

# 兴业沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

## 2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人:兴业基金管理有限公司

基金托管人:中信银行股份有限公司

送出日期:2022 年 08 月 31 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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年8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2022年1月1日起至2022年6月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	19
§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股票投资明细	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	51
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	51
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	51
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 投资组合报告附注	51
§8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2 期末上市基金前十名持有人	53

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
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.....	53
§9 开放式基金份额变动.....	54
§10 重大事件揭示.....	54
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
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.....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.8 其他重大事件.....	56
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
§12 备查文件目录.....	57
12.1 备查文件目录.....	57
12.2 存放地点.....	57
12.3 查阅方式.....	57

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	兴业沪深300交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	兴业沪深300ETF
场内简称	兴业沪深300ETF（证券简称：兴业300；扩位证券简称：兴业沪深300ETF）
基金主代码	510370
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020年09月11日
基金管理人	兴业基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	12,258,111.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020年10月27日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。
业绩比较基准	沪深300指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为交易型开放式指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的

	指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
--	----------------------

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		兴业基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张玲菡	姜敏
	联系电话	021-22211888	4006800000
	电子邮箱	zhaoyue@cib-fund.com.cn	jiangmin@citicbank.com
客户服务电话		40000-95561	95558
传真		021-22211997	010-85230024
注册地址		福建省福州市鼓楼区五四路137号信和广场25楼	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
办公地址		上海市浦东新区银城路167号13、14层	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
邮政编码		200120	100020
法定代表人		官恒秋	朱鹤新

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告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 (2022年01月01日- 2022年06月30日)
本期已实现收益	-108,773.88
本期利润	-1,069,104.54
加权平均基金份额本期利润	-0.0872
本期加权平均净值利润率	-9.59%
本期基金份额净值增长率	-8.43%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022年06月30日)
期末可供分配利润	-639,810.81
期末可供分配基金份额利润	-0.0522
期末基金资产净值	11,618,300.19
期末基金份额净值	0.9478
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022年06月30日)
基金份额累计净值增长率	-5.22%

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

过去一个月	10.09%	1.04%	9.62%	1.07%	0.47%	-0.03%
过去三个月	6.85%	1.40%	6.21%	1.43%	0.64%	-0.03%
过去六个月	-8.43%	1.41%	-9.22%	1.45%	0.79%	-0.04%
过去一年	-13.88%	1.22%	-14.15%	1.25%	0.27%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-5.22%	1.18%	-2.12%	1.23%	-3.10%	-0.05%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

兴业基金管理有限公司（以下简称“兴业基金”或“公司”）成立于2013年4月17日，是兴业银行控股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，兴业基金不忘“受人之托、代客理财”的初心本源，牢记“打造一家市场化程度高、专业性强、特色鲜明的优秀基金公司”的责任使命，坚守“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化，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2022年06月30日，兴业基金共管理79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		
那赛男	基金经理	2020-09-11	-	12年	中国籍，硕士学位，具有证券投资基金从业资格。2009年8月至2013年3月在博时基金管理有限公司ETF及量化投资部担任投资分析员；2013年4月至2015年6月在长盛基金管理有限公司权益投资部担任ETF专员；2015年7月至2016年11月在创金合信基金管理有限公司产品开发部从事相关研究工作；2016年11月至2018年4月在创金合信基金管理有限公司指数策略研究投资部历任研究员、基金经理助理，主要从事指数基金投资研究工作。2018年4月加入兴业基金管理有限公司，现任基

					金经理。
朱小明	基金经理	2020-10-12	-	10年	中国籍，北京大学金融数学专业硕士研究生，10年证券从业经验。2012年7月至2014年6月，在国泰基金管理有限公司担任量化研究员；2014年7月至2016年6月，在德骏达隆资产管理有限公司担任量化投资岗；2016年7月至2019年10月，在万家基金管理有限公司担任量化投资岗，期间2017年4月至2019年10月分别担任万家180指数证券投资基金、万家中证红利指数证券投资基金（LOF）、万家上证50交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019年10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合规守信情况的说明

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

本基金作为被动投资的指数基金，其投资目标是通过跟踪、复制沪深300指数，为投资者获取市场长期的平均收益。报告期内我们严格按照基金合同规定，原则上采取完全复制的方法进行投资管理，努力拟合标的指数，减小跟踪误差，将基金跟踪误差控制在较低范围之内。2022年上半年，疫情、海外市场加息等因素共同作用，对于国内经济和金融市场带来了比较大的冲击。做为市场的代表性指数，沪深300指数下跌9.22%。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴业沪深300ETF基金份额净值为0.9478元，本报告期内，基金份额净值增长率为-8.43%，同期业绩比较基准收益率为-9.22%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，美联储加息对于全球市场的冲击已经告一段落。国内方面，防疫政策仍然是投资者需要关切的重要因素，市场的不确定性仍然存在，投资者需要谨慎对待。沪深300指数是市场的主要代表性指数，其长远表现与中国经济的长期发展趋势息息相关。基于对中国经济增长潜力的信心，沪深300指数值得长期持有。

本基金将继续贯彻被动投资理念，紧密跟踪指数，为投资者提供稳定可靠的指数投资工具。

### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。

估值委员会设主任委员一名，由分管运营的公司领导担任，副主任委员一名，由分管合规的公司领导担任，专业委员若干名，由研究部、投资管理部门（视会议议题内容选择相关投资方向部门）、风险部门、监察稽核部门、基金运营部门负责人或其指定人员组成。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。

