兴业中证 A500 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:中信证券股份有限公司

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。

基金托管人中信证券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 7
3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 7
§4 管理人报告 8
4.1 基金管理人及基金经理情况 9
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 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） 12
6.1 资产负债表 12
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 38
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 40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 59
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 59
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 59
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 59
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 59
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 59
7.12 投资组合报告附注 59
§8 基金份额持有人信息 60

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 61
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 61
§9 开放式基金份额变动 61
§10 重大事件揭示 61
10.1 基金份额持有人大会决议 61
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 62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 62
10.4 基金投资策略的改变 62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 62
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 62
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 63
10.8 其他重大事件 63
§11 影响投资者决策的其他重要信息 65
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 65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 65
§12 备查文件目录 65
12.1 备查文件目录 65
12.2 存放地点 66
12.3 查阅方式 66

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴业中证A500交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	兴业中证A500ETF（证券简称：A500中证；扩位证券简称：中证A500ETF兴业）
场内简称	A500中证（扩位证券简称：中证A500ETF兴业）
基金主代码	563650
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025年03月25日
基金管理人	兴业基金管理有限公司
基金托管人	中信证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	113,909,000.00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	2025年04月03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。
投资策略	本基金采用完全复制法，即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。当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。主要投资策略包括：1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、存托凭证投资策略；4、债券投资策略；5、可转换债券、可交换债券投资策略；6、资产支持证券投资策略；7、衍生品投资策略；8、参与融资与转融通

	证券出借业务策略。
业绩比较基准	中证A500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	中信证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张顺国	杨军智
	联系电话	021-22211888	010-60834299
	电子邮箱	zhaoyue@cib-fund.com.cn	yjz@citics.com
客户服务电话		40000-95561	010-60836588
传真		021-22211997	010-60834004
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	广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座
办公地址		上海市浦东新区银城路167号13、14层	北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦5层
邮政编码		200120	100125
法定代表人		刘宗治	张佑君

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金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	11,435,747.31
本期利润	16,742,914.78
加权平均基金份额本期利润	0.1666
本期加权平均净值利润率	12.59%
本期基金份额净值增长率	12.45%
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	30,107,901.15
期末可供分配基金份额利润	0.2643
期末基金资产净值	161,196,937.71
期末基金份额净值	1.4151
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	41.51%

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	14.89%	1.39%	14.26%	1.41%	0.63%	-0.02%
过去六个月	12.45%	1.27%	11.91%	1.29%	0.54%	-0.02%
过去一年	39.27%	1.14%	36.38%	1.14%	2.89%	0.00%
自基金合同生效起至今	41.51%	1.14%	35.46%	1.15%	6.05%	-0.01%

注：本基金的业绩比较基准为：中证A500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



注：根据本基金基金合同规定，基金管理人自基金合同生效之日起6个月内已使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

§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	2025-03-25	-	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，中证A500的前三大行业为电子、通信和电力设备，占比分别为25.3%、10.2%和10%，相比25年末的，电子权重提升了约12%，通信权重提升了约4%。

从估值的角度看，当前中证A500的PE-TTM分位数为17.9，加权PE-TTM为95.5。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A500指数从沪深两市选取市值较大、流动性较好的500只证券作为指数样本，以反映各行业最具代表性上市公司证券的整体表现。

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A500ETF（证券简称：A500中证；扩位证券简称：中证A500ETF兴业）基金份额净值为1.4151元，本报告期内，基金份额净值增长率为12.45%，同期业绩比较基准收益率为11.91%。

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

本报告期内，中信证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在对兴业中证A500交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、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，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，由兴业基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关兴业中证A500交易型开放式指数证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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A500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	上年度末

		2026年06月30日	2025年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	2,151,109.42	1,701,501.27
结算备付金		2,531.51	2,531.51
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	159,683,552.00	134,445,155.25
其中：股票投资		159,683,552.00	134,445,155.25
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		-	-
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		161,837,192.93	136,149,188.03
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		-	20,689.73
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		19,310.05	17,441.12

应付托管费		6,436.69	5,813.71
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	614,508.48	312,819.55
负债合计		640,255.22	356,764.11
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	113,909,000.00	107,909,000.00
未分配利润	6.4.7.8	47,287,937.71	27,883,423.92
净资产合计		161,196,937.71	135,792,423.92
负债和净资产总计		161,837,192.93	136,149,188.03

注：报告截止日2026年6月30日，基金份额净值1.4151元，基金份额总额113,909,000.00份。

6.2 利润表

会计主体：兴业中证A500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03月25日（基金合同生效日）至2025年06月30日
一、营业总收入		16,961,089.48	2,270,837.53
1.利息收入		978.02	121,851.78
其中：存款利息收入	6.4.7.9	978.02	121,851.78
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）		11,744,395.43	-1,634,899.12
其中：股票投资收益	6.4.7.10	10,518,454.96	-4,503,556.34
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	1,225,940.47	2,868,657.22
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	5,307,167.47	3,586,334.09
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	-91,451.44	197,550.78
减：二、营业总支出		218,174.70	203,902.31
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	98,545.68	117,440.85
2.托管费	6.4.10.2.2	32,848.57	39,146.90
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	86,780.45	47,314.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		16,742,914.78	2,066,935.22

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		16,742,914.78	2,066,935.22
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		16,742,914.78	2,066,935.22

注：本财务报表的上年度可比期间为2025年3月25日(基金合同生效日)至2025年6月30日。上年度可比期间不是完整报告期，上年度可比期间按实际存续期计算。

6.3 净资产变动表

会计主体：兴业中证A500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	107,909,000.00	27,883,423.92	135,792,423.92
二、本期期初净资产	107,909,000.00	27,883,423.92	135,792,423.92
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	6,000,000.00	19,404,513.79	25,404,513.79
（一）、综合收益总额	-	16,742,914.78	16,742,914.78
（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）	6,000,000.00	2,661,599.01	8,661,599.01
其中：1.基金申购款	48,000,000.00	17,272,464.17	65,272,464.17
2.基金赎回款	-42,000,000.00	-14,610,865.16	-56,610,865.16

