

兴业中证 500 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:中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国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06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作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	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	10
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	11
§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	12
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	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（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
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	59
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	59
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	59
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.12 投资组合报告附注	59
§8 基金份额持有人信息	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
8.2 期末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.....	61
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.....	61
§9 开放式基金份额变动.....	61
§10 重大事件揭示.....	61
10.1 基金份额持有人大会决议.....	61
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	62
10.4 基金投资策略的改变.....	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	62
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	62
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.....	64
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
§12 备查文件目录.....	65
12.1 备查文件目录.....	65
12.2 存放地点.....	66
12.3 查阅方式.....	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴业中证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	10,560,583.00份
基金合同存续期	不定期
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。
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	张玲菡	许俊
	联系电话	021-22211888	010-66596688
	电子邮箱	zhaoyue@cib-fund.com.cn	fcid@bankofchina.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		官恒秋	刘连舸

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层及基金托管人住所

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	-212, 216. 20
本期利润	-939, 976. 88
加权平均基金份额本期利润	-0. 0827
本期加权平均净值利润率	-8. 77%
本期基金份额净值增长率	-10. 85%
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	-344, 405. 41
期末可供分配基金份额利润	-0. 0326
期末基金资产净值	10, 216, 177. 59
期末基金份额净值	0. 9674
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	-3. 26%

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	7.48%	1.05%	7.10%	1.10%	0.38%	-0.05%
过去三个月	3.04%	1.67%	2.04%	1.75%	1.00%	-0.08%
过去六个月	-10.85%	1.56%	-12.30%	1.63%	1.45%	-0.07%
过去一年	-4.80%	1.26%	-5.20%	1.33%	0.40%	-0.07%
自基金合同生效起至今	-3.26%	1.13%	12.00%	1.29%	-15.26%	-0.16%

注：本基金的业绩比较基准为标的指数，即中证500指数收益率。

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



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

兴业基金管理有限公司（以下简称“兴业基金”或“公司”）成立于2013年4月17日，是兴业银行控股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	2020-06-30	-	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。
--	--	--	--	--	------

- 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《证券投资基金经营机构董事、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

2022上半年，市场先跌后涨，期末沪深300，中证500，创业板指较年初涨幅分别为-9.22%，-12.3%，-15.41%，其中煤炭，交运等行业板块涨幅显著。本产品严格按照基金合同的规定，紧密跟踪标的指数、跟踪偏离最小化的投资策略进行被动投资。本报告期内，本产品较好地实现了本基金的投资目标。

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0.9674元，本报告期内，基金份额净值增长率为-10.85%，同期业绩比较基准收益率为-12.30%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

三季度货币环境存在压力，当前市场对于宽松预期过高，三季度欧美都会快速收紧货币，且短期美国硬着陆风险是上升的，国际货币环境对A股市场压力会加大。国内需要正视CPI上行，而如果稳增长进一步发力，利率水平向上的概率会提升。经济和市场的核心问题仍待解决，市场仍是磨底震荡。下半年有望出现明显转机，结构性机会的轮动空间大。

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》，基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。

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

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

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	380,155.28	626,968.65
结算备付金		59.39	-
存出保证金		4,339.53	50,467.68
交易性金融资产	6.4.7.2	9,867,919.57	10,977,754.93
其中：股票投资		9,867,919.57	10,976,458.83
基金投资		-	-

债券投资		-	1,296.10
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	-	163.43
资产总计		10,252,473.77	11,655,354.69
负债和净资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		384.00	3,614.40
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		4,748.06	5,957.16
应付托管费		949.58	1,191.43

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	30,214.54	185,011.90
负债合计		36,296.18	195,774.89
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	10,560,583.00	10,560,583.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-344,405.41	898,996.80
净资产合计		10,216,177.59	11,459,579.80
负债和净资产总计		10,252,473.77	11,655,354.69

注：1、报告截止日2022年6月30日，基金份额净值0.9674元，基金份额总额10,560,583.00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：兴业中证500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202 1年06月30日
一、营业总收入		-881,519.02	10,145,103.34
1. 利息收入		1,126.32	3,347.71
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,126.32	3,347.71

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）		-177,773.80	4,350,805.16
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-306,389.19	3,352,113.69
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	293.09	-
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
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	128,322.30	998,691.47
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	-727,760.68	5,517,665.69
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	22,889.14	273,284.78
减：二、营业总支出		58,457.86	738,154.23
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	26,549.78	331,246.86
2. 托管费	6.4.10.2.2	5,309.96	66,249.37
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	26,598.12	340,658.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-939,976.88	9,406,949.11
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-939,976.88	9,406,949.11
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-939,976.88	9,406,949.11

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：兴业中证500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）	10,560,583.00	-	898,996.80	11,459,579.80
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更	-	-	-	-

正				
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	10,560,583.0 0	-	898,996.80	11,459,579.8 0
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填 列)	-	-	-1,243,402.2 1	-1,243,402.2 1
(一)、综合收益总 额	-	-	-939,976.88	-939,976.88
(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)	-	-	-303,425.33	-303,425.33
其中:1.基金申购款	2,500,000.00	-	-488,249.67	2,011,750.33
2.基金赎回 款	-2,500,000.0 0	-	184,824.34	-2,315,175.6 6
(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)	10,560,583.0 0	-	-344,405.41	10,216,177.5 9
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)	158,060,583. 00	-	-8,044,197.0 2	150,016,385. 98
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更	-	-	-	-