估值委员会主要工作职责如下：制定合理、公允的估值方法；对估值方法进行讨论并作出评价，在发生了影响估值公允性及合理性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用；评价现有估值方法对新投资策略或新投资品种的适用性，对新投资策略或新投资品种采用的估值方法作出决定；讨论、决定其他与估值相关的重大问题。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。

本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

会计师事务所对相关估值模型、假设及参数的适当性出具意见。

定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1) 每一基金份额享有同等分配权；

2) 本基金收益分配方式为现金分红；

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

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

5) 若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；

6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

本报告期没有应分配但尚未分配的利润。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

本报告期内，本基金自2022年1月1日起至2022年6月30日止基金资产净值低于五千万，已连续六十个工作日以上。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对兴业沪深300交易型开放式指数证

券投资基金2022年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，兴业基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的2022年中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：兴业沪深300交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	312,073.57	277,474.21
结算备付金		-	11,523.88
存出保证金		8,756.71	19,392.77
交易性金融资产	6.4.7.2	11,330,238.46	12,570,763.64
其中：股票投资		11,330,238.46	12,570,763.64
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	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
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	-	48.88
资产总计		11,651,068.74	12,879,203.38
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年06月30日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<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		4,516.79	5,850.34
应付托管费		903.33	1,170.05
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	27,348.43	184,778.26
负债合计		32,768.55	191,798.65
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	12,258,111.00	12,258,111.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-639,810.81	429,293.73
净资产合计		11,618,300.19	12,687,404.73
负债和净资产总计		11,651,068.74	12,879,203.38

注：1、报告截止日2022年6月30日，基金份额净值0.9478元，基金份额总额12,258,111.00份。

2、比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年度末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年度末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 6.2 利润表

会计主体：兴业沪深300交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至 2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日
<b>一、营业总收入</b>		-1,009,268.65	1,081,529.69
1. 利息收入		844.61	2,044.77
其中：存款利息收入	6.4.7.9	844.61	2,044.77
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）		-49,782.60	8,064,630.22
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-157,331.89	7,402,864.83
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	107,549.29	661,765.39
以摊余成本计量的 金融资产终止确认 产生的收益		-	-
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	-960,330.66	-7,193,212.37
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	-	208,067.07
<b>减：二、营业总支出</b>		59,835.89	572,039.40
1. 管理人报酬	6.4.10.2. 1	27,708.86	274,771.18
2. 托管费	6.4.10.2. 2	5,541.73	54,954.22
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	26,585.30	242,314.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,069,104.54	509,490.29
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,069,104.54	509,490.29
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,069,104.54	509,490.29

注：比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：兴业沪深300交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	12,258,111.00	-	429,293.73	12,687,404.73
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	12,258,111.00	-	429,293.73	12,687,404.73

(基金净值)	0			3
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-	-	-1,069,104.54	-1,069,104.54
(一)、综合收益总额	-	-	-1,069,104.54	-1,069,104.54
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
其中: 1. 基金申购款	-	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-	-
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	12,258,111.00	-	-639,810.81	11,618,300.19
项 目	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	114,258,111.00	-	10,975,504.02	125,233,615.02
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	114,258,111.00	-	10,975,504.02	125,233,615.02

(基金净值)	00		2	02
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-69,000,000.00	-	-6,428,572.80	-75,428,572.80
(一)、综合收益总额	-	-	509,490.29	509,490.29
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-69,000,000.00	-	-6,938,063.09	-75,938,063.09
其中: 1. 基金申购款	3,000,000.00	-	516,859.29	3,516,859.29
2. 基金赎回款	-72,000,000.00	-	-7,454,922.38	-79,454,922.38
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	45,258,111.00	-	4,546,931.22	49,805,042.22

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:

官恒秋

张顺国

夏鹏

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

兴业沪深300交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人兴业基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《兴业沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管

管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]773号文准予公开募集注册。本基金为交易型开放式基金,存续期限为不定期。本基金首次设立募集基金份额为 216,258,111.00 份,经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为毕马威华振验字第2000593号验资报告。《兴业沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于2020年9月11日正式生效。本基金的基金管理人为兴业基金管理有限公司,基金托管人为中信银行股份有限公司(以下简称“中信银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的《兴业沪深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括标的指数的成份股及其备选成份股、其他股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、股指期货、债券(包括国债、地方政府债、政府支持机构债券、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、同业存单、现金,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%,且不低于非现金基金资产的80%。如法律法规或中国证监会允许,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。在正常市场情况下,力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年跟踪误差不超过2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施,避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。本基金的业绩比较基准为标的指数,即沪深300指数收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的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2022年6月30日的财务状况以及自2022年1月1日起至2022年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 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

除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

## 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 会计政策变更的说明

根据《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》、《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日，本基金因执行新金融工具准则调减期初基金净值人民币 0.00 元，本基金执行新金融工具准则的影响如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息，金额分别为人民币 277,474.21 元、人民币 11,523.88 元、人民币 19,392.77 元、人民币 48.88 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息，金额分别为人民币 277,507.80 元、人民币 11,529.60 元、人民币 19,402.34 元、人民币 0.00 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产，金额为人民币 12,570,763.64 元，归属于交易性金融资产的应收利息金额为人民币 0.00 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产，金额为人民币 12,570,763.64 元。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需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》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。

