

兴业沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

2024 年中期报告

2024 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:2024 年 08 月 30 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2024年8月27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2024年1月1日起至2024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	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、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 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	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	52
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	52
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	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 投资组合报告附注	52
§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	54
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	54
§9 开放式基金份额变动	54
§10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
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	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
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	57
§11 影响投资者决策的其他重要信息	58
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	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	58
§12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	58

§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	300指数ETF（证券简称：兴业300；扩位证券简称：300指数ETF）
场内简称	300指数ETF（证券简称：兴业300；扩位证券简称：300指数ETF）
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	96,258,111.00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。主要投资策略包括：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略。
业绩比较基准	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	滕菲菲
	联系电话	021-22211888	4006800000
	电子邮箱	zhaoyue@cib-fund.com.cn	tengfeifei@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		叶文煌	方合英

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 (2024年01月01日- 2024年06月30日)
本期已实现收益	-413,545.18
本期利润	529,364.65
加权平均基金份额本期利润	0.0065
本期加权平均净值利润率	0.84%
本期基金份额净值增长率	1.33%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)
期末可供分配利润	-22,950,066.79
期末可供分配基金份额利润	-0.2384
期末基金资产净值	73,308,044.21
期末基金份额净值	0.7616
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)
基金份额累计净值增长率	-23.84%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

		准差②	率③	率标准差 ④		
过去一个月	-2.58%	0.46%	-3.30%	0.48%	0.72%	-0.02%
过去三个月	-1.16%	0.71%	-2.14%	0.76%	0.98%	-0.05%
过去六个月	1.33%	0.83%	0.89%	0.90%	0.44%	-0.07%
过去一年	-7.65%	0.82%	-9.91%	0.87%	2.26%	-0.05%
过去三年	-30.80%	1.01%	-33.74%	1.05%	2.94%	-0.04%
自基金合同 生效起至今	-23.84%	1.03%	-24.45%	1.08%	0.61%	-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，兴业基金坚守“受人之托、代客理财”的初心本源，坚守“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化，以“市场化、专业化、数字化”为转型方向，不断提升主动管理能力，打磨产品线，强化核心竞争力，提升权益投资能力，巩固扩大固收优势并增强特色业务，致力于为广大投资者创造长期良好收益，为中国实体经济健康发展贡献自身应有力量。截至2024年6月30日，兴业基金共管理96只公募基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张诗悦	基金经理	2024-06-21	-	8年	中国籍，硕士学位，具有证券投资基金从业资格。2015年7月加入兴业基金管理有限公司，现任基金经理。
那赛男	基金经理	2020-09-11	-	14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。
--	--	--	--	--	--

- 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。
- 3、自2024年7月19日起那赛男不再担任本基金基金经理，详情请见本基金管理人于2024
年7月20日发布的《兴业沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告》。

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

2024年上半年，A股市场表现相对较弱，中证全指跌幅8.64%，市场呈现出大中小盘
的显著分化，沪深300指数在宽基指数中表现相对较好，沪深300、中证500、中证1000
涨跌幅分别为0.89%、-8.96%、-16.84%，上证指数、深证成指、创业板指跌幅分别为0.25%、
7.1%、10.99%。

按照中证的11个一级行业分类，中证500成分股的前五大行业金融、信息、工业、消费、材料占比超过70%，300金融、300信息、300工业、300消费和300材料指数上半年涨跌幅分别为6.94%、0.25%、-4.55%、-10.99%、9.29%，整体来看，上游能源、材料表现较强，下游消费、医药、地产表现较弱，金融、通信、公用事业等关系国计民生的行业、具备红利属性强的个股表现较好。

沪深 300 指数由沪深市场中规模大、流动性好的最具代表性的300 只证券组成，可以反映沪深市场头部上市公司证券的整体表现，金融、制造与科技、消费医药等行业贡献最为显著，和经济的相关性较强，在政策的稳步指引下，经济和信心的修复不是一蹴而就的，耐心是最好的解决方案，当前沪深300的PB估值处在10年来的后10%分位，估值吸引力突出。在新国九条的推动下，头部企业在分红上更加积极，沪深300指数也有望表现出更多的分红吸引力，截至2024年上半年，沪深300近12个月股息率达到3.17%，股息率水平处在10年来的前10%分位。

本基金为指数型基金，基金管理人将继续按照基金合同的要求，坚持指数化投资策略，拟合指数收益表现，在确保基金产品平稳运行的前提下，努力将基金的跟踪误差控制在较低水平，以达成投资人的投资目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末300指数ETF（证券简称：兴业300；扩位证券简称：300指数ETF）基金份额净值为0.7616元，本报告期内，基金份额净值增长率为1.33%，同期业绩比较基准收益率为0.89%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024年上半年，中国经济仍然面临较大挑战，有效需求不足是较大的问题，在房地产资产调整的压力下，叠加经济和收入预期的不确定，消费者信心指数维持低位。7月以来，三中全会召开，明确高质量发展是全面建设社会主义现代化国家的首要任务，7月政治局会议指出，这些都是发展中、转型中的问题，会议强调，下半年改革发展稳定任务很重，要加强逆周期调节，以提振消费为重点扩大国内需求。我们认为，在政策端的稳步发力下，伴随资产端的压力逐步释放，宏观经济有望稳步发展。经济的修复难以一蹴而就，信心的修复也需要时间，在这一背景下，市场有望逐步走出底部区间，股票市场和基金行业在普惠和养老这两个方面，也有望发挥更重要的作用。