正				
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	158,060,583.00	-	-8,044,197.02	150,016,385.98
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-110,000,000.00	-	8,820,940.39	-101,179,059.61
(一)、综合收益总额	-	-	9,406,949.11	9,406,949.11
(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)	-110,000,000.00	-	-586,008.72	-110,586,008.72
其中: 1. 基金申购款	2,500,000.00	-	-244,483.86	2,255,516.14
2. 基金赎回款	-112,500,000.00	-	-341,524.86	-112,841,524.86
(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)	48,060,583.00	-	776,743.37	48,837,326.37

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(以下简称“中国银行”)。

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06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、存出保证金、应收利息，金额分别为人民币626,968.65元、人民币50,467.68元、人民币163.43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、存出保证金、其他资产-应收利息，金额分别为人民币627,106.90元、人民币50,492.65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10,977,754.93元，归属于交易性金融资产的应收利息金额为人民币0.21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10,977,755.14元。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期间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	380,155.28
等于：本金	380,115.97
加：应计利息	39.31
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	380,155.28

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	10,353,045.00	-	9,867,919.57	-485,125.43
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	10,353,045.00	-	9,867,919.57	-485,125.43

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	3,826.42
其中：交易所市场	3,826.42
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	24,795.19
应付指数使用费	1,592.93
合计	30,214.54

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	10,560,583.00	10,560,583.00
本期申购	2,500,000.00	2,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-2,500,000.00	-2,500,000.00
本期末	10,560,583.00	10,560,583.00

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
本期期初	1,091,778.82	-192,782.02	898,996.80
本期利润	-212,216.20	-727,760.68	-939,976.88
本期基金份额交易产生的变动数	34,717.43	-338,142.76	-303,425.33
其中：基金申购款	259,141.57	-747,391.24	-488,249.67
基金赎回款	-224,424.14	409,248.48	184,824.34
本期已分配利润	-	-	-

本期末	914,280.05	-1,258,685.46	-344,405.41
-----	------------	---------------	-------------

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	843.41
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	213.88
其他	69.03
合计	1,126.32

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	-261,507.36
股票投资收益——赎回差价收入	-44,881.83
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-306,389.19

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	2,609,091.48
减：卖出股票成本总额	2,863,675.86
减：交易费用	6,922.98
买卖股票差价收入	-261,507.36

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
	2022年01月01日至2022年06月30日
赎回基金份额对价总额	2,315,175.66
减：现金支付赎回款总额	1,178,018.66
减：赎回股票成本总额	1,182,038.83
减：交易费用	-
赎回差价收入	-44,881.83

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
债券投资收益——利息收入	0.07
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	293.02
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	293.09

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,293.30
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,000.00

减：应计利息总额	0.28
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	293.02

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益—买卖权证差价收入。

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	128,322.30
基金投资产生的股利收益	-
合计	128,322.30

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	-727,760.68
——股票投资	-727,464.58
——债券投资	-296.10
——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	-727,760.68

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
基金赎回费收入	-
ETF基金替代损益	22,889.14
合计	22,889.14

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	210.00
其他费用_指数使用费	1,592.93
合计	26,598.12

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、基金销售机构、基金注册登记机构
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	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 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
当期发生的基金应支付的管理费	26,549.78	331,246.86
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0.5%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×0.5%÷当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的托管费	5,309.96	66,249.37

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0.1%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×0.1%÷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

本基金本报告期内及上年度可比期间均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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	380,155.28	843.41	2,863,925.73	2,579.44

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业或协议利率计息。

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

本基金本报告期内未发生其他关联方交易事项。

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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002670	国盛	2022-0	-	9.60	2022-0	9.99	2,500	25,822.64	24,000.00	-

	金 控	6-0 1			7-1 4					
--	--------	----------	--	--	----------	--	--	--	--	--

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。

本基金报告期末债券投资按短期信用评级及长期信用评级列示的情况如下，其中不包括本基金所持有的国债、央行票据、政策性金融债。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	-	1,296.10
未评级	-	-
合计	-	1,296.10

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

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	380,155.28	-	-	-	380,155.28
结算备付金	59.39	-	-	-	59.39
存出保证金	4,339.53	-	-	-	4,339.53
交易性金融资产	-	-	-	9,867,919.57	9,867,919.57
资产总计	384,554.20	-	-	9,867,919.57	10,252,473.77
负债					
应付清算款	-	-	-	384.00	384.00
应付管理人报酬	-	-	-	4,748.06	4,748.06
应付托管费	-	-	-	949.58	949.58
其他负债	-	-	-	30,214.54	30,214.54
负债总计	-	-	-	36,296.18	36,296.18
利率敏感度缺口	384,554.20	-	-	9,831,623.39	10,216,177.59
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	626,968.65	-	-	-	626,968.65

款					
存出保证金	50,467.68	-	-	-	50,467.68
交易性金融资产	1,296.10	-	-	10,976,458.83	10,977,754.93
应收利息	-	-	-	163.43	163.43
资产总计	678,732.43	-	-	10,976,622.26	11,655,354.69
负债					
应付证券清算款	-	-	-	3,614.40	3,614.40
应付管理人报酬	-	-	-	5,957.16	5,957.16
应付托管费	-	-	-	1,191.43	1,191.43
应付交易费用	-	-	-	13,963.75	13,963.75
其他负债	-	-	-	171,048.15	171,048.15
负债总计	-	-	-	195,774.89	195,774.89
利率敏感度缺口	678,732.43	-	-	10,780,847.37	11,459,579.80

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

假设	1、除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
假设	2、利率曲线平行移动		
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
	市场利率上升25个基点	0.00	-19.10
	市场利率下降25个基点	0.00	19.43

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	9,867,919.57	96.59	10,976,458.83	95.78
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	9,867,919.57	96.59	10,976,458.83	95.78

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%	493,395.98	548,822.94
	股票价格下降5%	-493,395.98	-548,822.94