（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	113,909,000.00	47,287,937.71	161,196,937.71
项 目	上年度可比期间 2025年03月25日（基金合同生效日）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	-	-	-
二、本期期初净资产	434,909,000.00	-	434,909,000.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-180,000,000.00	4,111,617.74	-175,888,382.26
（一）、综合收益总额	-	2,066,935.22	2,066,935.22
（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）	-180,000,000.00	2,044,682.52	-177,955,317.48
其中：1.基金申购款	264,000,000.00	-1,797,371.74	262,202,628.26
2.基金赎回款	-444,000,000.00	3,842,054.26	-440,157,945.74
（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	254,909,000.00	4,111,617.74	259,020,617.74

产			

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A500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A500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”)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”)以证监许可[2024]1756号文准予募集注册。本基金为契约型，交易型开放式基金，存续期限为不定期，首次设立募集基金份额为434,909,000.00份，经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了编号为德师报(验)字(25)第00075号的验资报告。基金合同于2025年3月25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，基金托管人为中信证券股份有限公司。

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A500交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围主要为标的指数成份股和备选成份股(均含存托凭证)。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股(包含主板、科创板、创业板及其他经中国证监会允许发行的股票)、存托凭证、债券(国债、央行票据、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券(含超短期融资券)、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、衍生工具(股指期货、国债期货等)、货币市场工具以及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相关规定)。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股(均含存托凭证)的比例不得低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%。如法律法规对该比例要求有变更的，在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。本基金的业绩比较基准为标的指数，即中证A500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6月30日的财务状况以及2026年1月1日至2026年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

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	94,653.09
等于：本金	94,627.36

加：应计利息	25.73
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	2,056,456.33
等于：本金	2,056,424.37
加：应计利息	31.96
减：坏账准备	-
合计	2,151,109.42

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		137,397,970.78	-	159,683,552.00	22,285,581.22
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		137,397,970.78	-	159,683,552.00	22,285,581.22

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	86,780.45
可退替代款	33,780.82
应退替代款	489,001.21
其他应付	4,946.00
合计	614,508.48

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	107,909,000.00	107,909,000.00
本期申购	48,000,000.00	48,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-42,000,000.00	-42,000,000.00

本期末	113,909,000.00	113,909,000.00

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

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	16,258,304.29	11,625,119.63	27,883,423.92
本期期初	16,258,304.29	11,625,119.63	27,883,423.92
本期利润	11,435,747.31	5,307,167.47	16,742,914.78
本期基金份额交易产生的变动数	2,413,849.55	247,749.46	2,661,599.01
其中：基金申购款	11,040,104.82	6,232,359.35	17,272,464.17
基金赎回款	-8,626,255.27	-5,984,609.89	-14,610,865.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	30,107,901.15	17,180,036.56	47,287,937.71

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	199.30
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	778.72
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	978.02

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	7,596,716.33
股票投资收益——赎回差价收入	2,921,738.63
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	10,518,454.96

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	40,489,258.02
减：卖出股票成本总额	32,860,663.10
减：交易费用	31,878.59
买卖股票差价收入	7,596,716.33

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	56,610,865.16
减：现金支付赎回款总额	28,109,045.16
减：赎回股票成本总额	25,580,081.37
减：交易费用	-
赎回差价收入	2,921,738.63

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

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

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	1,225,940.47
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,225,940.47

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	5,307,167.47
——股票投资	5,307,167.47
——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	5,307,167.47

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	-91,451.44
合计	-91,451.44

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

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
IOPV计算与发布费	9,916.99
合计	86,780.45

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
中信证券股份有限公司(以下简称"中信证券")	基金托管人、基金销售机构
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A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的联接基金
兴业期货有限公司(以下简称"兴业期货")	基金管理人的控股股东控制的公司
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

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

本基金本报告期内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

本基金本报告期内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03月25日（基金合同生效日）至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	98,545.68	117,440.85

其中：应支付销售机构的客户维护费	5,556.01	85.77
应支付基金管理人的净管理费	92,989.67	117,355.08

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0.15%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×0.15%÷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03月25日（基金合同生效日）至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	32,848.57	39,146.90

注：支付基金托管人中信证券的基金托管费按前一日基金资产净值0.05%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×0.05%÷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

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易的情况。

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A500交易	94,256,100.00	82.75%	68,470,300.00	63.45%

型开放式指数证券投资基金联接基金				

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03月25日（基金合同生效日）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
中信证券股份有限公司	94,653.09	199.30	597,363.76	89,452.90

注：本基金的活期银行存款存放在基金托管人中信证券在兴业银行开立的托管账户中。

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)81,800股，占本基金资产净值的0.84%；本报告期末，本基金持有基金托管人发行的股票中信证券(600030.SH)47,100股，占本基金资产净值的0.84%；本报告期末，本基金持有基金管理人的股东发行的股票中远海发(601866.SH)18,500股，占本基金资产净值的0.03%。本基金本报告期末存放于兴业期货的结算备付金金额为人民币2,531.51元。本基金本报告期无通过兴业期货买卖期货成交额，当期未发生应支付给兴业期货的交易费用，本报告期末无应付兴业期货的交易费用余额。

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001399	惠科股份	2026-06-16	6个月	新股锁定	10.12	27.73	779	7,883.48	21,601.67	-
688635	长进光子	2026-05-20	6个月	科创板打新限售	40.98	308.19	51	2,089.98	15,717.69	-
603459	红板科技	2026-03-31	6个月	新股锁定	17.70	84.32	74	1,309.80	6,239.68	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6个月	科创板打新限售	17.52	35.92	83	1,454.16	2,981.36	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6个月	新股锁定	15.76	46.71	52	819.52	2,428.92	-
601112	振石股份	2026-01-21	6个月	新股锁定	11.18	17.59	120	1,341.60	2,110.80	-
688781	视涯科技	2026-03-18	6个月	科创板打新限售	22.68	47.61	36	816.48	1,713.96	-
001220	世盟股份	2026-01-27	6个月	新股锁定	28.00	27.78	33	924.00	916.74	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6个月	新股锁定	33.49	33.93	20	669.80	678.60	-

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	股	停	停	期	复	复	数量	期末成本总	期末估值总	备

票代码	票名称	牌日期	牌原因	末估值单价	牌日期	牌开盘单价	（股）	额	额	注
688072	拓荆科技	2026-06-29	-	832.00	2026-07-13	890.99	1,000	405,992.66	832,000.00	-

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、存出保证金及债券投资等。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	2,151,109.42	-	-	-	2,151,109.42
结算备付金	2,531.51	-	-	-	2,531.51
交易性金融资产	-	-	-	159,683,552.00	159,683,552.00
资产总计	2,153,640.93	-	-	159,683,552.00	161,837,192.93
负债					