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或者基金资产净值低于五千万的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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2024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遵规守信、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2024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，未发现有关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：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	5,171,345.63	3,271,912.92
结算备付金		26,746.52	11,376.23
存出保证金		4,387.82	6,697.29
交易性金融资产	6.4.7.2	69,229,661.71	48,900,298.69
其中：股票投资		69,229,661.71	48,890,532.39
基金投资		-	-

债券投资		-	9,766.30
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		74,432,141.68	52,190,285.13
负债和净资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023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		972,947.24	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		30,779.61	21,138.97
应付托管费		6,155.91	4,227.80
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	114,214.71	109,236.26
负债合计		1,124,097.47	134,603.03

净资产：			
实收基金	6.4.7.7	96,258,111.00	69,258,111.00
未分配利润	6.4.7.8	-22,950,066.79	-17,202,428.90
净资产合计		73,308,044.21	52,055,682.10
负债和净资产总计		74,432,141.68	52,190,285.13

注：报告截止日2024年06月30日，基金份额净值0.7616元，基金份额总额96,258,111.00份。

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：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至202 3年06月30日
一、营业总收入		852,060.39	-191,955.41
1.利息收入		3,915.58	2,365.91
其中：存款利息收入	6.4.7.9	3,915.58	2,365.91
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）		-92,730.79	479,465.19
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-889,747.22	-109,488.92
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	380.77	-
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	796,635.66	588,954.11
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	942,909.83	-676,835.37
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	-2,034.23	3,048.86
减：二、营业总支出		322,695.74	185,507.38
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	155,373.63	107,640.94
2.托管费	6.4.10.2.2	31,074.70	21,528.15
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	136,247.41	56,338.29
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		529,364.65	-377,462.79
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		529,364.65	-377,462.79
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		529,364.65	-377,462.79

6.3 净资产变动表

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：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	69,258,111.00	-17,202,428.90	52,055,682.10
二、本期期初净资产	69,258,111.00	-17,202,428.90	52,055,682.10
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	27,000,000.00	-5,747,637.89	21,252,362.11
（一）、综合收益总额	-	529,364.65	529,364.65
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	27,000,000.00	-6,277,002.54	20,722,997.46
其中：1.基金申购款	30,000,000.00	-6,951,614.39	23,048,385.61
2.基金赎回款	-3,000,000.00	674,611.85	-2,325,388.15
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	96,258,111.00	-22,950,066.79	73,308,044.21
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	48,258,111.00	-8,373,640.66	39,884,470.34

二、本期期初净资产	48,258,111.00	-8,373,640.66	39,884,470.34
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	15,000,000.00	-2,714,398.34	12,285,601.66
（一）、综合收益总额	-	-377,462.79	-377,462.79
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	15,000,000.00	-2,336,935.55	12,663,064.45
其中：1.基金申购款	30,000,000.00	-4,143,472.63	25,856,527.37
2.基金赎回款	-15,000,000.00	1,806,537.08	-13,193,462.92
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	63,258,111.00	-11,088,039.00	52,170,072.00

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

叶文煌

张顺国

楼怡斐

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

兴业沪深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

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。

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

本基金的财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金2024年06月30日的财务状况以及2024年01月01日至2024年06月30日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

(4)对于基金从事A股买卖，出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税。自2023年8月28日起，出让方减按0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末
	2024年06月30日
活期存款	5,171,345.63
等于：本金	5,171,059.58
加：应计利息	286.05
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	5,171,345.63

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2024年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	75,005,555.99	-	69,229,661.71	-5,775,894.28
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		75,005,555.99	-	69,229,661.71	-5,775,894.28

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024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	9,358.01
其中：交易所市场	9,358.01
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	64,644.58

应付指数使用费	40,212.12
合计	114,214.71

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	69,258,111.00	69,258,111.00
本期申购	30,000,000.00	30,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-3,000,000.00	-3,000,000.00
本期末	96,258,111.00	96,258,111.00

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	12,116,876.09	-29,319,304.99	-17,202,428.90
本期期初	12,116,876.09	-29,319,304.99	-17,202,428.90
本期利润	-413,545.18	942,909.83	529,364.65
本期基金份额交易产生的变动数	4,671,402.36	-10,948,404.90	-6,277,002.54
其中：基金申购款	5,196,587.47	-12,148,201.86	-6,951,614.39
基金赎回款	-525,185.11	1,199,796.96	674,611.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	16,374,733.27	-39,324,800.06	-22,950,066.79

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
	活期存款利息收入
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	81.35
其他	36.78
合计	3,915.58

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 2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-858,846.17
股票投资收益——赎回差价收入	-30,901.05
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-889,747.22