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	9,843,919.57	10,947,634.93
第二层次	24,000.00	30,120.00
第三层次	-	-
合计	9,867,919.57	10,977,754.93

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	9,867,919.57	96.25
	其中：股票	9,867,919.57	96.25
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	380,214.67	3.71

8	其他各项资产	4,339.53	0.04
9	合计	10,252,473.77	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	98,449.20	0.96
B	采矿业	490,659.80	4.80
C	制造业	5,830,258.63	57.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	321,433.00	3.15
E	建筑业	119,195.00	1.17
F	批发和零售业	399,274.64	3.91
G	交通运输、仓储和邮政业	271,505.20	2.66
H	住宿和餐饮业	19,840.00	0.19
I	信息传输、软件和信息技术服务业	616,819.90	6.04
J	金融业	878,310.30	8.60
K	房地产业	249,682.00	2.44
L	租赁和商务服务业	119,521.00	1.17
M	科学研究和技术服务业	136,889.00	1.34
N	水利、环境和公共设施管理业	73,393.00	0.72
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	24,880.00	0.24
R	文化、体育和娱乐业	135,393.00	1.33
S	综合	82,415.90	0.81
	合计	9,867,919.57	96.59

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	600522	中天科技	4,000	92,400.00	0.90
2	600563	法拉电子	400	82,064.00	0.80
3	300769	德方纳米	200	81,736.00	0.80
4	601615	明阳智能	2,400	81,120.00	0.79
5	600256	广汇能源	7,300	76,942.00	0.75
6	002756	永兴材料	400	60,884.00	0.60
7	000009	中国宝安	4,510	60,839.90	0.60
8	002180	纳思达	1,200	60,744.00	0.59
9	603026	石大胜华	400	58,140.00	0.57
10	300012	华测检测	2,400	55,704.00	0.55
11	600157	永泰能源	35,000	55,650.00	0.54
12	603267	鸿远电子	400	53,732.00	0.53
13	600486	扬农化工	400	53,312.00	0.52
14	600141	兴发集团	1,200	52,788.00	0.52
15	002497	雅化集团	1,600	52,240.00	0.51
16	000983	山西焦煤	3,900	52,221.00	0.51
17	002240	盛新锂能	800	48,288.00	0.47
18	600096	云天化	1,500	47,220.00	0.46
19	600885	宏发股份	1,120	46,872.00	0.46
20	603613	国联股份	525	46,515.00	0.46
21	002384	东山精密	2,000	45,860.00	0.45
22	603127	昭衍新药	400	45,520.00	0.45

23	601555	东吴证券	6,560	45,460.80	0.44
24	002385	大北农	5,800	45,298.00	0.44
25	600392	盛和资源	2,000	45,200.00	0.44
26	300285	国瓷材料	1,200	43,104.00	0.42
27	600399	抚顺特钢	2,400	42,960.00	0.42
28	300037	新宙邦	800	42,048.00	0.41
29	603456	九洲药业	800	41,360.00	0.40
30	603077	和邦生物	9,700	41,322.00	0.40
31	600499	科达制造	2,000	41,280.00	0.40
32	600418	江淮汽车	2,400	41,184.00	0.40
33	600233	圆通速递	2,000	40,780.00	0.40
34	600487	亨通光电	2,800	40,712.00	0.40
35	000630	铜陵有色	12,300	40,098.00	0.39
36	600732	爱旭股份	1,200	39,624.00	0.39
37	600298	安琪酵母	800	39,000.00	0.38
38	002683	广东宏大	1,400	38,962.00	0.38
39	603444	吉比特	100	38,800.00	0.38
40	600765	中航重机	1,200	38,616.00	0.38
41	600153	建发股份	2,900	37,903.00	0.37
42	601108	财通证券	4,800	37,776.00	0.37
43	300474	景嘉微	550	37,614.50	0.37
44	002797	第一创业	5,800	37,178.00	0.36
45	000988	华工科技	1,600	37,072.00	0.36
46	300144	宋城演艺	2,400	36,840.00	0.36
47	000783	长江证券	6,100	36,173.00	0.35
48	300073	当升科技	400	36,136.00	0.35
49	601077	渝农商行	9,700	35,890.00	0.35
50	300724	捷佳伟创	400	35,740.00	0.35
51	603589	口子窖	600	35,166.00	0.34
52	000519	中兵红箭	1,200	34,980.00	0.34
53	300390	天华超净	400	34,960.00	0.34

54	601058	赛轮轮胎	3,100	34,937.00	0.34
55	002185	华天科技	3,700	34,706.00	0.34
56	002625	光启技术	2,000	34,540.00	0.34
57	601128	常熟银行	4,500	34,380.00	0.34
58	002268	卫士通	800	34,328.00	0.34
59	002407	多氟多	700	34,237.00	0.34
60	600177	雅戈尔	5,100	33,813.00	0.33
61	600862	中航高科	1,200	33,720.00	0.33
62	000807	云铝股份	3,400	33,592.00	0.33
63	603345	安井食品	200	33,574.00	0.33
64	601168	西部矿业	2,800	33,124.00	0.32
65	000932	华菱钢铁	6,500	33,085.00	0.32
66	603605	珀莱雅	200	33,036.00	0.32
67	600348	华阳股份	2,100	32,466.00	0.32
68	002353	杰瑞股份	800	32,240.00	0.32
69	002056	横店东磁	1,200	31,944.00	0.31
70	600988	赤峰黄金	2,000	31,900.00	0.31
71	300363	博腾股份	400	31,196.00	0.31
72	600546	山煤国际	1,600	31,136.00	0.30
73	002603	以岭药业	1,280	31,104.00	0.30
74	000738	航发控制	1,100	30,910.00	0.30
75	601699	潞安环能	2,100	30,702.00	0.30
76	601636	旗滨集团	2,400	30,600.00	0.30
77	601872	招商轮船	5,300	30,528.00	0.30
78	300088	长信科技	4,100	30,422.00	0.30
79	002465	海格通信	3,300	29,997.00	0.29
80	002138	顺络电子	1,100	29,975.00	0.29
81	000970	中科三环	1,580	29,672.40	0.29
82	600497	驰宏锌锗	5,700	29,583.00	0.29
83	002078	太阳纸业	2,400	29,544.00	0.29
84	600521	华海药业	1,300	29,510.00	0.29

