

# 兴业中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

## 2025 年中期报告

2025 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:2025 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，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2025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2025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 .....	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 .....	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 .....	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 .....	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	58
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 .....	58
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 .....	58
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 .....	58
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 .....	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	58
7.12 投资组合报告附注 .....	58
§8 基金份额持有人信息 .....	59

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	59
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	60
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	60
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	60
§9 开放式基金份额变动 .....	60
§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 .....	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	61
10.4 基金投资策略的改变 .....	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	61
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	62
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 .....	66
§12 备查文件目录 .....	66
12.1 备查文件目录 .....	66
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500交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	兴业中证500ETF(证券简称:兴业500;扩位证券简称:兴业中证500ETF)
场内简称	兴业中证500ETF(证券简称:兴业500;扩位证券简称:兴业中证500ETF)
基金主代码	510570
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020年06月30日
基金管理人	兴业基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	23,060,583.00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五四路137号信和广场25楼	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		上海市浦东新区银城路167号13、14层	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		叶文煌	葛海蛟

### 2.4 信息披露方式

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

### 2.5 其他相关资料

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

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2025年01月01日- 2025年06月30日)
本期已实现收益	428,613.68
本期利润	1,222,054.25
加权平均基金份额本期利润	0.0449
本期加权平均净值利润率	5.01%
本期基金份额净值增长率	4.08%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2025年06月30日)
期末可供分配利润	-1,630,034.73
期末可供分配基金份额利润	-0.0707
期末基金资产净值	21,430,548.27
期末基金份额净值	0.9293
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2025年06月30日)
基金份额累计净值增长率	-7.07%

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

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

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

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

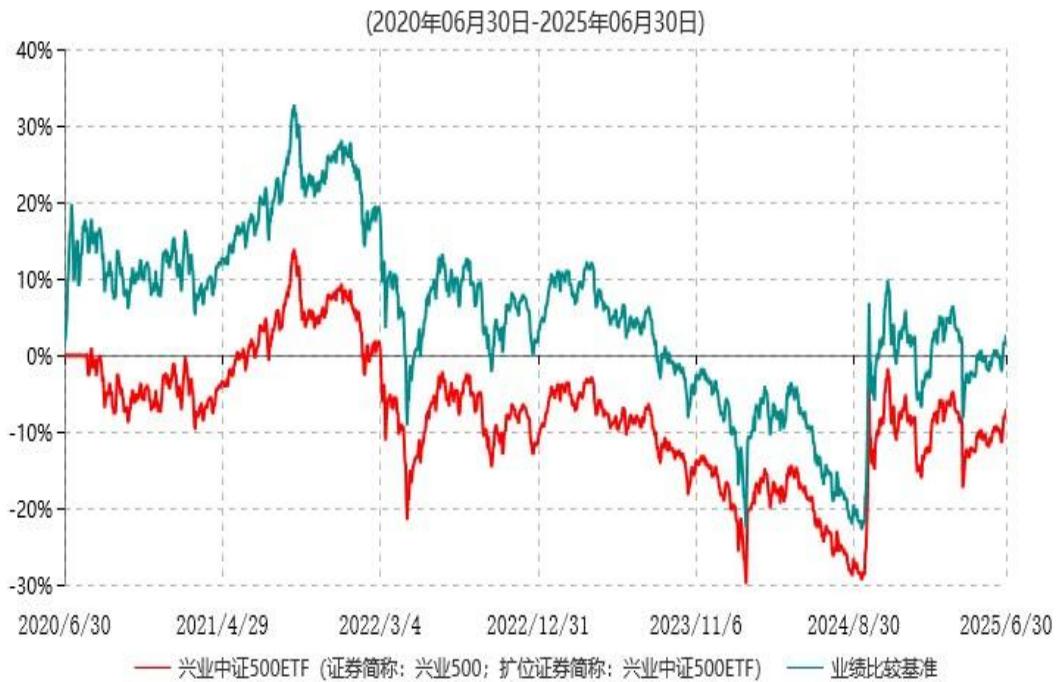
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益	①-③	②-④

		准差②	率③	率标准差 ④		
过去一个月	4.93%	0.77%	4.31%	0.79%	0.62%	-0.02%
过去三个月	1.98%	1.44%	0.98%	1.50%	1.00%	-0.06%
过去六个月	4.08%	1.30%	3.31%	1.36%	0.77%	-0.06%
过去一年	19.63%	1.62%	19.68%	1.72%	-0.05%	-0.10%
过去三年	-3.94%	1.27%	-8.35%	1.35%	4.41%	-0.08%
自基金合同 生效起至今	-7.07%	1.21%	2.65%	1.33%	-9.72%	-0.12%

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

兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

站在新时代的潮头浪尖，兴业基金坚守“受人之托、代客理财”的初心本源，坚守“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化，以“市场化、专业化、数字化”为转型方向，不断提升主动管理能力，打磨产品线，强化核心竞争力，提升权益投资能力，巩固扩大固收优势并增强特色业务，致力于为广大投资者创造长期良好收益，为中国实体经济健康发展贡献自身应有力量。截至2025年6月30日，兴业基金共管理108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		
徐成城	基金经理	2025- 05-22	-	21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，现任权益投资部总经 理助理、基金经理。
张诗悦	基金经理	2024- 06-21	-	9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。

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《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2025年上半年，市场在经历了年初至4月上旬的剧烈调整后，呈现出反弹态势，中证全指录得涨幅4.28%，市场风格分化，小盘指数较为占优。沪深300、中证500、中证1000、中证2000的涨跌幅分别为0.03%、3.31%、6.69%、15.24%，代表微盘股的中证2000指数表现最为突出。上证180、中证A500、科创综指等新指数的涨幅分别为0.47%、0.47%、9.93%，科创板指数表现最为亮眼。

分行业来看，上半年表现最好的申万一级行业分别是有色金属、银行和国防军工，分别录得18.12%、13.10%、12.99%的涨幅，表现最差的分别是煤炭、食品饮料和房地产行业。

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，成分股平均市值超过200亿，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。在四月初外部贸易冲击的影响下，股指迎来了近10%的回调，但随后的20个交易日内指数逐步反弹，之后维持震荡格局。当前中证500的PE估值处在10年来的67%分位，业绩的修复仍需时日。中证500指数也逐步表现出了分红属性，截至2025年上半年末，中证500指数近12个月股息率达到1.65%。

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：兴业中证500ETF）基金份额净值为0.9293元，本报告期内，基金份额净值增长率为4.08%，同期业绩比较基准收益率为3.31%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，上半年A股的大盘股与微盘股涨幅较大，从估值来看具有了一定的调整风险，大中盘和中小盘股当前的投资性价比较高。对内部而言，“反内卷”政策或将类似于2017年前后供给侧改革的效应，利好供给过剩且估值处于低位的制造业估值反弹；对外部而言，短期内特朗普或仍将频频挥舞关税大棒，对全球资本市场的风险偏好形成一定压制，若避险情绪提升，则利好国内的高股息资产。整体来看，高股息+低估值的中盘股在未来一段时间或能产生一定的超额收益。