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 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出股票成交总额	3,433,097.96
减：卖出股票成本总额	4,278,302.82
减：交易费用	13,641.31
买卖股票差价收入	-858,846.17

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 2024年01月01日至2024年06月30日
赎回基金份额对价总额	2,325,388.15
减：现金支付赎回款总额	892,356.15
减：赎回股票成本总额	1,463,933.05

减：交易费用	-
赎回差价收入	-30,901.05

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
	2024年01月01日至2024年06月30日
债券投资收益——利息收入	2.25
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	378.52
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	380.77

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
	2024年01月01日至2024年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	9,888.11
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	9,500.00
减：应计利息总额	9.20
减：交易费用	0.39
买卖债券差价收入	378.52

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	796,635.66
基金投资产生的股利收益	-
合计	796,635.66

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	942,909.83
——股票投资	943,169.18
——债券投资	-259.35
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——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	942,909.83

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024年01月01日至2024年06月30日
基金赎回费收入	-
ETF基金替代损益	-2,034.23
合计	-2,034.23

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期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
	2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	39,781.56
汇划手续费	172.50
其他费用_指数使用费	71,430.33
合计	136,247.41

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(以下简称"中海集团")	基金管理人的股东
兴业财富资产管理有限公司(以下简称"兴业财富")	基金管理人控制的公司
兴业沪深300交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	本基金的联接基金

注：下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均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

本基金本报告期及上年度可比期间均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

本基金本报告期及上年度可比期间均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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期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 2024年01月01日至20 24年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至20 23年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	155,373.63	107,640.94

其中：应支付销售机构的客户维护费	-	-
应支付基金管理人的净管理费	155,373.63	107,640.94

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 2024年01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	31,074.70	21,528.15

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

本基金本报告期及上年度可比期间均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年06月30日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
兴业沪深300交易	52,500,700.00	54.54%	34,875,700.00	50.36%

型开放式 指数证券 投资基金 发起式联 接基金				
-------------------------------------	--	--	--	--

注：关联方投资本基金采用公允费率，即按照基金法律文件条款执行。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023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	5,171,345.63	3,797.45	2,936,332.43	2,060.92

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期末，本基金持有基金管理人的股东发行的股票兴业银行(601166.SH)60,800股，占本基金资产净值的1.46%(上年度末：43,700股，占本基金资产净值的1.36%)；本报告期末，本基金持有托管人发行的股票中信银行(601998.SH)12,800股，占本基金资产净值的0.12%(上年度末：8,900股，占本基金资产净值的0.09%)；。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024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。

6.4.13.2.1 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

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债券

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

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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	-	9,766.30
未评级	-	-
合计	-	9,766.30

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债券

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

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 2024年0 6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资 金	5,171,345.63	-	-	-	5,171,345.63
结算备 付金	26,746.52	-	-	-	26,746.52
存出保 证金	4,387.82	-	-	-	4,387.82
交易性 金融资 产	-	-	-	69,229,661.71	69,229,661.71
资产总 计	5,202,479.97	-	-	69,229,661.71	74,432,141.68
负债					
应付清 算款	-	-	-	972,947.24	972,947.24
应付管 理人报 酬	-	-	-	30,779.61	30,779.61
应付托 管费	-	-	-	6,155.91	6,155.91
其他负 债	-	-	-	114,214.71	114,214.71
负债总 计	-	-	-	1,124,097.47	1,124,097.47
利率敏 感度缺 口	5,202,479.97	-	-	68,105,564.24	73,308,044.21
上年度 末 2023年1	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2月31日					
资产					
货币资金	3,271,912.92	-	-	-	3,271,912.92
结算备付金	11,376.23	-	-	-	11,376.23
存出保证金	6,697.29	-	-	-	6,697.29
交易性金融资产	9,766.30	-	-	48,890,532.39	48,900,298.69
资产总计	3,299,752.74	-	-	48,890,532.39	52,190,285.13
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	21,138.97	21,138.97
应付托管费	-	-	-	4,227.80	4,227.80
其他负债	-	-	-	109,236.26	109,236.26
负债总计	-	-	-	134,603.03	134,603.03
利率敏感度缺口	3,299,752.74	-	-	48,755,929.36	52,055,682.10

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	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
假设	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	上年度末

		2024年06月30日	2023年12月31日
	市场利率上升25个基点	0.00	-130.34
	市场利率下降25个基点	0.00	132.44

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 2024年06月30日		上年度末 2023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	69,229,661.71	94.44	48,890,532.39	93.92
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资	-	-	-	-

产一债券投资				
交易性金融资产一贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产一权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	69,229,661.71	94.44	48,890,532.39	93.92

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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	股票价格上升5%	3,461,483.09	2,444,526.62
	股票价格下降5%	-3,461,483.09	-2,444,526.62

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	69,229,661.71	48,900,298.69
第二层次	-	-
第三层次	-	-