应付管理人报酬	-	-	-	19,310.05	19,310.05
应付托管费	-	-	-	6,436.69	6,436.69
其他负债	-	-	-	91,726.45	91,726.45
应付证券清算款	-	-	-	522,782.03	522,782.03
负债总计	-	-	-	640,255.22	640,255.22
利率敏感度缺口	2,153,640.93	-	-	159,043,296.78	161,196,937.71
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	1,701,501.27	-	-	-	1,701,501.27
结算备付金	2,531.51	-	-	-	2,531.51
交易性金融资产	-	-	-	134,445,155.25	134,445,155.25
资产总计	1,704,032.78	-	-	134,445,155.25	136,149,188.03
负债					
应付清算款	-	-	-	20,689.73	20,689.73
应付管理人报酬	-	-	-	17,441.12	17,441.12
应付托管费	-	-	-	5,813.71	5,813.71

其他负债	-	-	-	312,819.55	312,819.55
负债总计	-	-	-	356,764.11	356,764.11
利率敏感度缺口	1,704,032.78	-	-	134,088,391.14	135,792,423.92

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	159,683,552.00	99.06	134,445,155.25	99.01
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	159,683,552.00	99.06	134,445,155.25	99.01

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%	7,984,222.71	6,722,257.76
	股票价格下降5%	-7,984,222.71	-6,722,257.76

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	158,797,162.58	133,532,996.27
第二层次	832,000.00	832,785.00
第三层次	54,389.42	79,373.98
合计	159,683,552.00	134,445,155.25

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	159,683,552.00	98.67
	其中：股票	159,683,552.00	98.67
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	2,153,640.93	1.33
8	其他各项资产	-	-
9	合计	161,837,192.93	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	504,092.00	0.31
B	采矿业	6,533,237.10	4.05
C	制造业	112,931,618.25	70.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,484,429.00	2.16
E	建筑业	1,940,377.00	1.20
F	批发和零售业	1,227,452.00	0.76
G	交通运输、仓储和邮政业	3,510,051.00	2.18
H	住宿和餐饮业	72,723.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,913,720.60	5.53
J	金融业	15,519,075.00	9.63
K	房地产业	879,010.00	0.55

L	租赁和商务服务业	1,149,618.40	0.71
M	科学研究和技术服务业	1,915,962.00	1.19
N	水利、环境和公共设施管理业	269,263.40	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	53,460.00	0.03
Q	卫生和社会工作	313,449.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	122,895.00	0.08
S	综合	289,632.00	0.18
	合计	159,630,064.75	99.03

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	53,472.68	0.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	916.74	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	54,389.42	0.03

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	5,400	6,858,000.00	4.25
2	300750	宁德时代	12,800	5,030,528.00	3.12
3	300502	新易盛	6,700	4,066,900.00	2.52
4	600519	贵州茅台	3,000	3,556,470.00	2.21
5	603986	兆易创新	3,200	2,608,000.00	1.62
6	601318	中国平安	51,500	2,458,610.00	1.53
7	688256	寒武纪	1,492	2,380,560.60	1.48
8	600036	招商银行	59,800	2,122,900.00	1.32
9	601899	紫金矿业	79,600	2,001,144.00	1.24
10	002371	北方华创	2,100	1,857,576.00	1.15
11	000333	美的集团	23,500	1,774,955.00	1.10
12	002475	立讯精密	24,700	1,738,880.00	1.08
13	688012	中微公司	3,682	1,725,017.00	1.07
14	688008	澜起科技	5,500	1,704,450.00	1.06
15	688041	海光信息	4,400	1,629,320.00	1.01
16	002384	东山精密	6,200	1,626,570.00	1.01
17	600900	长江电力	59,200	1,567,024.00	0.97

18	688981	中芯国际	9,687	1,538,489.34	0.95
19	000725	京东方A	176,500	1,532,020.00	0.95
20	603259	药明康德	12,000	1,494,120.00	0.93
21	601166	兴业银行	81,800	1,354,608.00	0.84
22	600030	中信证券	47,100	1,353,183.00	0.84
23	300059	东方财富	61,100	1,245,218.00	0.77
24	600183	生益科技	7,000	1,213,800.00	0.75
25	600276	恒瑞医药	21,700	1,129,268.00	0.70
26	300274	阳光电源	7,000	1,113,140.00	0.69
27	601398	工商银行	156,200	1,104,334.00	0.69
28	300408	三环集团	6,500	1,084,850.00	0.67
29	300476	胜宏科技	3,000	1,039,290.00	0.64
30	600487	亨通光电	9,500	1,038,730.00	0.64
31	002594	比亚迪	13,000	1,036,100.00	0.64
32	601211	国泰海通	54,600	993,720.00	0.62
33	002463	沪电股份	6,500	993,200.00	0.62
34	300394	天孚通信	3,180	962,522.40	0.60
35	688525	佰维存储	1,900	939,987.00	0.58
36	000988	华工科技	4,900	904,589.00	0.56
37	601288	农业银行	139,600	847,372.00	0.53
38	600176	中国巨石	11,600	845,408.00	0.52
39	301308	江波龙	1,200	844,560.00	0.52
40	601328	交通银行	129,600	833,328.00	0.52
41	688072	拓荆科技	1,000	832,000.00	0.52
42	000651	格力电器	21,600	810,000.00	0.50
43	600522	中天科技	13,200	800,976.00	0.50
44	688521	芯原股份	2,100	779,394.00	0.48
45	603019	中科曙光	7,100	761,333.00	0.47
46	688498	源杰科技	400	754,400.00	0.47
47	600150	中国船舶	21,789	736,250.31	0.46
48	603993	洛阳钼业	41,800	733,590.00	0.46