#### 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2025年06月30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，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

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

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

### §6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	311,430.98	1,286,808.92
结算备付金		3,535.90	9,630.06
存出保证金		14,563.28	8,039.26
交易性金融资产	6.4.7.2	21,114,367.73	26,056,947.86
其中：股票投资		21,114,367.73	26,056,947.86
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		21,443,897.89	27,361,426.10
<b>负债和净资产</b>	附注号	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		8,717.87	12,476.13
应付托管费		1,743.56	2,495.21
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	2,888.19	59,107.40
负债合计		13,349.62	74,078.74
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	23,060,583.00	30,560,583.00
未分配利润	6.4.7.8	-1,630,034.73	-3,273,235.64
净资产合计		21,430,548.27	27,287,347.36
负债和净资产总计		21,443,897.89	27,361,426.10

注：报告截止日2025年06月30日，基金份额净值0.9293元，基金份额总额23,060,583.00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：2025年01月01日至2025年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025年01月01日至 2025年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至202 4年06月30日
<b>一、营业总收入</b>		1,297,131.65	-1,615,920.76
1.利息收入		1,850.02	3,107.22
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,850.02	3,107.22
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“-”号填列）		472,294.59	-1,212,520.56
其中：股票投资收益	6.4.7.10	262,840.10	-1,505,585.84
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	982.54
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	209,454.49	292,082.74
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	793,440.57	-308,028.31
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	29,546.47	-98,479.11
<b>减：二、营业总支出</b>		75,077.40	133,090.71
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	60,745.42	57,808.95
2. 托管费	6.4.10.2.2	12,149.05	11,561.85
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	2,182.93	63,719.91
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,222,054.25	-1,749,011.47
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,222,054.25	-1,749,011.47
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,222,054.25	-1,749,011.47

### 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：2025年01月01日至2025年06月30日

单位：人民币元

项目	本期		
	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
项目		上年度可比期间 2024年01月01日至2024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	28,060,583.00	-4,676,918.63	23,383,664.37
二、本期期初净资产	28,060,583.00	-4,676,918.63	23,383,664.37
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-1,586,185.10	-1,586,185.10
(一)、综合收益总额	-	-1,749,011.47	-1,749,011.47
(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)	-	162,826.37	162,826.37
其中: 1.基金申购款	27,500,000.00	-4,956,778.36	22,543,221.64
2.基金赎回款	-27,500,000.00	5,119,604.73	-22,380,395.27
(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	-6,263,103.73	21,797,479.27
-----------	---------------	---------------	---------------

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：

叶文煌

黃文锋

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2025年06月30日的财务状况以及2025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》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90

号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税；2018年1月1日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

(2)对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不计缴企业所得税。

(3)对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)对于基金从事A股买卖，出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税。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。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日
活期存款	311,430.98
等于： 本金	311,402.30
加： 应计利息	28.68
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	311,430.98

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	19,877,910.48	-	21,114,367.73	1,236,457.25
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	19,877,910.48	-	21,114,367.73	1,236,457.25

#### 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 2025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	2,888.19
其中：交易所市场	2,888.19
银行间市场	-
应付利息	-
合计	2,888.19

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	30,560,583.00	30,560,583.00
本期申购	30,000,000.00	30,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-37,500,000.00	-37,500,000.00
本期末	23,060,583.00	23,060,583.00

#### 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	92,766.41	-3,366,002.05	-3,273,235.64
本期期初	92,766.41	-3,366,002.05	-3,273,235.64

本期利润	428,613.68	793,440.57	1,222,054.25
本期基金份额交易产生的变动数	-15,521.55	436,668.21	421,146.66
其中：基金申购款	147,350.91	-4,390,665.65	-4,243,314.74
基金赎回款	-162,872.46	4,827,333.86	4,664,461.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	505,858.54	-2,135,893.27	-1,630,034.73

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年01月01日至2025年06月30日
活期存款利息收入	1,709.70
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	112.76
其他	27.56
合计	1,850.02

#### 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
	2025年01月01日至2025年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	389,734.04
股票投资收益——赎回差价收入	-126,893.94
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	262,840.10

##### 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

	2025年01月01日至2025年06月30日
卖出股票成交总额	18,587,267.26
减：卖出股票成本总额	18,179,409.38
减：交易费用	18,123.84
买卖股票差价收入	389,734.04

#### 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 2025年01月01日至2025年06月30日
赎回基金份额对价总额	32,835,538.60
减：现金支付赎回款总额	18,574,375.60
减：赎回股票成本总额	14,388,056.94
减：交易费用	-
赎回差价收入	-126,893.94

#### 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

##### 6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益--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

本基金本报告期内无衍生工具收益--其他投资收益。

#### 6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
----	-------------------------------

股票投资产生的股利收益	209,454.49
基金投资产生的股利收益	-
合计	209,454.49

#### 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
1.交易性金融资产	793,440.57
——股票投资	793,440.57
——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	793,440.57

#### 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
基金赎回费收入	-
ETF基金替代损益	29,546.47
合计	29,546.47

#### 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 2025年01月01日至2025年06月30日
审计费用	-
信息披露费	-
汇划手续费	432.62
其他费用_指数使用费	1,750.31
合计	2,182.93

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期间存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

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

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至20 25年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至20 24年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	60,745.42	57,808.95
其中：应支付销售机构的客户维护费	4,086.39	3,913.51
应支付基金管理人的净管理 费	56,659.03	53,895.44

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 2025年01月01日至2025 年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	12,149.05	11,561.85

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

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

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

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025年06月30日		上年度末 2024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	13,479,900.00	58.45%	17,193,200.00	56.2594%

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		上年度可比期间	
	2025年01月01日至2025年06月30日	期末余额	2024年01月01日至2024年06月30日	当期利息收入
中国银行股份有限公司	311,430.98	1,709.70	1,767,206.27	2,774.66

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)10,900股，占本基金资产净值的0.1256%(上年度末：14,700股，占本基金资产净值的0.1406%)。本报告期末，本基金持有基金托管人发行的股票中银证券(601696.SH)4,700股，占本基金资产净值的0.2344%(上年度末：6,100股，占本基金资产净值的0.2495%)。

#### 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（2025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

本基金本报告期内未持有因认购新发/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

本基金本报告期内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，对公司经营管理及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 2025年0 6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	311,430.98	-	-	-	311,430.98
结算备付金	3,535.90	-	-	-	3,535.90
存出保证金	14,563.28	-	-	-	14,563.28
交易性金融资产	-	-	-	21,114,367.73	21,114,367.73
资产总计	329,530.16	-	-	21,114,367.73	21,443,897.89
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	8,717.87	8,717.87
应付托管费	-	-	-	1,743.56	1,743.56
其他负债	-	-	-	2,888.19	2,888.19
负债总计	-	-	-	13,349.62	13,349.62
利率敏感度缺口	329,530.16	-	-	21,101,018.11	21,430,548.27