合计	69,229,661.71	48,900,298.69
----	---------------	---------------

6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括货币资金、应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相等。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	69,229,661.71	93.01
	其中：股票	69,229,661.71	93.01
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	5,198,092.15	6.98
8	其他各项资产	4,387.82	0.01
9	合计	74,432,141.68	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	988,254.00	1.35
B	采矿业	4,273,126.00	5.83
C	制造业	35,830,597.12	48.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,291,367.00	4.49
E	建筑业	1,608,290.60	2.19
F	批发和零售业	146,322.00	0.20
G	交通运输、仓储和邮政业	2,720,603.20	3.71
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,673,058.68	3.65
J	金融业	15,734,901.75	21.46
K	房地产业	652,734.00	0.89
L	租赁和商务服务业	541,104.00	0.74
M	科学研究和技术服务业	570,664.00	0.78
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	198,639.36	0.27
R	文化、体育和娱乐业	-	-

S	综合	-	-
	合计	69,229,661.71	94.44

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	3,000	4,402,170.00	6.01
2	300750	宁德时代	10,120	1,821,903.60	2.49
3	601318	中国平安	43,400	1,795,024.00	2.45
4	600036	招商银行	50,900	1,740,271.00	2.37
5	600900	长江电力	48,000	1,388,160.00	1.89
6	000333	美的集团	19,200	1,238,400.00	1.69
7	601899	紫金矿业	63,000	1,106,910.00	1.51
8	601166	兴业银行	60,800	1,071,296.00	1.46
9	000858	五粮液	7,400	947,496.00	1.29
10	300760	迈瑞医疗	3,100	901,821.00	1.23
11	002594	比亚迪	3,400	850,850.00	1.16
12	601328	交通银行	112,000	836,640.00	1.14
13	601398	工商银行	144,000	820,800.00	1.12
14	002475	立讯精密	19,200	754,752.00	1.03
15	000651	格力电器	19,200	753,024.00	1.03
16	600276	恒瑞医药	19,200	738,432.00	1.01
17	600030	中信证券	38,405	700,123.15	0.96
18	600887	伊利股份	25,600	661,504.00	0.90
19	600809	山西汾酒	3,020	636,857.60	0.87
20	000725	京东方 A	150,400	615,136.00	0.84

21	601088	中国神华	12,800	567,936.00	0.77
22	601288	农业银行	129,400	564,184.00	0.77
23	002714	牧原股份	12,620	550,232.00	0.75
24	300059	东方财富	51,235	541,041.60	0.74
25	601816	京沪高铁	96,500	518,205.00	0.71
26	600309	万华化学	6,400	517,504.00	0.71
27	002415	海康威视	16,000	494,560.00	0.67
28	601857	中国石油	45,000	464,400.00	0.63
29	000568	泸州老窖	3,200	459,168.00	0.63
30	601668	中国建筑	86,400	458,784.00	0.63
31	600690	海尔智家	16,000	454,080.00	0.62
32	300308	中际旭创	3,200	441,216.00	0.60
33	300498	温氏股份	22,100	438,022.00	0.60
34	601138	工业富联	15,700	430,180.00	0.59
35	601225	陕西煤业	16,000	412,320.00	0.56
36	600031	三一重工	24,800	409,200.00	0.56
37	601988	中国银行	86,400	399,168.00	0.54
38	601919	中远海控	25,680	397,783.20	0.54
39	601985	中国核电	37,200	396,552.00	0.54
40	600000	浦发银行	48,000	395,040.00	0.54
41	600406	国电南瑞	15,715	392,246.40	0.54
42	000001	平安银行	38,400	389,760.00	0.53
43	601766	中国中车	51,200	384,512.00	0.52
44	600028	中国石化	60,800	384,256.00	0.52
45	002371	北方华创	1,200	383,868.00	0.52
46	601728	中国电信	60,500	372,075.00	0.51
47	300274	阳光电源	5,920	367,217.60	0.50
48	000792	盐湖股份	21,000	366,450.00	0.50
49	600150	中国船舶	9,000	366,390.00	0.50
50	600050	中国联通	76,800	360,960.00	0.49
51	603259	药明康德	9,200	360,548.00	0.49

52	000338	潍柴动力	22,200	360,528.00	0.49
53	601012	隆基绿能	25,660	359,753.20	0.49
54	000063	中兴通讯	12,800	358,016.00	0.49
55	601169	北京银行	60,800	355,072.00	0.48
56	601601	中国太保	12,400	345,464.00	0.47
57	002352	顺丰控股	9,500	339,055.00	0.46
58	300124	汇川技术	6,450	330,885.00	0.45
59	600837	海通证券	38,400	328,704.00	0.45
60	600016	民生银行	86,400	327,456.00	0.45
61	600941	中国移动	3,000	322,500.00	0.44
62	000100	TCL科技	71,910	310,651.20	0.42
63	603501	韦尔股份	3,105	308,543.85	0.42
64	600660	福耀玻璃	6,400	306,560.00	0.42
65	601229	上海银行	41,600	302,016.00	0.41
66	603986	兆易创新	3,120	298,334.40	0.41
67	002142	宁波银行	12,810	282,588.60	0.39
68	002230	科大讯飞	6,400	274,880.00	0.37
69	600089	特变电工	19,200	266,304.00	0.36
70	600104	上汽集团	19,200	266,112.00	0.36
71	601390	中国中铁	40,300	262,756.00	0.36
72	601211	国泰君安	19,200	260,160.00	0.35
73	000625	长安汽车	19,282	258,957.26	0.35
74	603019	中科曙光	6,200	257,300.00	0.35
75	002027	分众传媒	41,600	252,096.00	0.34
76	002304	洋河股份	3,100	250,294.00	0.34
77	300014	亿纬锂能	6,200	247,504.00	0.34
78	600905	三峡能源	56,300	245,468.00	0.33
79	603993	洛阳铝业	28,800	244,800.00	0.33
80	601600	中国铝业	32,000	244,160.00	0.33
81	600938	中国海油	7,200	237,600.00	0.32
82	601989	中国重工	48,000	236,640.00	0.32