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日	
	活期存款	312,073.57
等于：本金	312,049.12	
加：应计利息	24.45	
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	312,073.57	

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	12,369,633.84	-	11,330,238.46	-1,039,395.38
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		12,369,633.84	-	11,330,238.46	-1,039,395.38

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

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 2022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	890.63
其中：交易所市场	890.63
银行间市场	-



应付利息	-
预提费用	24,795.19
应付指数使用费	1,662.61
合计	27,348.43

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	12,258,111.00	12,258,111.00
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	12,258,111.00	12,258,111.00

注：本期申购含红利再投、转换入份（金）额，本期赎回含转换出份（金）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
本期期初	2,362,591.22	-1,933,297.49	429,293.73
本期利润	-108,773.88	-960,330.66	-1,069,104.54
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,253,817.34	-2,893,628.15	-639,810.81

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日

活期存款利息收入	585.89
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	177.62
其他	81.10
合计	844.61

#### 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 2022年01月01日至2022年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-157,331.89
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-157,331.89

##### 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 2022年01月01日至2022年06月30日
卖出股票成交总额	897,656.96
减：卖出股票成本总额	1,052,748.91
减：交易费用	2,239.94
买卖股票差价收入	-157,331.89

#### 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

本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

#### 6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

#### 6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
股票投资产生的股利收益	107,549.29
基金投资产生的股利收益	-
合计	107,549.29

#### 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	-960,330.66
——股票投资	-960,330.66
——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	-960,330.66

#### 6.4.7.16 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

#### 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 2022年01月01日至2022年06月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	-
汇划手续费	127.50
其他费用_指数使用费	1,662.61
合计	26,585.30

#### 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
中信银行股份有限公司（以下简称“中信银行”）	基金托管人
兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）	基金管理人的控股股东
中海集团投资有限公司	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

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

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期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

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 6.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行基金交易。

###### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期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 2022年01月01日至202 2年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至202 1年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	27,708.86	274,771.18
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人兴业基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.50%÷当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年01月01日至2022年06月30日	2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	5,541.73	54,954.22

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

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期未发生与关联方进行银行间同业市场债券(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自有资金投资本基金的情况

本报告期基金管理人未运用自有资金投资本基金。

##### 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

本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 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	
	2022年01月01日至2022年06月30日		2021年01月01日至2021年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行股份有限公司	312,073.57	585.89	2,229,287.09	1,086.87

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中信银行保管，按银行同业利率或协议利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期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

本基金本报告期无须说明的其他关联交易事项。

#### 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（2022年06月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 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市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的与本基金所投资金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金基金管理人从事风险管理的主要目标是在有效控制上述风险的前提下，通过对各类市场影响因素分析以及投资组合积极主动管理，力争获得超过业绩比较基准的长期稳定收益，使本基金在风险和收益之间取得最佳平衡。

本基金基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。本基金基金管理人建立的风险管理体系由三层风险防范等级构成：

一级风险防范是指公司董事会层面对公司的风险进行的预防和控制。董事会下设审计与风险管理委员会，负责公司审计风险的控制、管理、监督和评价；对公司经营的合法、合规性进行监控和检查，对经营活动进行审计。

二级风险防范是指公司内部控制与风险管理委员会、投资决策委员会和风险管理部层次对公司风险进行的预防和控制。管理层下设内部控制与风险管理委员会，对公司在

经营管理和基金运作中的风险进行研究、分析与评估，制定相应风险控制制度并监督其执行，全面、及时、有效地防范公司经营过程中可能面临的各类风险。

三级风险防范是指公司各部门对自身业务工作风险进行的自我检查和控制。公司各部门根据经营计划、业务规则及部门具体情况，制定本部门业务流程及风险控制措施。

针对金融工具所面临的相关风险，本基金基金管理人主要通过定性与定量分析相结合的方法进行管理，即依据定性分析以判断风险损失的严重程度及同类风险损失的发生频度，凭借定量分析以确定风险损失的限度及相应的置信程度，进而及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，以确保将风险控制在可承受范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金所投资证券的发行人出现违约或拒绝支付到期利息、本金，或基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任等，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金基金管理人建立了较为完善的信用风险管理流程，通过对信用债券发行人基本面调研分析，结合流动性、信用利差、信用评级、违约风险等方面的综合评估结果，选取具有价格优势和套利机会的优质信用债券产品进行投资。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。本基金通过对银行间同业市场交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金基金管理人旗下其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金的交易所交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手，并完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。

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

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易相对不活跃导致基金投资资产无法以适当价格及时变现，进而无法应对债务到期偿付或投资者赎回款按时支付的风险。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析



本报告期内，基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理。本基金所持大部分证券在证券交易所上市或银行间同业市场交易，不存在具有重大流动性风险的投资品种。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度，按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

截止本报告期末及上年度末，本基金无重大流动性风险。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金基金管理人主要通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年0 6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	312,073.57	-	-	-	312,073.57
存出保证金	8,756.71	-	-	-	8,756.71
交易性金融资	-	-	-	11,330,238.46	11,330,238.46