49	600887	伊利股份	30,400	728,384.00	0.45
50	300604	长川科技	2,100	716,982.00	0.44
51	600584	长电科技	6,900	714,495.00	0.44
52	000338	潍柴动力	26,000	708,500.00	0.44
53	000858	五粮液	9,400	695,600.00	0.43
54	688347	华虹宏力	2,000	672,600.00	0.42
55	688120	华海清科	2,000	644,360.00	0.40
56	601816	京沪高铁	140,600	636,918.00	0.40
57	600309	万华化学	9,100	622,531.00	0.39
58	300124	汇川技术	9,200	610,236.00	0.38
59	002415	海康威视	17,800	608,760.00	0.38
60	002008	大族激光	4,000	600,440.00	0.37
61	002916	深南电路	1,300	595,270.00	0.37
62	002281	光迅科技	2,300	590,962.00	0.37
63	600111	北方稀土	12,200	586,210.00	0.36
64	000100	TCL科技	100,500	584,910.00	0.36
65	300857	协创数据	1,700	577,830.00	0.36
66	300136	信维通信	4,700	560,475.00	0.35
67	600000	浦发银行	64,300	553,623.00	0.34
68	000063	中兴通讯	15,200	550,088.00	0.34
69	600089	特变电工	24,400	549,000.00	0.34
70	601857	中国石油	61,900	537,292.00	0.33
71	601088	中国神华	13,300	519,232.00	0.32
72	002028	思源电气	3,000	519,000.00	0.32
73	300433	蓝思科技	9,580	514,062.80	0.32
74	600031	三一重工	28,640	494,899.20	0.31
75	300475	香农芯创	1,600	480,000.00	0.30
76	300014	亿纬锂能	7,300	474,719.00	0.29
77	601601	中国太保	16,600	473,432.00	0.29
78	002050	三花智控	10,800	473,364.00	0.29
79	300223	北京君正	1,900	472,910.00	0.29

80	000001	平安银行	46,800	470,340.00	0.29
81	002714	牧原股份	13,200	461,868.00	0.29
82	600549	厦门钨业	5,400	460,080.00	0.29
83	000792	盐湖股份	15,200	458,888.00	0.28
84	002353	杰瑞股份	3,000	457,500.00	0.28
85	002156	通富微电	5,800	440,046.00	0.27
86	601668	中国建筑	100,000	434,000.00	0.27
87	600406	国电南瑞	18,600	425,010.00	0.26
88	000657	中钨高新	4,400	421,168.00	0.26
89	002436	兴森科技	8,200	417,790.00	0.26
90	601919	中远海控	30,400	403,104.00	0.25
91	002602	世纪华通	28,400	400,440.00	0.25
92	601988	中国银行	69,500	397,540.00	0.25
93	300760	迈瑞医疗	2,900	393,907.00	0.24
94	300054	鼎龙股份	3,700	392,089.00	0.24
95	603501	豪威集团	4,100	388,885.00	0.24
96	601012	隆基绿能	29,400	385,728.00	0.24
97	601728	中国电信	74,000	384,060.00	0.24
98	600660	福耀玻璃	7,600	383,344.00	0.24
99	601225	陕西煤业	18,700	380,545.00	0.24
100	002230	科大讯飞	9,300	379,812.00	0.24
101	600941	中国移动	4,400	378,972.00	0.24
102	600690	海尔智家	18,200	371,462.00	0.23
103	300757	罗博特科	600	371,400.00	0.23
104	300033	同花顺	1,500	361,500.00	0.22
105	601985	中国核电	39,900	360,297.00	0.22
106	002460	赣锋锂业	5,500	359,700.00	0.22
107	002938	鹏鼎控股	3,400	358,292.00	0.22
108	002352	顺丰控股	11,400	356,364.00	0.22
109	002709	天赐材料	6,900	354,867.00	0.22
110	688777	中控技术	3,000	352,500.00	0.22

111	603799	华友钴业	7,300	352,298.00	0.22
112	000977	浪潮信息	5,000	350,000.00	0.22
113	600160	巨化股份	6,500	344,565.00	0.21
114	002851	麦格米特	2,000	334,360.00	0.21
115	300442	润泽科技	3,900	323,973.00	0.20
116	000425	徐工机械	39,700	321,173.00	0.20
117	688126	沪硅产业	8,000	319,120.00	0.20
118	002202	金风科技	13,200	315,480.00	0.20
119	000938	紫光股份	10,900	314,574.00	0.20
120	601600	中国铝业	38,200	314,004.00	0.19
121	600028	中国石化	70,300	313,538.00	0.19
122	600938	中国海油	11,400	309,510.00	0.19
123	002600	领益智造	17,700	306,918.00	0.19
124	601766	中国中车	59,000	306,800.00	0.19
125	002466	天齐锂业	5,000	306,600.00	0.19
126	600460	士兰微	5,600	306,096.00	0.19
127	300661	圣邦股份	2,120	304,177.60	0.19
128	300346	南大光电	3,280	303,892.00	0.19
129	600050	中国联通	75,300	301,200.00	0.19
130	002837	英维克	3,740	297,554.40	0.18
131	688002	睿创微纳	1,900	293,911.00	0.18
132	002049	紫光国微	3,300	292,875.00	0.18
133	002080	中材科技	3,200	288,000.00	0.18
134	002407	多氟多	5,700	286,311.00	0.18
135	300567	精测电子	900	285,840.00	0.18
136	002179	中航光电	6,100	281,820.00	0.17
137	601100	恒立液压	2,600	279,656.00	0.17
138	000568	泸州老窖	3,600	279,072.00	0.17
139	002138	顺络电子	3,800	277,780.00	0.17
140	601628	中国人寿	7,800	275,730.00	0.17
141	002185	华天科技	12,300	274,413.00	0.17

142	603288	海天味业	8,100	268,596.00	0.17
143	300395	菲利华	2,000	267,460.00	0.17
144	000408	藏格矿业	3,800	263,416.00	0.16
145	601658	邮储银行	53,300	262,769.00	0.16
146	600879	航天电子	12,300	261,867.00	0.16
147	300390	天华新能	2,800	261,828.00	0.16
148	601006	大秦铁路	56,500	260,465.00	0.16
149	601872	招商轮船	14,800	260,036.00	0.16
150	002241	歌尔股份	11,400	256,842.00	0.16
151	688469	芯联集成	24,200	256,762.00	0.16
152	688111	金山办公	1,200	255,660.00	0.16
153	600905	三峡能源	68,900	255,619.00	0.16
154	600489	中金黄金	14,100	254,505.00	0.16
155	688271	联影医疗	2,500	253,075.00	0.16
156	601888	中国中免	4,700	252,437.00	0.16
157	605117	德业股份	2,372	251,858.96	0.16
158	002625	光启技术	8,300	251,656.00	0.16
159	688017	绿的谐波	600	250,716.00	0.16
160	000630	铜陵有色	38,900	247,404.00	0.15
161	600893	航发动力	6,400	245,376.00	0.15
162	600673	东阳光	7,300	245,134.00	0.15
163	600010	包钢股份	109,500	244,185.00	0.15
164	688396	华润微	2,500	243,875.00	0.15
165	601127	赛力斯	3,900	238,875.00	0.15
166	300058	蓝色光标	17,340	238,598.40	0.15
167	002273	水晶光电	6,700	237,716.00	0.15
168	002027	分众传媒	48,800	236,192.00	0.15
169	300037	新宙邦	2,500	232,125.00	0.14
170	600118	中国卫星	2,800	229,740.00	0.14
171	600019	宝钢股份	42,100	228,603.00	0.14
172	000426	兴业银锡	6,900	227,424.00	0.14