83	600048	保利发展	27,000	236,520.00	0.32
84	601006	大秦铁路	33,000	236,280.00	0.32
85	601818	光大银行	74,500	236,165.00	0.32
86	601688	华泰证券	19,000	235,410.00	0.32
87	600019	宝钢股份	35,200	234,080.00	0.32
88	601009	南京银行	22,400	232,736.00	0.32
89	600893	航发动力	6,300	230,265.00	0.31
90	300782	卓胜微	2,960	230,110.40	0.31
91	600886	国投电力	12,500	228,000.00	0.31
92	601658	邮储银行	44,800	227,136.00	0.31
93	002179	中航光电	5,966	227,006.30	0.31
94	600585	海螺水泥	9,600	226,464.00	0.31
95	600919	江苏银行	30,040	223,197.20	0.30
96	600999	招商证券	16,000	222,560.00	0.30
97	603288	海天味业	6,451	222,365.97	0.30
98	601939	建设银行	28,800	213,120.00	0.29
99	600795	国电电力	35,200	210,848.00	0.29
100	000938	紫光股份	9,000	201,150.00	0.27
101	601888	中国中免	3,200	199,968.00	0.27
102	600584	长电科技	6,300	199,773.00	0.27
103	000002	万科 A	28,800	199,584.00	0.27
104	601628	中国人寿	6,400	198,720.00	0.27
105	300015	爱尔眼科	19,248	198,639.36	0.27
106	600926	杭州银行	15,000	195,750.00	0.27
107	600009	上海机场	6,000	193,500.00	0.26
108	000425	徐工机械	27,000	193,050.00	0.26
109	603392	万泰生物	2,903	191,249.64	0.26
110	002241	歌尔股份	9,600	187,296.00	0.26
111	600438	通威股份	9,656	184,526.16	0.25
112	601669	中国电建	33,000	184,470.00	0.25
113	300408	三环集团	6,200	180,978.00	0.25

114	600011	华能国际	18,600	178,932.00	0.24
115	600489	中金黄金	12,000	177,600.00	0.24
116	600547	山东黄金	6,400	175,232.00	0.24
117	300433	蓝思科技	9,500	173,375.00	0.24
118	002050	三花智控	9,000	171,720.00	0.23
119	600958	东方证券	22,444	170,574.40	0.23
120	600426	华鲁恒升	6,400	170,496.00	0.23
121	601021	春秋航空	3,000	168,990.00	0.23
122	600674	川投能源	9,000	168,750.00	0.23
123	300122	智飞生物	6,000	168,180.00	0.23
124	600989	宝丰能源	9,600	166,368.00	0.23
125	000166	申万宏源	38,400	165,504.00	0.23
126	000538	云南白药	3,220	164,703.00	0.22
127	601186	中国铁建	19,200	164,544.00	0.22
128	002252	上海莱士	21,000	164,220.00	0.22
129	600015	华夏银行	25,600	163,840.00	0.22
130	002049	紫光国微	3,080	162,008.00	0.22
131	601689	拓普集团	3,000	160,830.00	0.22
132	600111	北方稀土	9,300	159,960.00	0.22
133	601633	长城汽车	6,300	159,390.00	0.22
134	000776	广发证券	12,800	155,776.00	0.21
135	000768	中航西飞	6,400	153,792.00	0.21
136	300347	泰格医药	3,100	150,660.00	0.21
137	002311	海大集团	3,200	150,560.00	0.21
138	003816	中国广核	32,000	148,160.00	0.20
139	000157	中联重科	19,200	147,456.00	0.20
140	600161	天坛生物	6,000	146,400.00	0.20
141	601377	兴业证券	28,870	146,082.20	0.20
142	600600	青岛啤酒	2,000	145,540.00	0.20
143	601100	恒立液压	3,100	144,398.00	0.20
144	603369	今世缘	3,100	143,220.00	0.20