上年度 末 2024年1 2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	1,286,808.92	-	-	-	1,286,808.92
结算备付金	9,630.06	-	-	-	9,630.06
存出保证金	8,039.26	-	-	-	8,039.26
交易性金融资产	-	-	-	26,056,947.86	26,056,947.86
资产总计	1,304,478.24	-	-	26,056,947.86	27,361,426.10
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	12,476.13	12,476.13
应付托管费	-	-	-	2,495.21	2,495.21
其他负债	-	-	-	59,107.40	59,107.40
负债总计	-	-	-	74,078.74	74,078.74
利率敏感度缺口	1,304,478.24	-	-	25,982,869.12	27,287,347.36

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 2025年06月30日		上年度末 2024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	21,114,367.73	98.52	26,056,947.86	95.49
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	-	-	-	-
一权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	21,114,367.73	98.52	26,056,947.86	95.49

#### 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 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
	股票价格上升5%	1,055,718.39	1,302,847.39
	股票价格下降5%	-1,055,718.39	-1,302,847.39

#### 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 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	21,114,367.73	26,056,947.86
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	21,114,367.73	26,056,947.86

###### 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	21,114,367.73	98.46
	其中：股票	21,114,367.73	98.46
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	314,966.88	1.47
8	其他各项资产	14,563.28	0.07
9	合计	21,443,897.89	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	51,496.00	0.24
B	采矿业	728,562.00	3.40
C	制造业	13,099,317.04	61.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	676,624.10	3.16
E	建筑业	170,877.00	0.80
F	批发和零售业	454,005.74	2.12
G	交通运输、仓储和邮政业	348,806.00	1.63
H	住宿和餐饮业	44,799.00	0.21
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,138,123.54	9.98
J	金融业	2,097,906.39	9.79
K	房地产业	259,814.00	1.21
L	租赁和商务服务业	179,571.80	0.84
M	科学研究和技术服务业	141,500.00	0.66
N	水利、环境和公共设施管理业	86,112.40	0.40
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	43,146.00	0.20
Q	卫生和社会工作	93,881.48	0.44
R	文化、体育和娱乐业	300,199.00	1.40
S	综合	48,846.00	0.23
	合计	20,963,587.49	97.82

### 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	9,890.00	0.05
C	制造业	126,179.67	0.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	860.00	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,856.57	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	1,066.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,928.00	0.05
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	150,780.24	0.70

### 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	300476	胜宏科技	1,900	255,322.00	1.19
2	000988	华工科技	3,100	145,731.00	0.68
3	688235	百济神州-U	600	140,184.00	0.65
4	688608	恒玄科技	400	139,192.00	0.65
5	688617	惠泰医疗	435	129,195.00	0.60
6	300339	润和软件	2,500	127,075.00	0.59
7	600988	赤峰黄金	5,000	124,400.00	0.58
8	002966	苏州银行	14,160	124,324.80	0.58
9	600839	四川长虹	11,700	113,724.00	0.53
10	688027	国盾量子	400	110,004.00	0.51
11	601555	东吴证券	12,360	108,150.00	0.50
12	601162	天风证券	21,600	106,488.00	0.50
13	688521	芯原股份	1,100	106,150.00	0.50
14	002517	恺英网络	5,300	102,343.00	0.48
15	688213	思特威-W	1,000	102,220.00	0.48
16	002195	岩山科技	18,100	101,903.00	0.48
17	002340	格林美	16,000	101,600.00	0.47
18	002261	拓维信息	3,200	99,040.00	0.46
19	600487	亨通光电	6,200	94,860.00	0.44
20	300207	欣旺达	4,700	94,282.00	0.44
21	600157	永泰能源	70,000	93,800.00	0.44
22	002797	第一创业	13,200	93,456.00	0.44
23	300251	光线传媒	4,600	93,242.00	0.44
24	603893	瑞芯微	600	91,116.00	0.43
25	000066	中国长城	6,100	90,280.00	0.42
26	002558	巨人网络	3,800	89,490.00	0.42
27	600096	云天化	4,000	87,880.00	0.41
28	002156	通富微电	3,400	87,108.00	0.41

29	300803	指南针	1,060	85,499.60	0.40
30	688777	中控技术	1,886	84,700.26	0.40
31	600536	中国软件	1,795	83,952.15	0.39
32	300017	网宿科技	7,800	83,616.00	0.39
33	600885	宏发股份	3,668	81,833.08	0.38
34	002294	信立泰	1,700	80,461.00	0.38
35	601168	西部矿业	4,700	78,161.00	0.36
36	002273	水晶光电	3,900	77,883.00	0.36
37	000997	新大陆	2,400	77,712.00	0.36
38	601577	长沙银行	7,800	77,532.00	0.36
39	600879	航天电子	7,400	77,478.00	0.36
40	688002	睿创微纳	1,100	76,692.00	0.36
41	002465	海格通信	5,500	76,670.00	0.36
42	601099	太平洋	19,400	76,242.00	0.36
43	000831	中国稀土	2,100	75,852.00	0.35
44	600079	人福医药	3,600	75,528.00	0.35
45	600352	浙江龙盛	7,400	75,184.00	0.35
46	688578	艾力斯	800	74,432.00	0.35
47	002281	光迅科技	1,500	73,980.00	0.35
48	601108	财通证券	9,200	72,772.00	0.34
49	002185	华天科技	7,200	72,720.00	0.34
50	688318	财富趋势	619	71,135.48	0.33
51	688099	晶晨股份	1,000	71,010.00	0.33
52	002138	顺络电子	2,500	70,300.00	0.33
53	000933	神火股份	4,200	69,888.00	0.33
54	688052	纳芯微	400	69,796.00	0.33
55	002202	金风科技	6,700	68,675.00	0.32
56	601128	常熟银行	9,277	68,371.49	0.32
57	002850	科达利	600	67,902.00	0.32
58	688120	华海清科	400	67,480.00	0.31
59	688525	佰维存储	1,000	67,400.00	0.31