173	600760	中航沈飞	5,500	226,050.00	0.14
174	300751	迈为股份	800	225,968.00	0.14
175	601689	拓普集团	4,000	225,680.00	0.14
176	000807	云铝股份	10,100	223,614.00	0.14
177	600104	上汽集团	22,200	216,672.00	0.13
178	600362	江西铜业	5,000	216,500.00	0.13
179	688099	晶晨股份	2,100	216,090.00	0.13
180	300450	先导智能	5,300	215,816.00	0.13
181	600989	宝丰能源	10,600	215,498.00	0.13
182	600875	东方电气	7,400	212,898.00	0.13
183	601727	上海电气	30,400	212,800.00	0.13
184	002001	新 和 成	7,400	210,308.00	0.13
185	605589	圣泉集团	3,300	209,781.00	0.13
186	002422	科伦药业	5,400	208,008.00	0.13
187	600885	宏发股份	6,000	206,940.00	0.13
188	002738	中矿资源	3,500	206,465.00	0.13
189	601168	西部矿业	7,600	206,264.00	0.13
190	600988	赤峰黄金	7,800	205,296.00	0.13
191	000960	锡业股份	4,800	204,912.00	0.13
192	601390	中国中铁	49,100	204,747.00	0.13
193	600667	太极实业	7,000	204,260.00	0.13
194	002126	银轮股份	4,100	204,180.00	0.13
195	000538	云南白药	4,300	203,691.00	0.13
196	600392	盛和资源	6,800	202,436.00	0.13
197	000831	中国稀土	3,600	199,764.00	0.12
198	600795	国电电力	42,400	198,008.00	0.12
199	600418	江淮汽车	7,600	196,308.00	0.12
200	600547	山东黄金	8,400	193,956.00	0.12
201	300316	晶盛机电	3,200	193,280.00	0.12
202	600585	海螺水泥	11,400	193,230.00	0.12
203	600141	兴发集团	4,100	192,577.00	0.12

204	601669	中国电建	40,700	191,290.00	0.12
205	002812	恩捷股份	2,800	187,348.00	0.12
206	300015	爱尔眼科	22,600	186,676.00	0.12
207	300782	卓胜微	1,700	186,286.00	0.12
208	600096	云天化	6,100	185,440.00	0.12
209	002648	卫星化学	7,800	183,222.00	0.11
210	002129	TCL中环	15,200	182,704.00	0.11
211	301358	湖南裕能	2,400	182,088.00	0.11
212	600346	恒力石化	10,200	180,642.00	0.11
213	600482	中国动力	5,500	180,400.00	0.11
214	601868	中国能建	67,400	179,958.00	0.11
215	000066	中国长城	9,400	179,070.00	0.11
216	600497	驰宏锌锗	14,700	178,017.00	0.11
217	002558	巨人网络	6,400	176,384.00	0.11
218	600580	卧龙电驱	5,300	175,430.00	0.11
219	601179	中国西电	11,700	174,564.00	0.11
220	002195	岩山科技	26,600	173,964.00	0.11
221	000625	长安汽车	24,100	172,797.00	0.11
222	600426	华鲁恒升	7,200	172,224.00	0.11
223	600066	宇通客车	6,400	171,584.00	0.11
224	600157	永泰能源	105,800	170,338.00	0.11
225	300418	昆仑万维	4,200	169,512.00	0.11
226	600221	海航控股	124,500	168,075.00	0.10
227	000157	中联重科	24,100	167,977.00	0.10
228	002532	天山铝业	15,500	166,315.00	0.10
229	605499	东鹏饮料	1,340	165,396.20	0.10
230	002340	格林美	24,800	163,928.00	0.10
231	600436	片仔癀	1,500	163,920.00	0.10
232	600895	张江高科	4,400	163,900.00	0.10
233	600011	华能国际	21,400	162,426.00	0.10
234	002821	凯莱英	1,000	162,000.00	0.10

235	000933	神火股份	7,600	161,120.00	0.10
236	600711	盛屯矿业	14,600	160,162.00	0.10
237	688036	传音控股	2,700	159,165.00	0.10
238	600143	金发科技	10,300	159,135.00	0.10
239	002236	大华股份	9,500	156,655.00	0.10
240	600438	通威股份	12,900	156,219.00	0.10
241	002493	荣盛石化	14,500	155,875.00	0.10
242	300803	指南针	1,700	155,839.00	0.10
243	600115	中国东航	40,700	155,067.00	0.10
244	002131	利欧股份	32,600	154,850.00	0.10
245	600570	恒生电子	7,300	154,687.00	0.10
246	688047	龙芯中科	1,000	154,670.00	0.10
247	600048	保利发展	33,300	154,179.00	0.10
248	688235	百济神州	600	152,766.00	0.09
249	002456	欧菲光	16,100	152,306.00	0.09
250	600886	国投电力	11,300	150,403.00	0.09
251	688213	思特威	1,400	149,898.00	0.09
252	601233	桐昆股份	6,900	149,385.00	0.09
253	003816	中国广核	38,000	148,580.00	0.09
254	300017	网宿科技	11,400	148,314.00	0.09
255	600352	浙江龙盛	12,200	147,742.00	0.09
256	601360	三六零	17,000	147,730.00	0.09
257	300339	润和软件	3,800	146,338.00	0.09
258	002074	国轩高科	5,300	145,803.00	0.09
259	000301	东方盛虹	12,700	145,415.00	0.09
260	603659	璞泰来	5,000	144,650.00	0.09
260	300759	康龙化成	5,000	144,650.00	0.09
261	688122	西部超导	2,300	144,463.00	0.09
262	601058	赛轮轮胎	12,500	144,125.00	0.09
263	688578	艾力斯	1,300	141,960.00	0.09
264	002555	三七互娱	7,500	141,525.00	0.09