145	603799	华友钴业	6,450	142,738.50	0.19
146	600196	复星医药	6,300	139,482.00	0.19
147	601901	方正证券	18,000	139,140.00	0.19
147	002236	大华股份	9,000	139,140.00	0.19
149	601788	光大证券	9,500	138,890.00	0.19
150	601916	浙商银行	50,200	138,552.00	0.19
151	601800	中国交建	15,400	137,676.00	0.19
152	000999	华润三九	3,230	137,533.40	0.19
153	300496	中科创达	3,000	136,770.00	0.19
154	600188	兖矿能源	6,000	136,380.00	0.19
155	600346	恒力石化	9,600	133,920.00	0.18
156	601111	中国国航	18,000	132,840.00	0.18
157	600115	中国东航	33,000	132,330.00	0.18
158	600029	南方航空	22,400	131,936.00	0.18
159	001979	招商蛇口	15,000	131,850.00	0.18
160	600760	中航沈飞	3,244	130,084.40	0.18
161	601117	中国化学	15,700	129,368.00	0.18
162	600183	生益科技	6,000	126,360.00	0.17
163	000733	振华科技	3,000	124,590.00	0.17
164	002001	新和成	6,484	124,492.80	0.17
165	000983	山西焦煤	12,000	123,720.00	0.17
166	002493	荣盛石化	12,800	123,648.00	0.17
167	002938	鹏鼎控股	3,100	123,256.00	0.17
168	600010	包钢股份	87,000	121,800.00	0.17
169	000807	云铝股份	9,000	121,590.00	0.17
170	601066	中信建投	6,300	121,212.00	0.17
171	002271	东方雨虹	9,600	118,464.00	0.16
172	600085	同仁堂	3,100	118,451.00	0.16
173	300628	亿联网络	3,220	118,399.40	0.16
174	002601	龙佰集团	6,300	116,991.00	0.16
175	000977	浪潮信息	3,200	116,384.00	0.16

176	002648	卫星化学	6,420	115,431.60	0.16
177	601360	三六零	15,000	115,200.00	0.16
178	600570	恒生电子	6,484	114,507.44	0.16
179	601868	中国能建	52,300	110,876.00	0.15
180	600219	南山铝业	28,800	109,728.00	0.15
181	601699	潞安环能	6,000	108,780.00	0.15
182	002736	国信证券	12,400	107,756.00	0.15
183	600372	中航机载	9,000	107,730.00	0.15
184	001965	招商公路	9,000	106,740.00	0.15
185	600023	浙能电力	15,000	106,650.00	0.15
186	002129	TCL中环	12,300	106,395.00	0.15
187	600845	宝信软件	3,288	104,985.84	0.14
188	600741	华域汽车	6,400	104,832.00	0.14
189	600176	中国巨石	9,459	104,521.95	0.14
190	601872	招商轮船	12,000	101,400.00	0.14
191	002459	晶澳科技	8,904	99,724.80	0.14
192	002812	恩捷股份	3,100	98,115.00	0.13
193	601881	中国银河	9,000	97,740.00	0.13
194	601838	成都银行	6,400	97,216.00	0.13
195	300418	昆仑万维	3,000	96,720.00	0.13
196	601336	新华保险	3,200	96,096.00	0.13
197	002466	天齐锂业	3,200	95,712.00	0.13
198	000786	北新建材	3,200	94,912.00	0.13
199	600233	圆通速递	6,000	93,900.00	0.13
200	603899	晨光股份	3,000	93,840.00	0.13
201	600026	中远海能	6,000	93,660.00	0.13
202	002460	赣锋锂业	3,260	93,399.00	0.13
203	300919	中伟股份	2,980	92,350.20	0.13
204	600332	白云山	3,100	90,923.00	0.12
205	600588	用友网络	9,000	90,000.00	0.12
206	601618	中国中冶	28,800	89,280.00	0.12

207	300316	晶盛机电	3,100	89,063.00	0.12
208	600415	小商品城	12,000	89,040.00	0.12
209	000963	华东医药	3,200	88,992.00	0.12
210	601995	中金公司	3,000	88,830.00	0.12
211	000876	新希望	9,600	87,744.00	0.12
212	600745	闻泰科技	3,100	87,575.00	0.12
213	601998	中信银行	12,800	85,760.00	0.12
214	600515	海南机场	27,000	84,780.00	0.12
215	600027	华电国际	12,000	83,280.00	0.11
216	002555	三七互娱	6,300	82,215.00	0.11
217	300999	金龙鱼	3,000	82,050.00	0.11
218	601898	中煤能源	6,400	79,872.00	0.11
219	002180	纳思达	3,000	79,260.00	0.11
220	688981	中芯国际	1,700	78,370.00	0.11
221	000301	东方盛虹	9,600	76,512.00	0.10
222	000895	双汇发展	3,200	76,064.00	0.10
223	600362	江西铜业	3,200	75,776.00	0.10
224	000408	藏格矿业	3,100	74,617.00	0.10
225	601238	广汽集团	9,600	74,304.00	0.10
226	600018	上港集团	12,800	73,984.00	0.10
227	300142	沃森生物	6,400	72,832.00	0.10
228	600918	中泰证券	12,700	72,009.00	0.10
229	600039	四川路桥	8,940	70,536.60	0.10
230	600025	华能水电	6,400	68,992.00	0.09
231	601878	浙商证券	6,400	68,608.00	0.09
232	603806	福斯特	4,525	66,517.50	0.09
233	300413	芒果超媒	3,100	64,790.00	0.09
234	605499	东鹏饮料	300	64,725.00	0.09
235	601319	中国人保	12,400	63,860.00	0.09
236	000596	古井贡酒	300	63,321.00	0.09
237	600803	新奥股份	3,000	62,400.00	0.09