60	688469	芯联集成-U	14,048	67,008.96	0.31
61	002085	万丰奥威	4,200	66,738.00	0.31
62	002738	中矿资源	2,060	66,249.60	0.31
63	688582	芯动联科	984	66,124.80	0.31
64	300002	神州泰岳	5,600	66,080.00	0.31
65	002532	天山铝业	7,900	65,649.00	0.31
66	603129	春风动力	300	64,950.00	0.30
67	600109	国金证券	7,400	64,898.00	0.30
68	002436	兴森科技	4,900	64,876.00	0.30
69	300058	蓝色光标	9,880	64,812.80	0.30
70	300450	先导智能	2,600	64,610.00	0.30
71	000783	长江证券	9,300	64,449.00	0.30
72	601933	永辉超市	13,000	63,700.00	0.30
73	002472	双环传动	1,900	63,631.00	0.30
74	002078	太阳纸业	4,700	63,262.00	0.30
75	603596	伯特利	1,200	63,228.00	0.30
76	300054	鼎龙股份	2,200	63,096.00	0.29
77	002410	广联达	4,700	63,027.00	0.29
78	300223	北京君正	900	62,280.00	0.29
79	300474	景嘉微	850	62,050.00	0.29
80	002130	沃尔核材	2,600	61,932.00	0.29
81	600143	金发科技	6,000	61,860.00	0.29
82	002821	凯莱英	700	61,775.00	0.29
83	600580	卧龙电驱	3,120	61,682.40	0.29
84	688072	拓荆科技	400	61,484.00	0.29
85	002065	东华软件	6,400	61,440.00	0.29
86	601198	东兴证券	5,500	61,325.00	0.29
87	600873	梅花生物	5,700	60,933.00	0.28
88	002223	鱼跃医疗	1,700	60,520.00	0.28
89	300136	信维通信	2,700	60,480.00	0.28
90	000034	神州数码	1,600	60,224.00	0.28

91	300024	机器人	3,500	60,130.00	0.28
92	300757	罗博特科	400	59,988.00	0.28
93	600862	中航高科	2,300	59,984.00	0.28
94	002673	西部证券	7,600	59,888.00	0.28
95	600298	安琪酵母	1,700	59,789.00	0.28
96	002353	杰瑞股份	1,700	59,500.00	0.28
97	000728	国元证券	7,500	59,175.00	0.28
98	002624	完美世界	3,900	59,163.00	0.28
99	600895	张江高科	2,300	59,110.00	0.28
100	688361	中科飞测	700	58,933.00	0.27
101	300383	光环新网	4,100	58,630.00	0.27
102	601615	明阳智能	5,100	58,599.00	0.27
103	000021	深科技	3,100	58,094.00	0.27
104	603605	珀莱雅	700	57,953.00	0.27
105	688180	君实生物-U	1,700	57,766.00	0.27
106	300496	中科创达	1,000	57,220.00	0.27
107	603160	汇顶科技	800	56,824.00	0.27
108	600549	厦门钨业	2,700	56,484.00	0.26
109	603345	安井食品	700	56,294.00	0.26
110	002008	大族激光	2,300	56,051.00	0.26
111	300115	长盈精密	2,600	55,640.00	0.26
112	688568	中科星图	1,541	55,491.41	0.26
113	000426	兴业银锡	3,500	55,300.00	0.26
114	688188	柏楚电子	420	55,297.20	0.26
115	688183	生益电子	1,080	55,296.00	0.26
116	000733	振华科技	1,100	55,055.00	0.26
117	300012	华测检测	4,700	54,943.00	0.26
118	603087	甘李药业	1,000	54,780.00	0.26
119	002837	英维克	1,800	53,478.00	0.25
120	000729	燕京啤酒	4,100	53,013.00	0.25
121	002155	湖南黄金	2,960	52,836.00	0.25

122	600392	盛和资源	4,000	52,680.00	0.25
123	300073	当升科技	1,200	52,644.00	0.25
124	601997	贵阳银行	8,400	52,416.00	0.24
125	300003	乐普医疗	3,800	52,364.00	0.24
126	000932	华菱钢铁	11,800	51,920.00	0.24
127	000750	国海证券	12,600	51,912.00	0.24
128	601665	齐鲁银行	8,200	51,824.00	0.24
129	601717	中创智领	3,100	51,522.00	0.24
130	601216	君正集团	9,300	51,336.00	0.24
131	300395	菲利华	1,000	51,100.00	0.24
132	603979	金诚信	1,100	51,084.00	0.24
133	002444	巨星科技	2,000	51,020.00	0.24
134	000878	云南铜业	4,000	50,880.00	0.24
135	600153	建发股份	4,900	50,813.00	0.24
136	300699	光威复材	1,600	50,672.00	0.24
137	600060	海信视像	2,200	50,644.00	0.24
138	300142	沃森生物	4,600	50,600.00	0.24
139	300001	特锐德	2,100	50,337.00	0.23
140	601696	中银证券	4,700	50,243.00	0.23
141	002851	麦格米特	1,000	50,140.00	0.23
142	601990	南京证券	6,200	50,096.00	0.23
143	688017	绿的谐波	400	49,956.00	0.23
144	601233	桐昆股份	4,700	49,820.00	0.23
145	300037	新宙邦	1,400	49,280.00	0.23
146	688385	复旦微电	1,000	49,270.00	0.23
147	002414	高德红外	4,800	49,200.00	0.23
148	600673	东阳光	4,200	48,846.00	0.23
149	600699	均胜电子	2,800	48,832.00	0.23
150	600398	海澜之家	7,000	48,720.00	0.23
150	600369	西南证券	11,200	48,720.00	0.23
151	600521	华海药业	2,600	48,438.00	0.23

152	000893	亚钾国际	1,600	48,224.00	0.23
153	000519	中兵红箭	2,200	48,158.00	0.22
154	600177	雅戈尔	6,500	47,450.00	0.22
155	002595	豪迈科技	800	47,376.00	0.22
156	600562	国睿科技	1,500	47,235.00	0.22
157	001696	宗申动力	2,100	47,145.00	0.22
158	300454	深信服	500	47,090.00	0.22
159	002152	广电运通	3,500	47,040.00	0.22
160	688220	翱捷科技-U	600	46,980.00	0.22
161	603179	新泉股份	1,000	46,970.00	0.22
162	688249	晶合集成	2,311	46,843.97	0.22
163	300373	扬杰科技	900	46,710.00	0.22
164	600704	物产中大	8,800	46,376.00	0.22
165	000009	中国宝安	5,210	46,264.80	0.22
166	603228	景旺电子	1,100	46,024.00	0.21
167	600909	华安证券	7,890	45,998.70	0.21
168	300748	金力永磁	1,920	45,772.80	0.21
169	000623	吉林敖东	2,700	45,765.00	0.21
170	688702	盛科通信-U	749	45,748.92	0.21
171	002044	美年健康	8,900	45,746.00	0.21
172	000400	许继电气	2,100	45,717.00	0.21
173	600118	中国卫星	1,600	45,712.00	0.21
174	000738	航发控制	2,200	45,650.00	0.21
175	600497	驰宏锌锗	8,600	45,494.00	0.21
176	002958	青农商行	12,600	45,486.00	0.21
177	300679	电连技术	1,000	45,380.00	0.21
178	600435	北方导航	2,900	45,211.00	0.21
179	600141	兴发集团	2,200	45,166.00	0.21
180	002318	久立特材	1,900	44,441.00	0.21
181	600765	中航重机	2,600	43,888.00	0.20
182	600155	华创云信	6,300	43,848.00	0.20