产					
资产总计	320,830.28	-	-	11,330,238.46	11,651,068.74
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	4,516.79	4,516.79
应付托管费	-	-	-	903.33	903.33
其他负债	-	-	-	27,348.43	27,348.43
负债总计	-	-	-	32,768.55	32,768.55
利率敏感度缺口	320,830.28	-	-	11,297,469.91	11,618,300.19
上年度末 2021 年 1 2 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	277,474.21	-	-	-	277,474.21
结算备付金	11,523.88	-	-	-	11,523.88
存出保证金	19,392.77	-	-	-	19,392.77
交易性金融资产	-	-	-	12,570,763.64	12,570,763.64
应收利息	-	-	-	48.88	48.88
资产总计	308,390.86	-	-	12,570,812.52	12,879,203.38
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	5,850.34	5,850.34
应付托管费	-	-	-	1,170.05	1,170.05
应付交易费用	-	-	-	13,684.29	13,684.29
其他负债	-	-	-	171,093.97	171,093.97

负债总计	-	-	-	191,798.65	191,798.65
利率敏感度缺口	308,390.86	-	-	12,379,013.87	12,687,404.73

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 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 2022年06月30日		上年度末 2021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	11,330,238.46	97.52	12,570,763.64	99.08
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	11,330,238.46	97.52	12,570,763.64	99.08

#### 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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	股票价格上升5%	566,511.92	628,538.18
	股票价格下降5%	-566,511.92	-628,538.18

#### 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

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	11,330,238.46	12,570,763.64
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	11,330,238.46	12,570,763.64

#### 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

于2022年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

#### 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

无。

## § 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	11,330,238.46	97.25
	其中：股票	11,330,238.46	97.25
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	312,073.57	2.68
8	其他各项资产	8,756.71	0.08
9	合计	11,651,068.74	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	131,708.40	1.13
B	采矿业	314,290.00	2.71
C	制造业	6,753,963.95	58.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	273,422.00	2.35
E	建筑业	212,816.60	1.83
F	批发和零售业	24,672.00	0.21
G	交通运输、仓储和邮政业	301,990.00	2.60
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	361,789.20	3.11
J	金融业	2,294,849.38	19.75
K	房地产业	213,142.00	1.83
L	租赁和商务服务业	154,153.00	1.33
M	科学研究和技术服务业	177,290.00	1.53

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	4,632.00	0.04
Q	卫生和社会工作	101,511.93	0.87
R	文化、体育和娱乐业	10,008.00	0.09
S	综合	-	-
	合计	11,330,238.46	97.52

### 7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 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	600519	贵州茅台	300	613,500.00	5.28
2	300750	宁德时代	800	427,200.00	3.68
3	600036	招商银行	6,800	286,960.00	2.47
4	601318	中国平安	6,000	280,140.00	2.41
5	601012	隆基绿能	3,360	223,876.80	1.93
6	000858	五粮液	1,100	222,123.00	1.91
7	002594	比亚迪	500	166,745.00	1.44
8	000333	美的集团	2,700	163,053.00	1.40
9	601166	兴业银行	8,000	159,200.00	1.37
10	600900	长江电力	6,300	145,656.00	1.25
11	300059	东方财富	5,496	139,598.40	1.20
12	600030	中信证券	5,405	117,072.30	1.01
13	601888	中国中免	500	116,465.00	1.00

14	603259	药明康德	1,100	114,389.00	0.98
15	600887	伊利股份	2,800	109,060.00	0.94
16	000568	泸州老窖	400	98,616.00	0.85
17	002415	海康威视	2,600	94,120.00	0.81
18	300760	迈瑞医疗	300	93,960.00	0.81
19	600276	恒瑞医药	2,500	92,725.00	0.80
20	601398	工商银行	19,400	92,538.00	0.80
21	002475	立讯精密	2,700	91,233.00	0.79
22	600438	通威股份	1,500	89,790.00	0.77
23	000651	格力电器	2,600	87,672.00	0.75
24	600309	万华化学	900	87,291.00	0.75
25	000001	平安银行	5,400	80,892.00	0.70
26	002142	宁波银行	2,210	79,140.10	0.68
27	002714	牧原股份	1,420	78,483.40	0.68
28	000002	万科 A	3,800	77,900.00	0.67
29	601328	交通银行	15,200	75,696.00	0.65
30	002812	恩捷股份	300	75,135.00	0.65
31	002466	天齐锂业	600	74,880.00	0.64
32	601899	紫金矿业	8,000	74,640.00	0.64
33	000792	盐湖股份	2,400	71,904.00	0.62
34	600809	山西汾酒	220	71,456.00	0.62
35	600436	片仔癀	200	71,346.00	0.61
36	002129	TCL中环	1,200	70,668.00	0.61
37	600048	保利发展	4,000	69,840.00	0.60
38	300124	汇川技术	1,050	69,163.50	0.60
39	603288	海天味业	759	68,583.24	0.59
40	300015	爱尔眼科	1,509	67,557.93	0.58
41	000725	京东方 A	16,700	65,798.00	0.57
42	600031	三一重工	3,300	62,898.00	0.54
43	603799	华友钴业	650	62,153.00	0.53
44	601668	中国建筑	11,600	61,712.00	0.53