238	601865	福莱特	3,100	62,310.00	0.08
239	600436	片仔癀	300	62,151.00	0.08
240	002074	国轩高科	3,200	61,280.00	0.08
241	601877	正泰电器	3,200	60,992.00	0.08
242	300759	康龙化成	3,200	59,456.00	0.08
243	300896	爱美客	340	58,514.00	0.08
244	002410	广联达	6,000	57,480.00	0.08
245	601607	上海医药	3,000	57,330.00	0.08
246	688012	中微公司	400	56,504.00	0.08
247	002709	天赐材料	3,200	56,192.00	0.08
248	600460	士兰微	3,200	56,032.00	0.08
249	600875	东方电气	3,000	55,350.00	0.08
250	600061	国投资本	9,664	54,601.60	0.07
251	601808	中海油服	3,100	53,320.00	0.07
252	300450	先导智能	3,200	53,216.00	0.07
253	002007	华兰生物	3,200	50,528.00	0.07
254	000617	中油资本	9,000	49,680.00	0.07
255	603659	璞泰来	3,265	46,134.45	0.06
256	002603	以岭药业	3,000	45,990.00	0.06
257	002841	视源股份	1,500	44,295.00	0.06
258	000708	中信特钢	3,200	43,424.00	0.06
259	300751	迈为股份	360	43,012.80	0.06
260	601698	中国卫通	3,000	42,270.00	0.06
261	601236	红塔证券	5,950	38,199.00	0.05
262	601799	星宇股份	300	33,612.00	0.05
263	688036	传音控股	420	32,146.80	0.04
264	002916	深南电路	300	31,731.00	0.04
265	300033	同花顺	300	31,110.00	0.04
266	600732	爱旭股份	3,220	29,141.00	0.04
267	000661	长春高新	300	27,531.00	0.04
268	300661	圣邦股份	325	26,903.50	0.04

269	605117	德业股份	356	26,465.04	0.04
270	002920	德赛西威	300	26,127.00	0.04
271	000800	一汽解放	3,200	25,056.00	0.03
272	603195	公牛集团	315	24,292.80	0.03
273	301269	华大九天	300	23,115.00	0.03
274	002821	凯莱英	340	22,372.00	0.03
275	300832	新产业	300	20,232.00	0.03
276	300979	华利集团	300	18,255.00	0.02
277	600132	重庆啤酒	300	18,210.00	0.02
278	688009	中国通号	3,000	18,000.00	0.02
279	688008	澜起科技	300	17,148.00	0.02
280	688599	天合光能	1,000	16,920.00	0.02
281	300223	北京君正	300	16,632.00	0.02
282	603296	华勤技术	300	16,569.00	0.02
283	603833	欧派家居	300	16,068.00	0.02
284	300454	深信服	300	15,159.00	0.02
285	688396	华润微	400	14,976.00	0.02
286	300957	贝泰妮	300	14,496.00	0.02
287	603260	合盛硅业	300	14,013.00	0.02
288	688126	沪硅产业	1,000	13,810.00	0.02
289	300442	润泽科技	300	7,185.00	0.01
290	001289	龙源电力	300	5,175.00	0.01
291	601059	信达证券	300	4,263.00	0.01
292	688223	晶科能源	300	2,130.00	0.00

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	300750	宁德时代	654,387.00	1.26
2	000858	五粮液	560,301.00	1.08
3	000333	美的集团	393,774.00	0.76
4	002371	北方华创	388,665.00	0.75
5	300760	迈瑞医疗	293,246.00	0.56
6	002594	比亚迪	264,079.00	0.51
7	000651	格力电器	236,841.00	0.45
8	300059	东方财富	204,355.00	0.39
9	300274	阳光电源	200,444.00	0.39
10	000725	京东方 A	198,185.00	0.38
11	600938	中国海油	196,800.00	0.38
12	002475	立讯精密	185,250.00	0.36
13	600900	长江电力	178,592.00	0.34
14	300124	汇川技术	175,989.00	0.34
15	002714	牧原股份	175,456.00	0.34
16	000568	泸州老窖	173,102.00	0.33
17	600519	贵州茅台	170,002.00	0.33
18	002415	海康威视	161,609.00	0.31
19	600161	天坛生物	153,191.00	0.29
20	300308	中际旭创	150,367.00	0.29