85	000975	银泰黄金	3,020	29,414.80	0.29
86	600705	中航产融	8,500	29,410.00	0.29
87	601607	上海医药	1,600	28,928.00	0.28
88	002508	老板电器	800	28,824.00	0.28
89	600109	国金证券	3,200	28,800.00	0.28
90	300676	华大基因	400	28,680.00	0.28
91	600637	东方明珠	4,000	28,600.00	0.28
92	002030	达安基因	1,660	28,535.40	0.28
93	002028	思源电气	800	28,528.00	0.28
94	600516	方大炭素	3,700	28,120.00	0.28
94	000629	攀钢钒钛	7,400	28,120.00	0.28
96	600549	厦门钨业	1,300	28,106.00	0.28
97	605117	德业股份	100	27,989.00	0.27
98	600704	物产中大	5,400	27,702.00	0.27
99	000039	中集集团	2,000	27,700.00	0.27
100	000830	鲁西化工	1,600	27,664.00	0.27
101	002507	涪陵榨菜	800	27,616.00	0.27
102	000999	华润三九	600	27,000.00	0.26
103	300136	信维通信	1,600	26,960.00	0.26
104	000960	锡业股份	1,600	26,832.00	0.26
105	300058	蓝色光标	4,100	26,773.00	0.26
106	601990	南京证券	3,200	26,688.00	0.26
107	600143	金发科技	2,800	26,656.00	0.26
107	000998	隆平高科	1,600	26,656.00	0.26
109	002326	永太科技	800	26,344.00	0.26
110	600875	东方电气	1,600	26,320.00	0.26
111	600160	巨化股份	2,000	26,300.00	0.26
112	002156	通富微电	1,700	26,180.00	0.26
113	002673	西部证券	4,000	26,160.00	0.26
114	603198	迎驾贡酒	400	26,056.00	0.26
115	600867	通化东宝	2,500	25,850.00	0.25

116	600079	人福医药	1,600	25,600.00	0.25
116	300418	昆仑万维	1,600	25,600.00	0.25
118	601997	贵阳银行	4,400	25,564.00	0.25
119	000728	国元证券	4,100	25,502.00	0.25
120	300253	卫宁健康	2,900	25,462.00	0.25
121	601696	中银证券	1,900	25,270.00	0.25
122	600699	均胜电子	1,600	25,136.00	0.25
122	600482	中国动力	1,600	25,136.00	0.25
124	000623	吉林敖东	1,700	25,092.00	0.25
125	600415	小商品城	4,500	25,065.00	0.25
126	000831	五矿稀土	800	25,000.00	0.24
127	300244	迪安诊断	800	24,880.00	0.24
128	300308	中际旭创	800	24,840.00	0.24
129	002572	索菲亚	900	24,750.00	0.24
130	600879	航天电子	3,800	24,662.00	0.24
131	600580	卧龙电驱	1,700	24,514.00	0.24
132	601717	郑煤机	1,700	24,497.00	0.24
133	300558	贝达药业	400	24,320.00	0.24
134	002203	海亮股份	2,100	24,255.00	0.24
135	600039	四川路桥	2,300	24,219.00	0.24
136	600316	洪都航空	800	24,192.00	0.24
137	002506	协鑫集成	6,500	24,180.00	0.24
138	300296	利亚德	3,300	24,090.00	0.24
139	002670	国盛金控	2,500	24,000.00	0.23
140	000750	国海证券	6,600	23,958.00	0.23
141	002439	启明星辰	1,200	23,916.00	0.23
142	000547	航天发展	2,000	23,880.00	0.23
143	300026	红日药业	3,100	23,870.00	0.23
144	300146	汤臣倍健	1,100	23,815.00	0.23
145	300699	光威复材	400	23,548.00	0.23
146	601016	节能风电	4,900	23,520.00	0.23

147	600739	辽宁成大	1,600	23,328.00	0.23
148	600985	淮北矿业	1,600	23,296.00	0.23
149	600642	申能股份	4,100	23,288.00	0.23
150	600372	中航电子	1,200	23,268.00	0.23
151	600027	华电国际	5,900	23,187.00	0.23
152	300618	寒锐钴业	400	23,168.00	0.23
153	603517	绝味食品	400	23,128.00	0.23
154	600369	西南证券	5,800	23,026.00	0.23
155	002299	圣农发展	1,200	23,016.00	0.23
156	002557	洽洽食品	400	22,772.00	0.22
157	002926	华西证券	2,900	22,736.00	0.22
158	600909	华安证券	4,990	22,704.50	0.22
159	688009	中国通号	5,000	22,650.00	0.22
160	002444	巨星科技	1,200	22,608.00	0.22
161	000636	风华高科	1,200	22,548.00	0.22
162	002294	信立泰	800	22,480.00	0.22
163	600529	山东药玻	800	22,360.00	0.22
164	600536	中国软件	550	22,324.50	0.22
165	002131	利欧股份	11,500	22,310.00	0.22
166	002195	二三四五	9,900	22,275.00	0.22
167	002409	雅克科技	400	22,204.00	0.22
168	601866	中远海发	7,400	22,200.00	0.22
169	600166	福田汽车	7,800	22,074.00	0.22
170	601005	重庆钢铁	11,500	21,965.00	0.22
171	600325	华发股份	2,900	21,953.00	0.21
172	600236	桂冠电力	3,600	21,924.00	0.21
173	000887	中鼎股份	1,200	21,888.00	0.21
174	002936	郑州银行	8,120	21,842.80	0.21
175	002739	万达电影	1,600	21,840.00	0.21
176	600848	上海临港	1,600	21,696.00	0.21
177	600673	东阳光	2,400	21,576.00	0.21