45	002352	顺丰控股	1,100	61,391.00	0.53
46	300896	爱美客	100	60,001.00	0.52
47	601088	中国神华	1,800	59,940.00	0.52
48	002460	赣锋锂业	400	59,480.00	0.51
49	300274	阳光电源	600	58,950.00	0.51
50	300014	亿纬锂能	600	58,500.00	0.50
51	600690	海尔智家	2,100	57,666.00	0.50
52	600089	特变电工	2,100	57,519.00	0.50
53	002304	洋河股份	300	54,945.00	0.47
54	601816	京沪高铁	10,800	54,216.00	0.47
55	300498	温氏股份	2,500	53,225.00	0.46
56	601288	农业银行	17,600	53,152.00	0.46
57	600000	浦发银行	6,500	52,065.00	0.45
58	600837	海通证券	5,300	51,993.00	0.45
59	603501	韦尔股份	300	51,909.00	0.45
60	002271	东方雨虹	1,000	51,470.00	0.44
61	600406	国电南瑞	1,896	51,192.00	0.44
62	600016	民生银行	13,700	50,964.00	0.44
63	688981	中芯国际	1,100	49,687.00	0.43
64	300751	迈为股份	100	49,090.00	0.42
65	601919	中远海控	3,480	48,372.00	0.42
66	000625	长安汽车	2,782	48,184.24	0.41
67	000661	长春高新	200	46,684.00	0.40
68	600919	江苏银行	6,540	46,564.80	0.40
69	600104	上汽集团	2,600	46,306.00	0.40
70	000063	中兴通讯	1,800	45,954.00	0.40
71	600585	海螺水泥	1,300	45,864.00	0.39
72	603986	兆易创新	320	45,507.20	0.39
73	601601	中国太保	1,900	44,707.00	0.38
74	601225	陕西煤业	2,100	44,478.00	0.38
75	300122	智飞生物	400	44,404.00	0.38

76	002459	晶澳科技	560	44,184.00	0.38
77	002241	歌尔股份	1,300	43,680.00	0.38
78	300142	沃森生物	900	43,551.00	0.37
79	600111	北方稀土	1,200	42,192.00	0.36
80	002230	科大讯飞	1,000	41,220.00	0.35
81	601688	华泰证券	2,800	39,760.00	0.34
82	688111	金山办公	200	39,424.00	0.34
83	603290	斯达半导	100	38,590.00	0.33
84	601211	国泰君安	2,500	38,000.00	0.33
85	002049	紫光国微	200	37,944.00	0.33
86	300450	先导智能	600	37,908.00	0.33
87	601988	中国银行	11,600	37,816.00	0.33
88	002027	分众传媒	5,600	37,688.00	0.32
89	002709	天赐材料	600	37,236.00	0.32
90	601169	北京银行	8,200	37,228.00	0.32
91	000100	TCL科技	7,700	36,883.00	0.32
92	601229	上海银行	5,500	36,025.00	0.31
93	600050	中国联通	10,300	35,638.00	0.31
94	601390	中国中铁	5,700	34,998.00	0.30
95	601766	中国中车	6,700	34,840.00	0.30
96	300347	泰格医药	300	34,335.00	0.30
97	600745	闻泰科技	400	34,044.00	0.29
98	603659	璞泰来	400	33,760.00	0.29
99	600660	福耀玻璃	800	33,448.00	0.29
100	601669	中国电建	4,200	33,054.00	0.28
101	000338	潍柴动力	2,600	32,422.00	0.28
102	601658	邮储银行	6,000	32,340.00	0.28
103	600893	航发动力	700	31,857.00	0.27
104	600196	复星医药	700	30,863.00	0.27
105	600028	中国石化	7,400	30,192.00	0.26
106	000776	广发证券	1,600	29,920.00	0.26

107	600010	包钢股份	12,600	29,610.00	0.25
108	600570	恒生电子	680	29,607.20	0.25
109	002920	德赛西威	200	29,600.00	0.25
110	600905	三峡能源	4,700	29,563.00	0.25
111	600019	宝钢股份	4,900	29,498.00	0.25
112	601009	南京银行	2,800	29,176.00	0.25
113	600958	东方证券	2,844	29,037.24	0.25
114	002821	凯莱英	100	28,900.00	0.25
115	600999	招商证券	2,000	28,820.00	0.25
116	601857	中国石油	5,400	28,620.00	0.25
117	300759	康龙化成	300	28,566.00	0.25
118	600009	上海机场	500	28,350.00	0.24
119	601628	中国人寿	900	27,972.00	0.24
120	002371	北方华创	100	27,712.00	0.24
121	601818	光大银行	9,100	27,391.00	0.24
122	300661	圣邦股份	150	27,303.00	0.23
123	002410	广联达	500	27,220.00	0.23
124	601985	中国核电	3,900	26,754.00	0.23
125	600346	恒力石化	1,200	26,688.00	0.23
126	002493	荣盛石化	1,700	26,163.00	0.23
127	688599	天合光能	400	26,100.00	0.22
128	300496	中科创达	200	26,096.00	0.22
129	601633	长城汽车	700	25,928.00	0.22
130	688005	容百科技	200	25,888.00	0.22
131	000538	云南白药	420	25,363.80	0.22
132	000596	古井贡酒	100	24,966.00	0.21
133	000768	中航西飞	800	24,232.00	0.21
134	002311	海大集团	400	24,004.00	0.21
135	600926	杭州银行	1,600	23,968.00	0.21
136	600176	中国巨石	1,359	23,660.19	0.20
137	000895	双汇发展	800	23,440.00	0.20

