩位简称“中证500ETF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

二〇二六年八月二十九日