178	002624	完美世界	1,500	21,555.00	0.21
179	600801	华新水泥	1,100	21,461.00	0.21
180	600008	首创环保	7,390	21,431.00	0.21
181	601198	东兴证券	2,400	21,360.00	0.21
182	002212	天融信	2,100	21,315.00	0.21
183	002500	山西证券	3,700	21,238.00	0.21
184	600170	上海建工	7,000	21,210.00	0.21
185	603939	益丰药房	400	21,132.00	0.21
186	002092	中泰化学	2,700	20,952.00	0.21
187	002065	东华软件	3,300	20,856.00	0.20
188	300383	光环新网	2,000	20,840.00	0.20
189	300357	我武生物	400	20,812.00	0.20
190	600859	王府井	800	20,784.00	0.20
191	600026	中远海能	2,000	20,660.00	0.20
192	002422	科伦药业	1,100	20,570.00	0.20
193	600062	华润双鹤	800	20,528.00	0.20
193	002223	鱼跃医疗	800	20,528.00	0.20
195	600208	新湖中宝	7,400	20,424.00	0.20
196	300182	捷成股份	3,700	20,350.00	0.20
197	603218	日月股份	800	20,320.00	0.20
198	000729	燕京啤酒	2,100	20,286.00	0.20
199	603883	老百姓	598	20,260.24	0.20
200	600259	广晟有色	400	20,260.00	0.20
201	600998	九州通	1,700	20,247.00	0.20
202	000825	太钢不锈	3,700	20,165.00	0.20
203	300024	机器人	2,000	20,160.00	0.20
204	600171	上海贝岭	800	20,024.00	0.20
205	603568	伟明环保	600	20,022.00	0.20
206	000050	深天马 A	2,000	19,940.00	0.20
207	300251	光线传媒	2,100	19,887.00	0.19
208	002966	苏州银行	3,260	19,886.00	0.19

209	600258	首旅酒店	800	19,840.00	0.19
210	300017	网宿科技	3,700	19,832.00	0.19
211	300168	万达信息	2,100	19,824.00	0.19
212	000021	深科技	1,700	19,788.00	0.19
213	000778	新兴铸管	4,100	19,762.00	0.19
214	600380	健康元	1,600	19,760.00	0.19
215	002250	联化科技	1,200	19,644.00	0.19
216	600820	隧道股份	3,200	19,584.00	0.19
217	603658	安图生物	400	19,556.00	0.19
218	601992	金隅集团	7,000	19,390.00	0.19
219	600863	内蒙华电	5,300	19,345.00	0.19
220	300070	碧水源	3,700	19,277.00	0.19
221	002372	伟星新材	800	19,232.00	0.19
222	603707	健友股份	670	18,894.00	0.18
223	002430	杭氧股份	600	18,756.00	0.18
224	002152	广电运通	2,000	18,540.00	0.18
225	600667	太极实业	2,500	18,450.00	0.18
226	000878	云南铜业	1,600	18,224.00	0.18
227	603156	养元饮品	800	18,176.00	0.18
228	002273	水晶光电	1,500	18,165.00	0.18
229	002396	星网锐捷	800	18,112.00	0.18
230	000513	丽珠集团	500	18,105.00	0.18
231	600390	五矿资本	3,700	18,093.00	0.18
232	600038	中直股份	400	18,080.00	0.18
233	300832	新产业	400	18,044.00	0.18
234	002505	鹏都农牧	5,300	17,967.00	0.18
235	000027	深圳能源	2,800	17,948.00	0.18
236	002408	齐翔腾达	2,200	17,842.00	0.17
237	000060	中金岭南	4,000	17,840.00	0.17
238	600155	华创阳安	2,100	17,808.00	0.17
239	002373	千方科技	1,600	17,792.00	0.17

240	601179	中国西电	3,800	17,784.00	0.17
241	002831	裕同科技	600	17,730.00	0.17
242	600598	北大荒	1,200	17,712.00	0.17
243	002127	南极电商	3,300	17,622.00	0.17
244	600839	四川长虹	6,100	17,568.00	0.17
245	600271	航天信息	1,600	17,504.00	0.17
246	601162	天风证券	5,500	17,490.00	0.17
247	600498	烽火通信	1,200	17,376.00	0.17
248	600066	宇通客车	2,000	17,300.00	0.17
248	002244	滨江集团	2,000	17,300.00	0.17
250	002939	长城证券	1,700	17,272.00	0.17
251	002124	天邦食品	2,560	17,203.20	0.17
252	002249	大洋电机	2,800	17,192.00	0.17
253	002128	电投能源	1,200	17,184.00	0.17
254	000709	河钢股份	7,600	17,176.00	0.17
255	002191	劲嘉股份	1,600	17,152.00	0.17
256	600315	上海家化	400	17,100.00	0.17
257	603866	桃李面包	1,032	17,079.60	0.17
258	600282	南钢股份	5,400	17,010.00	0.17
259	600297	广汇汽车	6,500	16,965.00	0.17
260	000883	湖北能源	3,300	16,863.00	0.17
261	000401	冀东水泥	1,600	16,832.00	0.16
262	002019	亿帆医药	1,200	16,776.00	0.16
263	300482	万孚生物	410	16,691.10	0.16
264	600056	中国医药	1,120	16,598.40	0.16
265	002183	怡亚通	2,300	16,583.00	0.16
266	600022	山东钢铁	9,500	16,530.00	0.16
267	000739	普洛药业	800	16,512.00	0.16
268	300463	迈克生物	800	16,392.00	0.16
269	600409	三友化工	2,000	16,380.00	0.16
270	300009	安科生物	1,620	16,378.20	0.16