138	601989	中国重工	6,300	23,373.00	0.20
139	600426	华鲁恒升	800	23,360.00	0.20
140	688012	中微公司	200	23,350.00	0.20
141	001979	招商蛇口	1,700	22,831.00	0.20
142	002074	国轩高科	500	22,800.00	0.20
143	603392	万泰生物	145	22,518.50	0.19
144	002001	新和成	984	22,445.04	0.19
145	601939	建设银行	3,700	22,422.00	0.19
146	603993	洛阳钼业	3,900	22,347.00	0.19
147	002202	金风科技	1,500	22,200.00	0.19
148	300207	欣旺达	700	22,120.00	0.19
149	002050	三花智控	800	21,984.00	0.19
150	600760	中航沈飞	360	21,762.00	0.19
151	300957	贝泰妮	100	21,753.00	0.19
152	601006	大秦铁路	3,300	21,747.00	0.19
153	601138	工业富联	2,200	21,648.00	0.19
154	300782	卓胜微	160	21,600.00	0.19
155	000166	申万宏源	5,000	21,450.00	0.18
156	300763	锦浪科技	100	21,300.00	0.18
157	600460	士兰微	400	20,800.00	0.18
158	600600	青岛啤酒	200	20,784.00	0.18
159	600741	华域汽车	900	20,700.00	0.18
160	600029	南方航空	2,800	20,468.00	0.18
161	601377	兴业证券	2,900	20,445.00	0.18
162	601600	中国铝业	4,300	20,425.00	0.18
163	300316	晶盛机电	300	20,277.00	0.17
164	002179	中航光电	320	20,262.40	0.17
165	601066	中信建投	700	20,237.00	0.17
166	601838	成都银行	1,200	19,896.00	0.17
167	601186	中国铁建	2,500	19,750.00	0.17
168	600588	用友网络	900	19,539.00	0.17

169	600795	国电电力	4,900	19,159.00	0.16
170	600584	长电科技	700	18,900.00	0.16
171	601111	中国国航	1,600	18,576.00	0.16
172	601100	恒立液压	300	18,516.00	0.16
173	000876	新希望	1,200	18,360.00	0.16
174	603806	福斯特	280	18,345.60	0.16
175	601238	广汽集团	1,200	18,288.00	0.16
176	003816	中国广核	6,500	18,200.00	0.16
177	688008	澜起科技	300	18,174.00	0.16
178	002648	卫星化学	700	18,095.00	0.16
179	000963	华东医药	400	18,064.00	0.16
180	300408	三环集团	600	18,060.00	0.16
181	601877	正泰电器	500	17,890.00	0.15
182	600015	华夏银行	3,400	17,714.00	0.15
183	601800	中国交建	1,900	17,632.00	0.15
184	600989	宝丰能源	1,200	17,580.00	0.15
185	600383	金地集团	1,300	17,472.00	0.15
186	600763	通策医疗	100	17,444.00	0.15
187	603019	中科曙光	600	17,412.00	0.15
188	601788	光大证券	1,100	17,336.00	0.15
189	000786	北新建材	500	17,310.00	0.15
190	300595	欧普康视	300	17,157.00	0.15
191	601799	星宇股份	100	17,100.00	0.15
192	605499	东鹏饮料	100	17,086.00	0.15
193	000157	中联重科	2,700	16,632.00	0.14
194	603882	金域医学	200	16,510.00	0.14
195	600115	中国东航	3,000	16,470.00	0.14
196	601117	中国化学	1,700	15,997.00	0.14
197	600085	同仁堂	300	15,864.00	0.14
198	600188	兖矿能源	400	15,792.00	0.14
199	603185	上机数控	100	15,599.00	0.13

200	601901	方正证券	2,300	15,433.00	0.13
201	603369	今世缘	300	15,300.00	0.13
202	603195	公牛集团	100	15,291.00	0.13
203	300529	健帆生物	300	15,267.00	0.13
204	300628	亿联网络	200	15,230.00	0.13
205	600150	中国船舶	800	15,184.00	0.13
206	603833	欧派家居	100	15,068.00	0.13
207	002841	视源股份	200	15,064.00	0.13
208	000069	华侨城 A	2,300	14,927.00	0.13
209	002555	三七互娱	700	14,861.00	0.13
210	600547	山东黄金	800	14,848.00	0.13
211	600132	重庆啤酒	100	14,660.00	0.13
212	300601	康泰生物	320	14,457.60	0.12
213	600352	浙江龙盛	1,400	14,252.00	0.12
214	002601	龙佰集团	700	14,035.00	0.12
215	600886	国投电力	1,300	13,650.00	0.12
216	000301	东方盛虹	800	13,528.00	0.12
217	002008	大族激光	400	13,252.00	0.11
218	000977	浪潮信息	500	13,240.00	0.11
219	002236	大华股份	800	13,136.00	0.11
220	002252	上海莱士	2,200	13,046.00	0.11
221	300003	乐普医疗	700	12,999.00	0.11
222	002791	坚朗五金	100	12,972.00	0.11
223	601336	新华保险	400	12,876.00	0.11
224	601868	中国能建	5,400	12,798.00	0.11
225	600011	华能国际	1,800	12,672.00	0.11
226	000425	徐工机械	2,300	12,397.00	0.11
227	300919	中伟股份	100	12,390.00	0.11
228	603486	科沃斯	100	12,189.00	0.10
229	300433	蓝思科技	1,100	12,177.00	0.10
230	600941	中国移动	200	12,100.00	0.10