183	002409	雅克科技	800	43,752.00	0.20
184	600563	法拉电子	400	43,636.00	0.20
185	300724	捷佳伟创	800	43,440.00	0.20
186	600637	东方明珠	5,800	43,326.00	0.20
187	688278	特宝生物	600	43,266.00	0.20
188	002607	中公教育	14,100	43,146.00	0.20
189	000960	锡业股份	2,800	42,840.00	0.20
190	600038	中直股份	1,100	42,691.00	0.20
191	688065	凯赛生物	900	42,390.00	0.20
192	000415	渤海租赁	12,700	42,291.00	0.20
193	600529	山东药玻	1,900	42,066.00	0.20
194	600498	烽火通信	2,000	42,060.00	0.20
195	000423	东阿阿胶	800	41,840.00	0.20
196	600884	杉杉股份	4,400	41,624.00	0.19
197	603939	益丰药房	1,700	41,599.00	0.19
198	688122	西部超导	800	41,504.00	0.19
199	603606	东方电缆	800	41,368.00	0.19
200	300765	新诺威	800	41,352.00	0.19
201	688728	格科微	2,679	41,256.60	0.19
202	002739	万达电影	3,600	41,148.00	0.19
203	002025	航天电器	800	41,128.00	0.19
204	300558	贝达药业	700	40,565.00	0.19
205	000528	柳工	4,200	40,362.00	0.19
206	000039	中集集团	5,100	40,086.00	0.19
207	688676	金盘科技	1,192	39,872.40	0.19
208	000513	丽珠集团	1,100	39,644.00	0.18
209	002926	华西证券	4,400	39,336.00	0.18
210	600901	江苏金租	6,440	39,026.40	0.18
211	688114	华大智造	600	38,898.00	0.18
212	600486	扬农化工	670	38,860.00	0.18
213	002385	大北农	9,600	38,784.00	0.18

214	000887	中鼎股份	2,200	38,698.00	0.18
215	002568	百润股份	1,500	38,415.00	0.18
216	300285	国瓷材料	2,200	38,170.00	0.18
217	002653	海思科	900	37,998.00	0.18
218	002312	川发龙蟒	3,300	37,884.00	0.18
219	600863	内蒙华电	9,200	37,812.00	0.18
220	002939	长城证券	4,500	37,710.00	0.18
221	300144	宋城演艺	4,400	37,620.00	0.18
222	000723	美锦能源	8,700	37,584.00	0.18
223	688538	和辉光电-U	16,016	37,477.44	0.17
224	600008	首创环保	12,390	37,417.80	0.17
225	600390	五矿资本	6,400	37,312.00	0.17
226	600820	隧道股份	6,100	37,210.00	0.17
227	002080	中材科技	1,900	37,050.00	0.17
228	002064	华峰化学	5,600	37,016.00	0.17
229	688301	奕瑞科技	420	36,796.20	0.17
230	600516	方大炭素	7,900	36,656.00	0.17
231	600166	福田汽车	13,500	36,585.00	0.17
232	002432	九安医疗	1,000	36,430.00	0.17
233	600998	九州通	7,081	36,396.34	0.17
234	600985	淮北矿业	3,200	36,288.00	0.17
235	301536	星宸科技	600	36,180.00	0.17
236	688363	华熙生物	700	35,945.00	0.17
237	300604	长川科技	800	35,928.00	0.17
238	603568	伟明环保	1,880	35,870.40	0.17
239	000703	恒逸石化	6,100	35,868.00	0.17
240	600170	上海建工	15,000	35,850.00	0.17
241	603816	顾家家居	1,400	35,728.00	0.17
242	300458	全志科技	900	35,721.00	0.17
243	002500	山西证券	6,100	35,624.00	0.17
244	601179	中国西电	5,800	35,612.00	0.17

245	600312	平高电气	2,300	35,397.00	0.17
246	002262	恩华药业	1,700	35,326.00	0.16
247	600208	衢州发展	11,900	35,224.00	0.16
248	600021	上海电力	4,000	35,160.00	0.16
249	600126	杭钢股份	3,900	35,100.00	0.16
250	301308	江波龙	400	34,996.00	0.16
251	000683	博源化工	7,300	34,967.00	0.16
252	605358	立昂微	1,500	34,950.00	0.16
253	603486	科沃斯	600	34,938.00	0.16
254	000062	深圳华强	1,300	34,918.00	0.16
255	300676	华大基因	700	34,839.00	0.16
256	603589	口子窖	1,000	34,800.00	0.16
257	002773	康弘药业	1,200	34,764.00	0.16
258	600763	通策医疗	841	34,716.48	0.16
259	300763	锦浪科技	600	34,434.00	0.16
260	600535	天士力	2,200	34,430.00	0.16
261	300857	协创数据	400	34,424.00	0.16
262	000403	派林生物	1,890	34,265.70	0.16
263	601155	新城控股	2,500	34,200.00	0.16
263	600872	中炬高新	1,800	34,200.00	0.16
264	600380	健康元	3,100	34,193.00	0.16
265	002244	滨江集团	3,500	34,125.00	0.16
266	002203	海亮股份	3,300	34,056.00	0.16
267	000060	中金岭南	7,400	33,892.00	0.16
268	000591	太阳能	7,700	33,803.00	0.16
269	601000	唐山港	8,300	33,698.00	0.16
270	603379	三美股份	700	33,684.00	0.16
271	002439	启明星辰	2,100	33,579.00	0.16
272	000629	钒钛股份	13,100	33,536.00	0.16
273	603338	浙江鼎力	700	33,180.00	0.15
274	600132	重庆啤酒	600	33,060.00	0.15

275	600816	建元信托	11,200	33,040.00	0.15
276	601991	大唐发电	10,400	32,968.00	0.15
277	600348	华阳股份	4,950	32,967.00	0.15
278	600583	海油工程	6,000	32,760.00	0.15
279	300487	蓝晓科技	650	32,695.00	0.15
280	300735	光弘科技	1,300	32,630.00	0.15
281	300146	汤臣倍健	2,900	32,596.00	0.15
282	603290	斯达半导	400	32,508.00	0.15
283	002603	以岭药业	2,300	32,430.00	0.15
284	603885	吉祥航空	2,400	32,328.00	0.15
285	600511	国药股份	1,100	32,076.00	0.15
286	688297	中无人机	600	32,040.00	0.15
287	601880	辽港股份	21,300	31,950.00	0.15
288	000830	鲁西化工	3,100	31,930.00	0.15
289	003031	中瓷电子	600	31,926.00	0.15
290	002984	森麒麟	1,700	31,875.00	0.15
291	603737	三棵树	864	31,838.40	0.15
292	002423	中粮资本	2,600	31,798.00	0.15
293	600970	中材国际	3,700	31,746.00	0.15
294	601016	节能风电	10,970	31,703.30	0.15
295	000951	中国重汽	1,800	31,644.00	0.15
296	000636	风华高科	2,300	31,602.00	0.15
297	000958	电投产融	4,600	31,464.00	0.15
298	600499	科达制造	3,200	31,360.00	0.15
299	300212	易华录	1,440	31,334.40	0.15
300	002056	横店东磁	2,200	31,130.00	0.15
301	600095	湘财股份	3,100	31,093.00	0.15
302	300390	天华新能	1,630	31,084.10	0.15
303	601456	国联民生	3,000	31,050.00	0.14
304	601966	玲珑轮胎	2,100	30,807.00	0.14
305	688100	威胜信息	830	30,751.50	0.14