271	002004	华邦健康	2,900	16,182.00	0.16
272	600528	中铁工业	2,000	16,100.00	0.16
273	600511	国药股份	600	16,068.00	0.16
274	600118	中国卫星	800	16,064.00	0.16
275	002153	石基信息	1,000	15,870.00	0.16
276	600827	百联股份	1,200	15,852.00	0.16
276	000997	新大陆	1,200	15,852.00	0.16
278	002221	东华能源	1,700	15,827.00	0.15
279	603858	步长制药	800	15,768.00	0.15
280	002958	青农商行	4,700	15,604.00	0.15
281	002002	鸿达兴业	4,200	15,582.00	0.15
282	600808	马钢股份	4,100	15,539.00	0.15
283	600970	中材国际	1,600	15,504.00	0.15
284	601869	长飞光纤	500	15,460.00	0.15
285	000581	威孚高科	800	15,400.00	0.15
286	002266	浙富控股	3,200	15,328.00	0.15
287	000987	越秀金控	2,160	15,184.80	0.15
288	600597	光明乳业	1,200	15,156.00	0.15
289	601880	辽港股份	8,900	15,130.00	0.15
290	000540	中天金融	7,800	15,054.00	0.15
291	600517	国网英大	2,900	15,051.00	0.15
292	600037	歌华有线	1,600	15,024.00	0.15
292	002511	中顺洁柔	1,200	15,024.00	0.15
294	600216	浙江医药	1,100	15,015.00	0.15
295	600755	厦门国贸	2,000	15,000.00	0.15
295	600060	海信视像	1,200	15,000.00	0.15
297	600895	张江高科	1,200	14,940.00	0.15
298	000012	南玻A	2,000	14,840.00	0.15
299	601456	国联证券	1,200	14,724.00	0.14
300	600535	天士力	1,400	14,714.00	0.14
301	600567	山鹰国际	5,300	14,681.00	0.14

302	600507	方大特钢	2,100	14,679.00	0.14
303	600201	生物股份	1,600	14,656.00	0.14
304	600572	康恩贝	3,300	14,619.00	0.14
305	600782	新钢股份	2,900	14,616.00	0.14
306	002155	湖南黄金	1,200	14,568.00	0.14
307	002701	奥瑞金	2,800	14,560.00	0.14
308	002390	信邦制药	2,100	14,511.00	0.14
309	000930	中粮科技	1,600	14,464.00	0.14
310	000690	宝新能源	3,300	14,454.00	0.14
311	603233	大参林	460	14,398.00	0.14
312	603885	吉祥航空	800	14,392.00	0.14
313	001914	招商积余	800	14,376.00	0.14
314	600582	天地科技	3,000	14,340.00	0.14
315	000598	兴蓉环境	2,800	14,308.00	0.14
316	601577	长沙银行	1,800	14,274.00	0.14
317	601958	金钼股份	1,600	14,144.00	0.14
318	002281	光迅科技	800	14,064.00	0.14
319	300630	普利制药	400	14,060.00	0.14
320	603225	新凤鸣	1,212	13,986.48	0.14
321	000686	东北证券	2,000	13,980.00	0.14
322	601718	际华集团	4,500	13,950.00	0.14
323	300741	华宝股份	500	13,910.00	0.14
324	601118	海南橡胶	2,900	13,862.00	0.14
325	601106	中国一重	4,500	13,815.00	0.14
326	600718	东软集团	1,200	13,812.00	0.14
327	300376	易事特	1,700	13,804.00	0.14
328	002010	传化智联	2,100	13,503.00	0.13
329	000656	金科股份	4,700	13,442.00	0.13
330	000400	许继电气	700	13,440.00	0.13
331	002595	豪迈科技	600	13,404.00	0.13
332	600500	中化国际	2,000	13,300.00	0.13

332	300888	稳健医疗	200	13,300.00	0.13
334	000898	鞍钢股份	4,100	13,202.00	0.13
335	002867	周大生	850	13,200.50	0.13
336	600064	南京高科	1,200	13,200.00	0.13
337	002532	天山铝业	2,000	13,060.00	0.13
338	603650	彤程新材	400	13,032.00	0.13
339	601778	晶科科技	2,400	12,960.00	0.13
340	600728	佳都科技	2,000	12,920.00	0.13
341	002048	宁波华翔	800	12,816.00	0.13
342	600167	联美控股	1,700	12,733.00	0.12
343	601333	广深铁路	5,800	12,644.00	0.12
344	601000	唐山港	4,900	12,642.00	0.12
345	603712	七一二	400	12,600.00	0.12
346	603317	天味食品	440	12,526.80	0.12
347	000402	金融街	2,100	12,495.00	0.12
348	600663	陆家嘴	1,200	12,432.00	0.12
349	300115	长盈精密	1,200	12,372.00	0.12
350	000089	深圳机场	1,600	12,352.00	0.12
351	002110	三钢闽光	2,000	12,180.00	0.12
352	300001	特锐德	700	12,117.00	0.12
353	600737	中粮糖业	1,600	12,032.00	0.12
354	000937	冀中能源	1,600	11,936.00	0.12
355	002690	美亚光电	550	11,924.00	0.12
356	000028	国药一致	400	11,916.00	0.12
357	000869	张裕 A	400	11,896.00	0.12
358	600811	东方集团	4,200	11,886.00	0.12
359	000559	万向钱潮	2,000	11,880.00	0.12
360	000488	晨鸣纸业	2,100	11,844.00	0.12
361	002745	木林森	1,200	11,724.00	0.11
361	002174	游族网络	1,200	11,724.00	0.11
363	002985	北摩高科	200	11,716.00	0.11