265	300438	鹏辉能源	1,700	140,845.00	0.09
266	600009	上海机场	6,000	138,600.00	0.09
267	000768	中航西飞	6,700	137,216.00	0.09
268	600196	复星医药	6,100	137,067.00	0.09
269	002472	双环传动	3,300	136,983.00	0.08
270	300207	欣旺达	7,200	136,728.00	0.08
271	600026	中远海能	7,600	136,344.00	0.08
272	300001	特锐德	3,600	136,188.00	0.08
273	002517	恺英网络	8,300	134,875.00	0.08
274	601111	中国国航	22,200	134,310.00	0.08
275	300458	全志科技	3,400	134,164.00	0.08
276	600029	南方航空	25,900	134,162.00	0.08
277	600674	川投能源	9,400	133,198.00	0.08
278	600219	南山铝业	33,300	132,867.00	0.08
279	000975	山金国际	7,800	132,600.00	0.08
280	601186	中国铁建	22,200	132,090.00	0.08
281	002595	豪迈科技	2,830	131,878.00	0.08
282	601117	中国化学	17,800	130,830.00	0.08
283	601877	正泰电器	5,200	130,364.00	0.08
284	600415	小商品城	12,800	130,048.00	0.08
285	002128	电投能源	5,600	129,472.00	0.08
286	002601	龙佰集团	7,800	128,544.00	0.08
287	300115	长盈精密	4,600	128,524.00	0.08
288	603129	春风动力	500	127,900.00	0.08
289	301236	软通动力	3,000	127,350.00	0.08
290	600372	中航机载	11,700	126,945.00	0.08
291	300454	深信服	1,300	125,060.00	0.08
292	600233	圆通速递	7,800	122,850.00	0.08
293	002155	湖南黄金	5,130	122,453.10	0.08
294	300568	星源材质	6,500	121,680.00	0.08
295	002465	海格通信	9,500	121,315.00	0.08

296	600839	四川长虹	17,300	120,754.00	0.07
297	300347	泰格医药	2,500	120,000.00	0.07
298	000547	航天发展	6,200	118,730.00	0.07
299	688676	金盘科技	1,400	118,496.00	0.07
300	000963	华东医药	4,200	118,104.00	0.07
301	600741	华域汽车	7,600	117,952.00	0.07
302	688506	百利天恒	400	117,612.00	0.07
303	603650	彤程新材	1,200	117,576.00	0.07
304	688331	荣昌生物	900	117,234.00	0.07
305	300024	机器人	6,000	115,980.00	0.07
306	002130	沃尔核材	6,100	115,656.00	0.07
307	002920	德赛西威	1,400	114,100.00	0.07
308	002497	雅化集团	5,600	114,072.00	0.07
309	002432	九安医疗	1,600	113,088.00	0.07
310	001979	招商蛇口	17,400	111,882.00	0.07
311	000878	云南铜业	6,900	109,572.00	0.07
312	601021	春秋航空	2,400	109,392.00	0.07
313	300763	锦浪科技	1,200	108,420.00	0.07
314	300012	华测检测	7,800	108,108.00	0.07
315	002271	东方雨虹	9,100	108,017.00	0.07
316	000661	长春高新	1,600	106,560.00	0.07
317	603979	金诚信	1,800	106,254.00	0.07
318	000034	神州数码	3,820	106,005.00	0.07
319	002444	巨星科技	3,400	105,740.00	0.07
320	300496	中科创达	1,700	105,043.00	0.07
321	688266	泽璟制药	900	104,994.00	0.07
322	300866	安克创新	1,000	104,500.00	0.06
323	300083	创世纪	7,600	103,512.00	0.06
324	002414	高德红外	7,800	103,428.00	0.06
325	300474	景嘉微	1,700	102,816.00	0.06
326	002756	永兴材料	1,800	101,952.00	0.06

326	000733	振华科技	1,800	101,952.00	0.06
327	300748	金力永磁	3,300	101,805.00	0.06
328	300073	当升科技	2,100	100,884.00	0.06
329	300432	富临精工	5,000	100,450.00	0.06
330	688608	恒玄科技	600	100,314.00	0.06
331	601319	中国人保	14,800	100,048.00	0.06
332	300142	沃森生物	7,700	100,023.00	0.06
333	600699	均胜电子	4,600	99,406.00	0.06
334	002025	航天电器	1,300	99,086.00	0.06
335	603606	东方电缆	2,380	98,793.80	0.06
336	600039	四川路桥	12,500	97,750.00	0.06
337	002078	太阳纸业	7,800	97,422.00	0.06
338	601800	中国交建	17,000	97,070.00	0.06
339	000002	万科A	32,700	96,792.00	0.06
340	002252	上海莱士	22,300	96,782.00	0.06
341	603087	甘李药业	1,700	96,492.00	0.06
342	601677	明泰铝业	5,800	96,280.00	0.06
343	300919	中伟新材	2,200	96,250.00	0.06
344	600226	亨通股份	10,000	95,900.00	0.06
345	688599	天合光能	6,773	95,634.76	0.06
346	000423	东阿阿胶	2,100	95,256.00	0.06
347	688169	石头科技	1,000	94,970.00	0.06
348	601615	明阳智能	8,200	94,874.00	0.06
349	300724	捷佳伟创	1,300	91,780.00	0.06
350	002064	华峰化学	9,600	91,104.00	0.06
351	600588	用友网络	9,800	89,964.00	0.06
352	001965	招商公路	9,800	89,768.00	0.06
353	688188	柏楚电子	840	89,628.00	0.06
354	688223	晶科能源	18,826	89,423.50	0.06
355	002831	裕同科技	2,500	88,900.00	0.06
356	000786	北新建材	4,900	88,641.00	0.05