231	600845	宝信软件	220	12,012.00	0.10
232	688396	华润微	200	11,814.00	0.10
233	603260	合盛硅业	100	11,796.00	0.10
234	601021	春秋航空	200	11,670.00	0.10
235	000938	紫光股份	600	11,640.00	0.10
236	601916	浙商银行	3,500	11,620.00	0.10
237	002736	国信证券	1,200	11,484.00	0.10
238	600918	中泰证券	1,500	11,475.00	0.10
239	601865	福莱特	300	11,430.00	0.10
240	002007	华兰生物	500	11,400.00	0.10
241	603899	晨光股份	200	11,216.00	0.10
242	688561	奇安信	200	11,160.00	0.10
243	600219	南山铝业	3,000	11,070.00	0.10
244	000066	中国长城	1,000	10,820.00	0.09
245	300999	金龙鱼	200	10,804.00	0.09
246	300223	北京君正	100	10,625.00	0.09
247	601618	中国中冶	3,000	10,500.00	0.09
248	600018	上港集团	1,800	10,494.00	0.09
249	601898	中煤能源	1,000	10,380.00	0.09
250	300454	深信服	100	10,378.00	0.09
251	601878	浙商证券	900	10,242.00	0.09
252	002120	韵达股份	600	10,236.00	0.09
253	601360	三六零	1,200	10,224.00	0.09
254	600183	生益科技	600	10,194.00	0.09
255	601155	新城控股	400	10,172.00	0.09
256	000708	中信特钢	500	10,075.00	0.09
257	300413	芒果超媒	300	10,008.00	0.09
258	000408	藏格矿业	300	9,882.00	0.09
259	601728	中国电信	2,600	9,698.00	0.08
260	300033	同花顺	100	9,615.00	0.08
261	600332	白云山	300	9,477.00	0.08

262	000703	恒逸石化	900	9,459.00	0.08
263	002916	深南电路	100	9,371.00	0.08
264	600061	国投资本	1,464	9,311.04	0.08
265	601216	君正集团	1,900	9,272.00	0.08
266	688126	沪硅产业	400	9,192.00	0.08
267	002602	世纪华通	1,900	9,158.00	0.08
268	002938	鹏鼎控股	300	9,063.00	0.08
269	688036	传音控股	100	8,923.00	0.08
270	600362	江西铜业	500	8,915.00	0.08
271	601995	中金公司	200	8,898.00	0.08
272	600489	中金黄金	1,200	8,868.00	0.08
273	002414	高德红外	672	8,648.64	0.07
274	002568	百润股份	280	8,411.20	0.07
275	601966	玲珑轮胎	300	7,611.00	0.07
276	300979	华利集团	100	7,308.00	0.06
277	600161	天坛生物	300	7,284.00	0.06
278	601881	中国银河	700	6,769.00	0.06
279	300866	安克创新	100	6,632.00	0.06
280	600655	豫园股份	700	6,608.00	0.06
281	600606	绿地控股	1,610	6,375.60	0.05
282	603160	汇顶科技	100	6,193.00	0.05
283	601998	中信银行	1,300	6,175.00	0.05
284	601319	中国人保	1,200	6,072.00	0.05
285	002600	领益智造	1,200	6,024.00	0.05
286	002032	苏泊尔	100	5,634.00	0.05
287	600025	华能水电	800	5,592.00	0.05
288	002064	华峰化学	600	5,064.00	0.04
289	603087	甘李药业	100	4,797.00	0.04
290	002607	中公教育	800	4,632.00	0.04
291	601808	中海油服	300	4,185.00	0.04
292	601236	红塔证券	450	4,108.50	0.04



293	000800	一汽解放	400	3,736.00	0.03
294	000877	天山股份	300	3,690.00	0.03
295	601825	沪农商行	500	3,135.00	0.03
296	601698	中国卫通	200	2,262.00	0.02
297	001289	龙源电力	100	2,176.00	0.02

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300896	爱美客	99,449.00	0.78
2	000792	盐湖股份	76,476.00	0.60
3	600089	特变电工	54,301.00	0.43
4	300751	迈为股份	37,349.00	0.29
5	603290	斯达半导	32,990.00	0.26
6	603195	公牛集团	30,300.00	0.24
7	605499	东鹏饮料	29,746.00	0.23
8	002920	德赛西威	29,186.00	0.23
9	002074	国轩高科	26,760.00	0.21
10	300661	圣邦股份	25,888.00	0.20
11	300496	中科创达	24,830.00	0.20
12	600460	士兰微	22,984.00	0.18
13	600188	兖矿能源	21,367.00	0.17
14	300207	欣旺达	21,164.00	0.17
15	688005	容百科技	20,748.00	0.16
16	600941	中国移动	19,701.00	0.16
17	300957	贝泰妮	19,309.00	0.15
18	002648	卫星化学	19,184.00	0.15