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	000858	五粮液	454,421.00	0.87

2	600600	青岛啤酒	234,056.00	0.45
3	300124	汇川技术	157,242.00	0.30
4	300308	中际旭创	155,633.00	0.30
5	603260	合盛硅业	136,653.00	0.26
6	601998	中信银行	104,709.00	0.20
7	002202	金风科技	95,460.00	0.18
8	002142	宁波银行	83,426.00	0.16
9	600028	中国石化	82,800.00	0.16
10	600754	锦江酒店	79,380.00	0.15
11	002371	北方华创	66,900.00	0.13
12	600436	片仔癀	66,456.00	0.13
13	601615	明阳智能	63,540.00	0.12
14	600016	民生银行	59,680.00	0.11
15	600030	中信证券	59,392.00	0.11
16	300750	宁德时代	55,092.00	0.11
17	688111	金山办公	52,416.00	0.10
18	605117	德业股份	49,798.00	0.10
19	000725	京东方 A	42,582.00	0.08
20	000001	平安银行	40,504.00	0.08

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	11,288,563.01
卖出股票收入（成交）总额	3,433,097.96

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 报告期内基金投资的前十名证券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	4,387.82

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	4,387.82

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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
1,498	64,257.75	67,250,649.00	69.86%	29,007,462.00	30.14%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中信银行股份有限公司-兴业沪深300交易型开放式指	52,500,700.	54.54%

	数证券投资基金发起式联接基金	00	
2	简街香港有限公司-JSQB有限公司(R)	4,034,700.0 0	4.19%
3	BARCLAYS BANK PLC	3,652,600.0 0	3.79%
4	王春风	1,332,200.0 0	1.38%
5	兴银理财有限责任公司-兴银理财增盈优选24号净值型理财产品	1,186,600.0 0	1.23%
6	兴银理财有限责任公司-兴银理财灵动全天候3号净值型理财产品	1,186,000.0 0	1.23%
7	兴银理财有限责任公司-兴银理财增盈稳享封闭式13号固收类理财产品	1,182,500.0 0	1.23%
8	兴银理财有限责任公司-兴银理财增盈稳享封闭式24号固收类理财产品	1,182,500.0 0	1.23%
9	兴银理财有限责任公司-兴银理财兴承恒享增盈两年定期开放3号固收类理财产品	1,176,400.0 0	1.22%
10	华泰证券股份有限公司	1,148,649.0 0	1.19%

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	69,258,111.00
本报告期基金总申购份额	30,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	3,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	96,258,111.00

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、2024年3月22日，钱睿南先生离任兴业基金管理有限公司副总经理职务。详见本公司于2024年3月23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、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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，未涉及本基金管理人、基金财产、中信银行股份有限公司托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国盛证券	2	8,406,494.01	57.10%	6,270.67	57.10%	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	6,315,166.96	42.90%	4,710.52	42.90%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：i 资历雄厚，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法违规行为而受到有关管理机关处罚。iii 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，合规风控能力较强，并能满足各产品运作高度保密的要求。iv 具备各标准化产品运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理各标准化产品进行证券交易的需要，并能为各标准化产品提供全面的信息服务，交易能力较强。v 研究综合实力较强。vi 其他因素（例如，虽综合能力一般，但在某些特色领域或行业，其研究能力、深度和质量在行业领先）。开立交易单元原则上券商应至少已提供两个季度以上的研究服务，并且在最近一季度服务评价评分中排名在前十名。

②券商专用交易单元选择程序：i 本基金管理人组织相关人员依据上述标准评估及确定选用的券商。ii 本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③在上述租用的券商交易单元中，本期未新增券商交易单元，剔除交易单元：华安证券交易单元2个。

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
国盛证	-	-	-	-	-	-	-	-

券								
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	9,888.11	100.00%	-	-	-	-	-	-

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	兴业沪深300交易型开放式指数证券投资基金2023年第四季度报告	中国证监会规定的媒介	2024-01-22
2	兴业沪深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书更新	中国证监会规定的媒介	2024-03-01
3	兴业基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金风险评价结果的通知	中国证监会规定的媒介	2024-03-21
4	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	2024-03-23
5	兴业沪深300交易型开放式指数证券投资基金2023年年度报告	中国证监会规定的媒介	2024-03-30
6	兴业沪深300交易型开放式指数证券投资基金2024年第一季度报告	中国证监会规定的媒介	2024-04-20
7	兴业沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定的媒介	2024-06-22
8	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	2024-06-25
9	兴业沪深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）（2024年第2号）	中国证监会规定的媒介	2024-06-25

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
联接基金	1	20240101-20240630	34,875,700.00	21,550,000.00	3,925,000.00	52,500,700.00	54.54%

产品特有风险

本基金本报告期出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。如果该类投资者集中赎回，可能会对本基金造成流动性压力；同时，该等集中赎回将可能产生（1）份额净值尾差风险；（2）基金净值波动的风险；（3）因引发基金本身的巨额赎回而导致中小投资者无法及时赎回的风险；（4）因基金资产净值低于5000万元从而影响投资目标实现或造成基金终止等风险。管理人将在基金运作中保持合适的流动性水平，并对申购赎回进行合理的应对，加强防范流动性风险，保护持有人利益。

上述份额占比为四舍五入，保留两位小数后的结果。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

二〇二四年八月三十日