357	688390	固德威	800	86,808.00	0.05
358	300972	万辰集团	500	86,705.00	0.05
359	300677	英科医疗	2,200	86,174.00	0.05
360	688065	凯赛生物	1,800	86,130.00	0.05
361	002294	信立泰	2,700	86,103.00	0.05
362	601633	长城汽车	5,700	86,013.00	0.05
363	603806	福斯特	5,100	85,629.00	0.05
364	688180	君实生物	2,500	84,550.00	0.05
365	601618	中国中冶	34,200	83,448.00	0.05
366	600516	方大炭素	13,500	83,295.00	0.05
367	002176	江特电机	8,300	83,083.00	0.05
368	000519	中兵红箭	3,900	82,173.00	0.05
369	603260	合盛硅业	1,700	82,042.00	0.05
370	302132	中航成飞	1,400	81,648.00	0.05
371	000623	吉林敖东	4,600	81,558.00	0.05
372	600177	雅戈尔	10,800	81,324.00	0.05
373	300699	光威复材	2,800	80,220.00	0.05
374	300342	天银机电	1,700	79,900.00	0.05
375	002085	万丰奥威	7,200	79,848.00	0.05
376	300832	新产业	1,900	79,800.00	0.05
377	000617	中油资本	12,100	79,739.00	0.05
378	002318	久立特材	3,300	78,870.00	0.05
379	300251	光线传媒	7,100	78,739.00	0.05
380	601607	上海医药	5,100	78,540.00	0.05
381	300558	贝达药业	1,200	78,084.00	0.05
382	600499	科达制造	5,600	77,280.00	0.05
383	002065	东华软件	10,800	77,112.00	0.05
384	002459	晶澳科技	9,500	76,950.00	0.05
385	688005	容百科技	2,500	76,500.00	0.05
386	600085	同仁堂	3,300	76,263.00	0.05
387	002044	美年健康	15,100	75,953.00	0.05

388	002266	浙富控股	15,000	75,900.00	0.05
389	688472	阿特斯	7,000	75,740.00	0.05
390	300409	道氏技术	3,800	75,734.00	0.05
391	600515	海南机场	27,200	74,528.00	0.05
392	002223	鱼跃医疗	2,900	74,414.00	0.05
393	605090	九丰能源	2,000	74,340.00	0.05
394	603596	伯特利	2,972	73,824.48	0.05
395	000400	许继电气	3,400	73,780.00	0.05
396	300003	乐普医疗	6,200	73,470.00	0.05
397	600521	华海药业	5,100	73,440.00	0.05
398	000415	渤海租赁	18,000	73,260.00	0.05
399	301550	斯菱智驱	800	73,144.00	0.05
400	002405	四维图新	11,300	73,111.00	0.05
401	688617	惠泰医疗	400	72,624.00	0.05
402	000032	深桑达A	2,900	72,355.00	0.04
403	000683	博源化工	12,500	72,000.00	0.04
404	000999	华润三九	3,170	71,293.30	0.04
405	600803	新奥股份	4,500	71,100.00	0.04
406	000039	中集集团	8,700	70,557.00	0.04
407	603766	隆鑫通用	5,900	70,387.00	0.04
408	600862	中航高科	3,900	70,317.00	0.04
409	600704	物产中大	14,800	69,856.00	0.04
410	601216	君正集团	15,500	69,130.00	0.04
411	600312	平高电气	3,900	68,874.00	0.04
412	688116	天奈科技	1,800	68,760.00	0.04
413	600332	白云山	3,400	68,136.00	0.04
414	000887	中鼎股份	3,800	67,982.00	0.04
415	300122	智飞生物	5,800	67,802.00	0.04
416	000967	盈峰环境	6,400	67,392.00	0.04
417	000830	鲁西化工	5,600	67,200.00	0.04
418	688114	华大智造	1,300	66,404.00	0.04

419	600018	上港集团	14,000	66,080.00	0.04
420	603605	珀莱雅	1,100	65,912.00	0.04
421	600765	中航重机	5,100	65,892.00	0.04
422	600166	福田汽车	22,200	64,602.00	0.04
423	600153	建发股份	8,100	64,233.00	0.04
424	002410	广联达	7,800	63,648.00	0.04
425	601799	星宇股份	700	63,434.00	0.04
426	600323	瀚蓝环境	2,300	63,158.00	0.04
427	002603	以岭药业	4,100	61,500.00	0.04
428	300896	爱美客	700	61,040.00	0.04
429	002007	华兰生物	5,000	60,950.00	0.04
430	600486	扬农化工	1,200	60,840.00	0.04
431	603568	伟明环保	3,880	59,674.40	0.04
432	601018	宁波港	18,800	59,220.00	0.04
433	600529	山东药玻	3,200	59,040.00	0.04
434	002389	航天彩虹	3,300	58,641.00	0.04
435	000738	航发控制	3,200	58,528.00	0.04
436	601000	唐山港	13,900	57,685.00	0.04
437	600008	首创环保	21,100	57,392.00	0.04
438	000932	华菱钢铁	16,500	57,255.00	0.04
439	600998	九州通	12,200	57,218.00	0.04
440	600208	衢州发展	20,200	57,166.00	0.04
441	600398	海澜之家	10,900	57,007.00	0.04
442	600170	上海建工	25,600	56,832.00	0.04
443	688009	中国通号	11,805	56,191.80	0.03
444	600316	洪都航空	2,000	55,880.00	0.03
445	603486	科沃斯	1,100	55,825.00	0.03
446	688303	大全能源	3,200	55,776.00	0.03
447	600820	隧道股份	10,700	55,747.00	0.03
448	601238	广汽集团	10,800	54,864.00	0.03
449	603816	顾家家居	2,400	53,664.00	0.03

450	300118	东方日升	4,300	53,535.00	0.03
451	603885	吉祥航空	5,200	53,508.00	0.03
452	002607	中公教育	29,700	53,460.00	0.03
453	600161	天坛生物	4,600	53,268.00	0.03
454	688166	博瑞医药	1,500	52,515.00	0.03
455	603939	益丰药房	2,900	52,142.00	0.03
456	600763	通策医疗	1,500	50,820.00	0.03
457	600038	中直股份	2,000	50,580.00	0.03
458	300049	福瑞医科	1,300	50,544.00	0.03
459	300573	兴齐眼药	1,215	49,523.40	0.03
460	601567	三星电气	3,300	49,302.00	0.03
461	300676	华大基因	1,400	49,084.00	0.03
462	601880	辽港股份	35,200	48,576.00	0.03
463	603392	万泰生物	1,800	48,546.00	0.03
464	600535	天士力	3,600	47,628.00	0.03
465	600816	建元信托	18,500	45,140.00	0.03
466	002244	滨江集团	5,900	44,840.00	0.03
467	002120	韵达股份	7,000	44,520.00	0.03
468	000833	粤桂股份	1,900	44,498.00	0.03
469	300100	双林股份	1,600	44,448.00	0.03
470	600511	国药股份	1,700	44,268.00	0.03
471	300144	宋城演艺	7,600	44,156.00	0.03
472	601155	新城控股	4,300	44,118.00	0.03
473	688063	派能科技	800	42,616.00	0.03
474	000998	隆平高科	5,600	42,224.00	0.03
475	002544	普天科技	2,300	41,906.00	0.03
476	600064	南京高科	5,800	41,354.00	0.03
477	601866	中远海发	18,500	40,885.00	0.03
478	600635	大众公用	9,300	39,804.00	0.02
479	600655	豫园股份	9,500	39,045.00	0.02
480	300457	赢合科技	1,800	37,944.00	0.02