306	000563	陕国投A	8,600	30,702.00	0.14
307	600859	王府井	2,200	30,558.00	0.14
308	600655	豫园股份	5,500	30,525.00	0.14
309	000155	川能动力	3,100	30,442.00	0.14
310	601666	平煤股份	4,100	30,381.00	0.14
311	601611	中国核建	3,300	30,327.00	0.14
312	603927	中科软	1,568	30,325.12	0.14
313	603000	人民网	1,500	30,315.00	0.14
314	300567	精测电子	500	30,305.00	0.14
315	603077	和邦生物	17,300	30,275.00	0.14
316	600325	华发股份	6,200	30,194.00	0.14
317	600316	洪都航空	800	30,160.00	0.14
318	600663	陆家嘴	3,400	30,124.00	0.14
319	600131	国网信通	1,700	30,090.00	0.14
320	600004	白云机场	3,300	30,030.00	0.14
321	688520	神州细胞	500	29,925.00	0.14
322	600685	中船防务	1,100	29,909.00	0.14
323	000050	深天马A	3,500	29,820.00	0.14
324	600378	昊华科技	1,100	29,777.00	0.14
325	603156	养元饮品	1,400	29,624.00	0.14
326	000598	兴蓉环境	4,100	29,561.00	0.14
327	601958	金钼股份	2,700	29,538.00	0.14
328	603298	杭叉集团	1,400	29,330.00	0.14
329	600737	中粮糖业	3,100	29,295.00	0.14
330	688234	天岳先进	500	29,275.00	0.14
331	000987	越秀资本	4,260	29,223.60	0.14
332	600363	联创光电	500	29,165.00	0.14
333	603899	晨光股份	1,000	28,990.00	0.14
334	600483	福能股份	3,000	28,920.00	0.13
335	300601	康泰生物	1,900	28,861.00	0.13
336	600598	北大荒	2,000	28,840.00	0.13

337	600271	航天信息	3,100	28,644.00	0.13
338	600739	辽宁成大	2,600	28,600.00	0.13
339	002756	永兴材料	900	28,575.00	0.13
340	600282	南钢股份	6,800	28,560.00	0.13
341	601333	广深铁路	9,800	28,322.00	0.13
342	000559	万向钱潮	3,700	28,305.00	0.13
343	600582	天地科技	4,700	28,153.00	0.13
344	002507	涪陵榨菜	2,200	28,138.00	0.13
345	601001	晋控煤业	2,300	28,106.00	0.13
346	300529	健帆生物	1,300	28,041.00	0.13
347	002429	兆驰股份	6,400	28,032.00	0.13
348	688778	厦钨新能	500	27,960.00	0.13
349	300888	稳健医疗	680	27,948.00	0.13
350	600867	通化东宝	3,400	27,880.00	0.13
351	300751	迈为股份	400	27,824.00	0.13
352	601231	环旭电子	1,900	27,797.00	0.13
353	601918	新集能源	4,300	27,778.00	0.13
354	002841	视源股份	800	27,680.00	0.13
355	601098	中南传媒	2,100	27,552.00	0.13
356	002120	韵达股份	4,100	27,470.00	0.13
357	300070	碧水源	6,100	27,450.00	0.13
358	688561	奇安信-U	800	27,184.00	0.13
359	002683	广东宏大	800	27,152.00	0.13
360	688772	珠海冠宇	1,890	27,008.10	0.13
361	601866	中远海发	10,900	26,923.00	0.13
362	600258	首旅酒店	1,900	26,847.00	0.13
363	600329	达仁堂	800	26,688.00	0.12
364	600995	南网储能	2,700	26,406.00	0.12
365	600566	济川药业	1,000	26,330.00	0.12
366	300919	中伟股份	800	26,304.00	0.12
367	601212	白银有色	8,300	25,979.00	0.12

368	600707	彩虹股份	4,000	25,840.00	0.12
369	002831	裕同科技	1,100	25,762.00	0.12
370	000967	盈峰环境	3,700	25,715.00	0.12
371	002670	国盛金控	1,700	25,585.00	0.12
372	000709	河钢股份	11,800	25,488.00	0.12
373	002430	杭氧股份	1,300	25,246.00	0.12
374	600906	财达证券	3,700	25,234.00	0.12
375	600578	京能电力	5,600	25,144.00	0.12
376	600517	国网英大	4,900	24,990.00	0.12
377	605589	圣泉集团	900	24,975.00	0.12
378	301358	湖南裕能	800	24,952.00	0.12
379	000027	深圳能源	3,900	24,882.00	0.12
380	000883	湖北能源	5,500	24,805.00	0.12
381	002508	老板电器	1,300	24,713.00	0.12
382	603688	石英股份	700	24,654.00	0.12
383	601928	凤凰传媒	2,200	24,574.00	0.11
384	300627	华测导航	700	24,500.00	0.11
385	600848	上海临港	2,700	24,489.00	0.11
386	600546	山煤国际	2,800	24,444.00	0.11
387	600959	江苏有线	7,100	24,424.00	0.11
388	603341	龙旗科技	600	24,378.00	0.11
389	603858	步长制药	1,500	24,360.00	0.11
390	002299	圣农发展	1,700	24,293.00	0.11
391	603529	爱玛科技	700	24,080.00	0.11
392	601399	国机重装	8,000	24,000.00	0.11
393	600171	上海贝岭	700	23,975.00	0.11
394	603565	中谷物流	2,500	23,875.00	0.11
395	300573	兴齐眼药	460	23,823.40	0.11
396	600764	中国海防	700	23,800.00	0.11
397	600977	中国电影	2,200	23,584.00	0.11
398	601156	东航物流	1,800	23,562.00	0.11