364	600120	浙江东方	2,920	11,709.20	0.11
365	600707	彩虹股份	2,500	11,700.00	0.11
366	300677	英科医疗	460	11,665.60	0.11
367	002382	蓝帆医疗	1,207	11,526.85	0.11
368	002368	太极股份	600	11,526.00	0.11
369	002146	荣盛发展	3,800	11,514.00	0.11
370	600446	金证股份	1,100	11,418.00	0.11
371	601098	中南传媒	1,200	11,328.00	0.11
372	300869	康泰医学	400	11,304.00	0.11
373	600021	上海电力	1,100	11,275.00	0.11
374	601598	中国外运	2,900	11,252.00	0.11
375	600435	北方导航	1,300	11,206.00	0.11
376	601200	上海环境	1,100	11,176.00	0.11
377	002416	爱施德	1,200	11,160.00	0.11
378	300212	易华录	640	11,136.00	0.11
379	300166	东方国信	1,200	11,064.00	0.11
380	601608	中信重工	2,900	10,991.00	0.11
381	600373	中文传媒	1,100	10,989.00	0.11
382	600967	内蒙一机	1,200	10,944.00	0.11
383	600566	济川药业	400	10,864.00	0.11
384	600901	江苏租赁	2,100	10,773.00	0.11
385	600131	国网信通	800	10,760.00	0.11
386	002233	塔牌集团	1,200	10,620.00	0.10
387	002399	海普瑞	600	10,548.00	0.10
388	600307	酒钢宏兴	5,400	10,476.00	0.10
389	000528	柳工	1,600	10,416.00	0.10
390	000537	广宇发展	800	10,392.00	0.10
391	002429	兆驰股份	2,700	10,368.00	0.10
392	000563	陕国投 A	3,300	10,296.00	0.10
393	600126	杭钢股份	2,000	10,240.00	0.10
394	002081	金螳螂	2,000	10,160.00	0.10

395	300072	海新能科	2,000	10,120.00	0.10
396	600717	天津港	2,520	10,105.20	0.10
397	600764	中国海防	400	10,096.00	0.10
398	601611	中国核建	1,200	10,068.00	0.10
399	000961	中南建设	3,300	10,065.00	0.10
400	601991	大唐发电	4,100	9,963.00	0.10
401	002925	盈趣科技	460	9,899.20	0.10
402	600906	财达证券	1,100	9,889.00	0.10
403	600329	达仁堂	400	9,832.00	0.10
404	600376	首开股份	2,000	9,820.00	0.10
405	600195	中牧股份	800	9,808.00	0.10
406	603927	中科软	420	9,794.40	0.10
407	000553	安道麦A	800	9,688.00	0.09
408	000158	常山北明	1,600	9,600.00	0.09
409	600959	江苏有线	2,900	9,454.00	0.09
410	603638	艾迪精密	460	9,430.00	0.09
411	002434	万里扬	1,100	9,405.00	0.09
412	603228	景旺电子	400	9,332.00	0.09
413	000685	中山公用	1,200	9,216.00	0.09
414	001965	招商公路	1,200	9,156.00	0.09
415	600006	东风汽车	1,200	9,060.00	0.09
416	000959	首钢股份	1,900	9,044.00	0.09
417	600398	海澜之家	1,900	9,025.00	0.09
418	000671	阳光城	4,100	8,979.00	0.09
419	300257	开山股份	600	8,976.00	0.09
420	603000	人民网	800	8,960.00	0.09
421	603379	三美股份	400	8,900.00	0.09
422	000415	渤海租赁	4,100	8,897.00	0.09
423	000718	苏宁环球	2,400	8,832.00	0.09
424	002705	新宝股份	400	8,796.00	0.09
425	000990	诚志股份	800	8,760.00	0.09

426	601928	凤凰传媒	1,200	8,580.00	0.08
427	600968	海油发展	3,300	8,514.00	0.08
428	600339	中油工程	2,900	8,381.00	0.08
429	002468	申通快递	700	8,344.00	0.08
430	601860	紫金银行	2,900	8,323.00	0.08
431	600648	外高桥	600	8,160.00	0.08
432	600927	永安期货	400	8,068.00	0.08
433	002423	中粮资本	1,200	8,052.00	0.08
434	000031	大悦城	2,000	8,000.00	0.08
435	601156	东航物流	400	7,920.00	0.08
436	000967	盈峰环境	1,500	7,590.00	0.07
437	603868	飞科电器	100	7,575.00	0.07
438	002387	维信诺	1,100	7,392.00	0.07
439	000717	韶钢松山	2,100	7,350.00	0.07
440	002242	九阳股份	400	7,344.00	0.07
441	601228	广州港	2,000	7,340.00	0.07
441	600928	西安银行	2,000	7,340.00	0.07
443	002563	森马服饰	1,200	7,104.00	0.07
444	003035	南网能源	1,100	6,985.00	0.07
445	603515	欧普照明	400	6,980.00	0.07
446	601969	海南矿业	800	6,872.00	0.07
447	600377	宁沪高速	800	6,856.00	0.07
448	600787	中储股份	1,200	6,828.00	0.07
449	601298	青岛港	1,200	6,564.00	0.06
450	002653	海思科	400	6,444.00	0.06
451	001872	招商港口	400	6,240.00	0.06
452	000785	居然之家	1,400	6,230.00	0.06
453	603786	科博达	100	6,157.00	0.06
454	002945	华林证券	400	6,100.00	0.06
455	600623	华谊集团	700	5,810.00	0.06
456	600556	天下秀	700	5,761.00	0.06