481	600754	锦江酒店	2,100	37,779.00	0.02
482	000035	中国天楹	7,800	37,674.00	0.02
483	300601	康泰生物	3,200	36,288.00	0.02
484	603899	晨光股份	1,700	35,071.00	0.02
485	600258	首旅酒店	3,200	34,944.00	0.02
486	600004	白云机场	4,700	34,122.00	0.02
487	600859	王府井	3,700	33,966.00	0.02
488	600663	陆家嘴	5,400	33,912.00	0.02
489	300070	碧水源	10,300	32,857.00	0.02
490	002091	江苏国泰	4,500	32,535.00	0.02
491	000069	华侨城A	19,000	31,160.00	0.02
492	600864	哈投股份	5,800	30,102.00	0.02
493	301078	孩子王	4,300	29,068.00	0.02
494	002292	奥飞娱乐	4,300	28,208.00	0.02
495	603833	欧派家居	900	27,099.00	0.02
496	600325	华发股份	10,900	25,179.00	0.02
497	002891	中宠股份	900	24,048.00	0.01
498	002572	索菲亚	2,700	19,710.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	001399	惠科股份	779	21,601.67	0.01
2	688635	长进光子	51	15,717.69	0.01
3	603459	红板科技	74	6,239.68	0.00
4	688712	北芯生命	83	2,981.36	0.00
5	603435	嘉德利	52	2,428.92	0.00
6	601112	振石股份	120	2,110.80	0.00
7	688781	视涯科技	36	1,713.96	0.00

8	001220	世盟股份	33	916.74	0.00
9	603293	埃泰克	20	678.60	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	3,611,487.00	2.66
2	300750	宁德时代	2,751,849.00	2.03
3	002371	北方华创	1,185,669.00	0.87
4	300502	新易盛	1,150,304.60	0.85
5	000333	美的集团	858,044.00	0.63
6	002475	立讯精密	783,311.00	0.58
7	300394	天孚通信	699,306.00	0.51
8	301308	江波龙	684,233.00	0.50
9	002384	东山精密	659,838.00	0.49
10	688525	佰维存储	628,334.75	0.46
11	300476	胜宏科技	612,914.00	0.45
12	002594	比亚迪	600,523.00	0.44
13	688498	源杰科技	598,660.00	0.44
14	300059	东方财富	538,068.00	0.40
15	300274	阳光电源	504,737.00	0.37
16	300857	协创数据	457,566.00	0.34
17	688347	华虹宏力	450,453.65	0.33
18	002602	世纪华通	438,439.00	0.32
19	000858	五粮液	409,360.00	0.30
20	300604	长川科技	386,339.00	0.28

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	300308	中际旭创	2,934,240.00	2.16
2	300750	宁德时代	1,827,258.00	1.35
3	002371	北方华创	1,128,481.68	0.83
4	300502	新易盛	932,122.00	0.69
5	002475	立讯精密	723,561.00	0.53
6	000333	美的集团	691,794.48	0.51
7	300394	天孚通信	590,710.00	0.44
8	300059	东方财富	572,071.00	0.42
9	002594	比亚迪	569,443.00	0.42
10	600519	贵州茅台	528,437.00	0.39
11	300476	胜宏科技	521,006.00	0.38
12	300274	阳光电源	519,397.00	0.38
13	002384	东山精密	494,329.00	0.36
14	000858	五粮液	412,716.00	0.30
15	000651	格力电器	392,430.74	0.29
16	000725	京东方A	363,546.00	0.27
17	300604	长川科技	348,706.40	0.26
18	002230	科大讯飞	311,713.00	0.23
19	002463	沪电股份	310,646.00	0.23
20	002281	光迅科技	308,361.00	0.23

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	48,069,226.03
卖出股票收入（成交）总额	40,489,258.02

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

本基金投资国债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。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

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

本基金本报告期末未持有其他资产。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	001399	惠科股份	21,601.67	0.01	新股锁定
2	688635	长进光子	15,717.69	0.01	科创板打新限售
3	603459	红板科技	6,239.68	0.00	新股锁定
4	688712	北芯生命	2,981.36	0.00	科创板打新限售
5	603435	嘉德利	2,428.92	0.00	新股锁定

§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A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总份额	持有份额	占总份额	持有份额	占总

			比例		比例		份额比例
464	245,493.53	10,433,700.00	9.1597%	9,219,200.00	8.0935%	94,256,100.00	82.7468%

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(2025年03月25日)基金份额总额	434,909,000.00
本报告期期初基金份额总额	107,909,000.00
本报告期基金总申购份额	48,000,000.00
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	113,909,000.00

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

§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，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	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华福证券	6	88,448,894.73	100.00%	11,498.50	100.00%	-

①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择证券经纪机构的标准，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）。

②基金管理人经内部适当程序，参照前述标准选择合作的证券经纪机构。

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A500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	兴业中证A500交易型开放式指数证券投资基金2025年第	中国证监会规定的媒介	2026-01-22

	四季度报告		
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	兴业中证A500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	兴业中证A500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A500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	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
12	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
13	兴业中证A500交易型开放式	中国证监会规定的媒介	2026-06-23

	指数证券投资基金基金产品资料概要更新		

§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	68,470,300.00	36,040,600.00	10,254,800.00	94,256,100.00	82.75%
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A500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“中证A500龙头ETF”，变更后扩位简称“中证A500ETF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A500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A500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

（三）《兴业中证A500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

除上述第（六）项文件存放于基金托管人处外，其他备查文件等文本存放于基金管理人处。

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