399	600808	马钢股份	6,800	23,460.00	0.11
400	000825	太钢不锈	6,500	23,335.00	0.11
401	000582	北部湾港	2,800	23,100.00	0.11
401	000543	皖能电力	3,300	23,100.00	0.11
402	601636	旗滨集团	4,600	23,046.00	0.11
403	603728	鸣志电器	400	22,988.00	0.11
404	600056	中国医药	2,220	22,954.80	0.11
405	300595	欧普康视	1,500	22,905.00	0.11
406	600528	中铁工业	3,100	22,878.00	0.11
407	301301	川宁生物	1,900	22,876.00	0.11
408	600968	海油发展	5,600	22,848.00	0.11
409	002266	浙富控股	7,400	22,792.00	0.11
410	601118	海南橡胶	4,800	22,656.00	0.11
411	688563	航材股份	400	22,652.00	0.11
412	600801	华新水泥	1,900	22,496.00	0.10
413	603225	新凤鸣	2,112	22,492.80	0.10
414	002572	索菲亚	1,600	22,416.00	0.10
415	000739	普洛药业	1,600	22,400.00	0.10
416	601608	中信重工	5,100	22,287.00	0.10
417	300346	南大光电	700	22,148.00	0.10
418	301498	乖宝宠物	200	21,874.00	0.10
419	688387	信科移动-U	3,870	21,865.50	0.10
420	601598	中国外运	4,400	21,692.00	0.10
421	000785	居然智家	7,100	21,655.00	0.10
422	601106	中国一重	7,700	21,560.00	0.10
423	000429	粤高速A	1,600	21,328.00	0.10
424	601965	中国汽研	1,200	21,300.00	0.10
425	600871	石化油服	10,900	21,255.00	0.10
426	300623	捷捷微电	700	20,860.00	0.10
427	603659	璞泰来	1,100	20,658.00	0.10
428	000921	海信家电	800	20,560.00	0.10

429	600373	中文传媒	2,000	20,540.00	0.10
430	600925	苏能股份	3,900	20,397.00	0.10
431	002007	华兰生物	1,300	20,371.00	0.10
432	300677	英科医疗	860	20,364.80	0.10
433	688032	禾迈股份	200	19,972.00	0.09
434	688349	三一重能	800	19,952.00	0.09
435	600612	老凤祥	400	19,900.00	0.09
436	002153	石基信息	2,260	19,571.60	0.09
437	600606	绿地控股	12,000	19,560.00	0.09
438	603650	彤程新材	600	19,290.00	0.09
439	000537	中绿电	2,300	19,228.00	0.09
440	688475	萤石网络	600	18,912.00	0.09
441	603658	安图生物	500	18,750.00	0.09
441	600098	广州发展	3,000	18,750.00	0.09
442	002372	伟星新材	1,800	18,648.00	0.09
443	688425	铁建重工	4,503	18,372.24	0.09
444	600361	创新新材	4,600	18,354.00	0.09
445	001286	陕西能源	2,100	18,270.00	0.09
446	601568	北元集团	4,400	18,260.00	0.09
447	688375	国博电子	300	18,003.00	0.08
448	600754	锦江酒店	800	17,952.00	0.08
449	000937	冀中能源	3,100	17,825.00	0.08
450	300957	贝泰妮	400	17,688.00	0.08
451	001389	广合科技	300	17,631.00	0.08
452	301165	锐捷网络	280	17,208.80	0.08
453	600688	上海石化	6,000	17,100.00	0.08
454	688281	华秦科技	280	16,942.80	0.08
455	603786	科博达	300	16,623.00	0.08
456	000032	深桑达A	800	16,184.00	0.08
457	002608	江苏国信	2,200	16,126.00	0.08
458	601019	山东出版	1,700	16,099.00	0.08

459	600032	浙江新能	2,100	15,876.00	0.07
460	688248	南网科技	500	15,730.00	0.07
461	688172	燕东微	800	15,728.00	0.07
462	000898	鞍钢股份	6,700	15,544.00	0.07
463	603707	健友股份	1,371	15,286.65	0.07
464	603556	海兴电力	600	15,282.00	0.07
465	601139	深圳燃气	2,400	15,264.00	0.07
466	600339	中油工程	4,600	15,042.00	0.07
467	000959	首钢股份	4,400	14,960.00	0.07
468	600062	华润双鹤	800	14,928.00	0.07
469	600928	西安银行	3,800	14,896.00	0.07
470	003035	南网能源	3,200	14,688.00	0.07
471	600720	中交设计	1,900	14,687.00	0.07
472	603233	大参林	872	14,213.60	0.07
473	600295	鄂尔多斯	1,600	13,936.00	0.07
474	688819	天能股份	500	13,880.00	0.06
475	601228	广州港	4,200	13,566.00	0.06
476	301267	华夏眼科	700	13,419.00	0.06
477	003022	联泓新科	800	12,664.00	0.06
478	600007	中国国贸	600	12,348.00	0.06
479	002563	森马服饰	2,300	12,098.00	0.06
480	601061	中信金属	1,500	11,865.00	0.06
481	600927	永安期货	800	11,848.00	0.06
482	603826	坤彩科技	600	11,742.00	0.05
483	000539	粤电力A	2,500	11,350.00	0.05
484	002461	珠江啤酒	1,000	11,290.00	0.05
485	300140	节能环保	1,800	11,106.00	0.05
486	001213	中铁特货	2,700	10,962.00	0.05
487	002945	华林证券	700	10,059.00	0.05
488	688153	唯捷创芯	300	9,303.00	0.04
489	688295	中复神鹰	400	8,320.00	0.04

490	601921	浙版传媒	1,000	8,060.00	0.04
491	601858	中国科传	400	7,780.00	0.04
492	600299	安迪苏	800	7,720.00	0.04
493	601158	重庆水务	1,600	7,424.00	0.03
494	603868	飞科电器	200	7,174.00	0.03
495	600956	新天绿能	900	6,948.00	0.03

### 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	600418	江淮汽车	1,600	64,144.00	0.30
2	002625	光启技术	500	19,990.00	0.09
3	002384	东山精密	400	15,108.00	0.07
4	300866	安克创新	100	11,360.00	0.05
5	301236	软通动力	200	10,928.00	0.05
6	002128	电投能源	500	9,890.00	0.05
7	302132	中航成飞	100	8,794.00	0.04
8	000818	航锦科技	100	2,250.00	0.01
9	601567	三星医疗	100	2,242.00	0.01
10	603883	老百姓	57	1,197.57	0.01
11	600350	山东高速	100	1,066.00	0.00
12	600642	申能股份	100	860.00	0.00
13	002690	美亚光电	50	843.50	0.00
14	002407	多氟多	60	731.40	0.00
15	002867	周大生	50	659.00	0.00
16	000778	新兴铸管	100	372.00	0.00
17	300009	安科生物	20	167.40	0.00
18	688005	容百科技	6	133.92	0.00
19	688390	固德威	1	43.45	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	002625	光启技术	266,971.00	0.98
2	300339	润和软件	197,649.00	0.72
3	002966	苏州银行	160,704.00	0.59
4	688235	百济神州-U	158,052.00	0.58
5	300476	胜宏科技	155,863.00	0.57
6	000988	华工科技	154,130.00	0.56
7	688608	恒玄科技	148,406.00	0.54
8	301236	软通动力	143,793.00	0.53
9	002384	东山精密	143,767.00	0.53
10	002850	科达利	136,685.00	0.50
11	300207	欣旺达	131,274.00	0.48
12	002340	格林美	130,110.00	0.48
13	002797	第一创业	129,478.00	0.47
14	002281	光迅科技	124,540.00	0.46
15	300866	安克创新	121,723.00	0.45
16	002138	顺络电子	115,932.00	0.42
17	688027	国盾量子	110,930.00	0.41
18	300474	景嘉微	110,788.00	0.41
19	002202	金风科技	110,781.00	0.41
20	000066	中国长城	108,339.00	0.40