457	600299	安迪苏	600	5,748.00	0.06
458	600871	石化油服	3,000	5,670.00	0.06
459	000156	华数传媒	700	5,579.00	0.05
460	601139	深圳燃气	800	5,552.00	0.05
461	600835	上海机电	400	5,492.00	0.05
462	600095	湘财股份	700	5,383.00	0.05
463	603056	德邦股份	400	5,372.00	0.05
464	002948	青岛银行	1,460	5,285.20	0.05
465	002946	新乳业	400	5,196.00	0.05
466	002815	崇达技术	400	5,124.00	0.05
467	000062	深圳华强	400	5,080.00	0.05
468	601568	北元集团	800	5,072.00	0.05
469	603355	莱克电气	200	5,046.00	0.05
470	600956	新天绿能	400	4,928.00	0.05
471	601828	美凯龙	800	4,848.00	0.05
472	601187	厦门银行	800	4,768.00	0.05
472	600823	世茂股份	1,600	4,768.00	0.05
474	001203	大中矿业	400	4,520.00	0.04
475	600350	山东高速	800	4,200.00	0.04
476	001227	兰州银行	800	3,936.00	0.04
477	002901	大博医疗	100	3,914.00	0.04
478	601665	齐鲁银行	800	3,904.00	0.04
479	601003	柳钢股份	800	3,240.00	0.03
480	600917	重庆燃气	400	2,888.00	0.03
481	603719	良品铺子	100	2,863.00	0.03
482	603983	丸美股份	100	2,680.00	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

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	300769	德方纳米	78,040.00	0.68
2	300012	华测检测	67,533.00	0.59
3	002756	永兴材料	67,336.00	0.59
4	002497	雅化集团	64,432.00	0.56
5	603026	石大胜华	60,339.00	0.53
6	600096	云天化	60,316.00	0.53
7	002180	纳思达	57,738.00	0.50
8	002240	盛新锂能	57,652.00	0.50
9	603605	珀莱雅	47,651.00	0.42
10	601108	财通证券	44,970.00	0.39
11	300390	天华超净	44,787.00	0.39
12	601058	赛轮轮胎	44,737.00	0.39
13	603345	安井食品	43,716.00	0.38
14	000783	长江证券	43,558.00	0.38
15	600499	科达制造	41,781.00	0.36
16	002407	多氟多	40,182.00	0.35
17	002625	光启技术	40,021.00	0.35
18	300073	当升科技	39,779.00	0.35
19	300144	宋城演艺	37,818.00	0.33
20	601607	上海医药	36,017.00	0.31

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	300751	迈为股份	126,332.40	1.10
2	002340	格林美	81,468.00	0.71

3	600188	兖矿能源	62,192.00	0.54
4	000733	振华科技	62,102.00	0.54
5	601117	中国化学	59,680.00	0.52
6	000723	美锦能源	59,101.00	0.52
7	600884	杉杉股份	58,457.00	0.51
8	601689	拓普集团	57,075.00	0.50
9	600460	士兰微	52,896.00	0.46
10	600754	锦江酒店	51,612.00	0.45
11	002013	中航机电	49,360.00	0.43
12	300763	锦浪科技	48,000.00	0.42
13	300223	北京君正	46,585.00	0.41
14	603893	瑞芯微	40,875.00	0.36
15	002080	中材科技	34,852.00	0.30
16	600733	北汽蓝谷	32,525.00	0.28
17	601975	招商南油	28,011.00	0.24
18	600803	新奥股份	27,728.75	0.24
19	002683	广东宏大	21,361.00	0.19
20	300315	掌趣科技	18,977.00	0.17

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,705,085.01
卖出股票收入（成交）总额	2,609,091.48

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包含国债期货

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金投资范围不包含国债期货

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券发行主体中，中天科技收到来自上海证券交易所的监管警示。本基金为指数型基金，上述股票系标的指数成分股，投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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	4,339.53

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	4,339.53

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
524	20,153.78	0.00	0.00%	10,560,583.00	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	许安澜	1,100,000.00	10.42%
2	许梅蓉	1,060,000.00	10.04%

3	高芸	500,000.00	4.73%
4	杨儒超	293,000.00	2.77%
5	陈伟君	200,000.00	1.89%
6	安景文	200,000.00	1.89%
7	李仁豪	200,000.00	1.89%
8	王雪芳	149,000.00	1.41%
9	蓝善斌	148,900.00	1.41%
10	赵婕	148,810.00	1.41%

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、基金投资和研发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	10,560,583.00
本报告期基金总申购份额	2,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	2,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	10,560,583.00

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	
安信证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	3,604,648.16	67.86%	2,636.02	67.85%	-

光大证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	1,707,566.33	32.14%	1,248.84	32.15%	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	4	-	-	-	-	-

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 资质雄厚，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在上述租用的券商交易单元中，本期无新增交易单元，剔除交易单元：中泰证券股份
有限公司。

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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	1,293.30	100.00%	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-

无。

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	中国证监会规定的媒介	2022-05-28

	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		
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	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
二〇二二年八月三十一日