19	601117	中国化学	17,489.00	0.14
20	300763	锦浪科技	16,250.00	0.13

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	204,700.00	1.61
2	300896	爱美客	51,677.00	0.41
3	600809	山西汾酒	27,713.00	0.22
4	605499	东鹏饮料	14,211.00	0.11
5	603195	公牛集团	14,101.00	0.11
6	002460	赣锋锂业	14,049.00	0.11
7	601108	财通证券	13,917.80	0.11
8	000783	长江证券	12,969.00	0.10
9	601607	上海医药	12,752.00	0.10
10	300122	智飞生物	12,330.00	0.10
11	600109	国金证券	12,148.00	0.10
12	300144	宋城演艺	11,189.00	0.09
13	603799	华友钴业	11,185.00	0.09
14	601696	中银证券	10,762.00	0.08
15	600079	人福医药	9,961.00	0.08
16	601990	南京证券	9,747.00	0.08
17	600143	金发科技	9,338.00	0.07
18	603517	绝味食品	9,303.00	0.07
19	603939	益丰药房	9,157.00	0.07
20	601933	永辉超市	8,749.00	0.07

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	772,554.39
卖出股票收入（成交）总额	897,656.96

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包含国债期货

##### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金投资范围不包含国债期货

#### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 1. 2021年8月20日，兴业银行股份有限公司因未依法履行其他职责，被中国人民银行罚款5万元。

2. 2022年3月25日，兴业银行股份有限公司因未依法履行其他职责，被中国银行保险监督管理委员会罚款350万元。

3. 2022年3月25日，招商银行股份有限公司因未依法履行其他职责，被中国银行保险监督管理委员会罚款300万元。

报告期内基金投资的前十名证券除上述主体外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。本基金管理人的研究部门对上述主体保持了及时的研究跟踪，投资决策符合本基金管理人的投资流程。

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	8,756.71
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	8,756.71

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
741	16,542.66	0.00	0.00%	12,258,111.00	100.00%

### 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	钱中明	623,400.00	5.09%
2	郭林发	458,800.00	3.74%
3	周小平	286,100.00	2.33%
4	杜冰	250,000.00	2.04%
5	沈金娣	250,000.00	2.04%
6	李碧霞	200,000.00	1.63%
7	章霞	200,000.00	1.63%
8	吴献忠	200,000.00	1.63%
9	郑宜昌	193,900.00	1.58%
10	李禹梅	154,100.00	1.26%

### 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	10,000.00	0.0816%

### 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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	0

本基金基金经理持有本开放式基金	0
-----------------	---

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年09月11日)基金份额总额	216,258,111.00
本报告期期初基金份额总额	12,258,111.00
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	12,258,111.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 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、2022年1月13日，云凤生先生担任兴业基金管理有限公司首席信息官，详见本公司于2022年1月14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、2022年8月8日，张玲菡女士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，总经理胡斌先生不再代行督察长职务。详见本公司于2022年8月9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

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 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

本报告期内基金管理人和基金托管人托管业务部门及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

## 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	
国盛证券	2	758,747.86	45.94%	554.88	45.94%	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	892,986.10	54.06%	652.96	54.06%	-

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 资历雄厚，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，并能满足基金运作高度保密的要求。具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需 要，并能为本基金提供全面的信息服务。
- iv 投研交综合实力较强。
- v 其他因素(综合能力一般，但在某些特色领域或行业，研究能力、深度和质量在行业领先)。

②券商专用交易单元选择程序：

- i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

- ii 协议签署及通知托管人

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本期无新增、剔除交易单元。

### 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	兴业基金管理有限公司关于旗下资产管理产品执行新金融工具相关准则的公告	中国证监会规定的媒介	2022-01-01
2	兴业基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定的媒介	2022-01-14
3	兴业基金管理有限公司旗下基金2021年第四季度报告	中国证监会规定的媒介	2022-01-22
4	兴业基金管理有限公司旗下公募基金招募说明书(更新)(2022年第1号)	中国证监会规定的媒介	2022-03-06
5	兴业基金管理有限公司旗下公募基金2021年年度报告	中国证监会规定的媒介	2022-03-31
6	兴业基金管理有限公司旗下基金2022年第一季度报告	中国证监会规定的媒介	2022-04-22
7	关于网络平台冒用“兴业基金”名义进行不法活动的澄清公告	中国证监会规定的媒介	2022-04-25
8	兴业基金管理有限公司关于终止北京植信基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定的媒介	2022-05-28
9	兴业基金管理有限公司关于终止北京唐鼎耀华基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定的媒介	2022-05-28



10	兴业基金管理有限公司关于旗下管理的上海证券交易所上市ETF实施申赎业务多码合一的公告	中国证监会规定的媒介	2022-06-18
11	兴业沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定的媒介	2022-06-20

## § 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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予兴业沪深300交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件
- (二) 《兴业沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- (三) 《兴业沪深300交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- (四) 法律意见书
- (五) 基金管理人业务资格批件和营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件和营业执照
- (七) 中国证监会要求的其他文件

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的住所

### 12.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅。

网站：<http://www.cib-fund.com.cn>

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人兴业基金管理有限公司。

客户服务中心电话：4000095561

兴业基金管理有限公司  
二〇二二年八月三十一日