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	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金

号				资产净值比例(%)
1	002625	光启技术	470,522.00	1.72
2	002384	东山精密	305,194.00	1.12
3	301236	软通动力	253,272.00	0.93
4	300339	润和软件	220,900.00	0.81
5	300866	安克创新	216,623.00	0.79
6	000988	华工科技	184,210.00	0.68
7	002850	科达利	182,515.00	0.67
8	300476	胜宏科技	177,470.00	0.65
9	002128	电投能源	169,782.00	0.62
10	600418	江淮汽车	166,296.00	0.61
11	300207	欣旺达	155,316.00	0.57
12	002966	苏州银行	152,304.00	0.56
13	002340	格林美	151,488.00	0.56
14	300395	菲利华	149,560.00	0.55
15	002202	金风科技	147,823.00	0.54
16	002797	第一创业	143,403.00	0.53
17	002281	光迅科技	142,466.00	0.52
18	002138	顺络电子	134,064.00	0.49
19	002273	水晶光电	129,098.00	0.47
20	300017	网宿科技	127,749.00	0.47

注：本项"卖出金额"均按卖出成交金额（成交单价乘以成交量）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	15,623,901.62
卖出股票收入（成交）总额	18,587,267.26

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（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包含国债期货

#### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金投资范围不包含国债期货

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，苏州银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到江苏证监局、国家金融监督管理总局江苏监管局的处罚。赤峰吉隆黄金矿业股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到内蒙古证监局的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**7.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。**

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	14,563.28
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,563.28

**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	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例

466	49,486.23	14,067,298.00	61.001 5%	8,993,285.00	38.998 5%
-----	-----------	---------------	--------------	--------------	--------------

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中国银行股份有限公司-兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	13,479,900.00	58.45%
2	许安澜	1,100,000.00	4.77%
3	许梅蓉	1,060,000.00	4.60%
4	高芸	498,800.00	2.16%
5	华泰证券股份有限公司	387,088.00	1.68%
6	左涵	265,200.00	1.15%
7	陈伟君	200,000.00	0.87%
7	安景文	200,000.00	0.87%
9	BARCLAYS BANK PLC	193,600.00	0.84%
10	李仁豪	188,800.00	0.82%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.00%

## 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年06月30日)基金份额总额	218,060,583.00
本报告期期初基金份额总额	30,560,583.00
本报告期基金总申购份额	30,000,000.00
减: 本报告期基金总赎回份额	37,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	23,060,583.00

## §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、2025年7月18日，张顺国先生离任兴业基金管理有限公司副总经理，担任兴业基金管理有限公司督察长。详见本公司于2025年7月19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、2025年7月18日，张玲菡女士离任兴业基金管理有限公司督察长，担任兴业基金管理有限公司副总经理。详见本公司于2025年7月19日发布的《兴业基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。

3、本报告期内，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

报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商 名称	交 易 单 元 数 量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期 股票成 交总额 的比 例	佣金	占当期 佣金总 量的比 例	
长江 证券	2	6,346,373.72	18.62%	1,243.30	18.62%	-
光大 证券	2	-	-	-	-	-
国投 证券	2	-	-	-	-	-
国泰 海通 证券	2	27,731,573.84	81.38%	5,433.48	81.38%	-
华安 证券	2	-	-	-	-	-
华创 证券	2	-	-	-	-	-
天风 证券	2	-	-	-	-	-
兴业 证券	1	-	-	-	-	-
太平 洋证 券	2	-	-	-	-	-

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，本期无新增交易单元，无剔除交易单元。

④国泰海通证券股份有限公司(简称“国泰海通”)是由国泰君安证券股份有限公司(简称“国泰君安”)与海通证券股份有限公司(简称“海通证券”)于2025年3月14日合并组建而成。上表显示的国泰海通证券相关数据包含了本报告期通过国泰海通证券、海通证券席位交易的情况。

### 10.7.2 基金租用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	兴业基金管理有限公司澄清公告	中国证监会规定的媒介	2025-01-07
2	兴业中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第四个季度报告	中国证监会规定的媒介	2025-01-22
3	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	2025-02-27
4	兴业基金管理有限公司关于暂停武汉佰鲲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	2025-02-28

5	兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金托管协议	中国证监会规定的媒介	2025-03-19
6	兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同	中国证监会规定的媒介	2025-03-19
7	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	2025-03-19
8	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)(2025年第2号)	中国证监会规定的媒介	2025-03-19
9	关于兴业基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	中国证监会规定的媒介	2025-03-19
10	兴业基金管理有限公司关于福州分公司办公地址变更的公告	中国证监会规定的媒介	2025-03-25
11	兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金2024年年度报告	中国证监会规定的媒介	2025-03-28
12	兴业基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司交易及佣金支付情况公告(2024年度)	中国证监会规定的媒介	2025-03-31
13	兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金2025年第一季度报告	中国证监会规定的媒介	2025-04-22
14	兴业基金管理有限公司关于提醒投资者谨防金融诈骗活动的特别提示公告	中国证监会规定的媒介	2025-04-23
15	关于兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金增加国泰海通证券股份有限公司	中国证监会规定的媒介	2025-05-14

	为一级交易商的公告		
16	兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定的媒介	2025-05-24
17	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)(2025年第3号)	中国证监会规定的媒介	2025-05-27
18	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	2025-05-27
19	兴业基金管理有限公司关于代为履行基金经理职责情况的公告	中国证监会规定的媒介	2025-06-03
20	兴业基金管理有限公司关于旗下公募基金风险评价结果的通知	中国证监会规定的媒介	2025-06-04
21	兴业基金管理有限公司关于旗下基金估值调整情况的公告	中国证监会规定的媒介	2025-06-10
22	兴业基金管理有限公司关于终止民商基金销售(上海)有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定的媒介	2025-06-14
23	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	2025-06-24

## §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

机构	2	20250107-20250107	1,395,288.00	19,756,100.00	20,764,300.00	387,088.00	1.68%
联接基金	1	20250101-20250630	17,193,200.00	27,018,000.00	30,731,300.00	13,479,900.00	58.45%
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

为降低投资者的理财成本，经与本基金托管人协商一致，自2025年3月21日起，本基金指数使用费调整为由基金管理人承担，并相应修订本基金基金合同有关内容。本次调整后，基金管理人旗下全部指数基金的指数使用费均由基金管理人承担。

## §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  
二〇二五年八月二十九日