
兴业沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

2021 年中期报告

2021 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:2021 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021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2021年1月1日起至2021年6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 中期财务会计报告(未经审计)	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	16
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	34
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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
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	48
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	48
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	49
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	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12 投资组合报告附注	49
§8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末上市基金前十名持有人	51

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
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.....	51
§9 开放式基金份额变动.....	51
§10 重大事件揭示.....	52
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
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.....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
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.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	53
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
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.....	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
§12 备查文件目录.....	55
12.1 备查文件目录.....	55
12.2 存放地点.....	55
12.3 查阅方式.....	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴业沪深300交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	兴业沪深300ETF
场内简称	兴业沪深300ETF（证券简称：兴业300；扩位证券简称：兴业沪深300ETF）
基金主代码	510370
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020年09月11日
基金管理人	兴业基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	45,258,111.00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	2020-10-27

2.2 基金产品说明

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

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

2.3 基金管理人和基金托管人

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

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 (2021年01月01日- 2021年06月30日)
本期已实现收益	7,702,702.66
本期利润	509,490.29
加权平均基金份额本期利润	0.0051
本期加权平均净值利润率	0.46%
本期基金份额净值增长率	0.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)
期末可供分配利润	4,546,931.22
期末可供分配基金份额利润	0.1005
期末基金资产净值	49,805,042.22
期末基金份额净值	1.1005
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)
基金份额累计净值增长率	10.05%

注：1、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。

2、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。

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	-1.72%	0.80%	-2.02%	0.80%	0.30%	0.00%

过去三个月	3.86%	0.97%	3.48%	0.98%	0.38%	-0.01%
过去六个月	0.40%	1.31%	0.24%	1.31%	0.16%	0.00%
自基金合同生效起至今	10.05%	1.13%	14.01%	1.20%	-3.96%	-0.07%

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



注：1、本基金基金合同于2020年9月11日生效，截至报告期末本基金基金合同生效未满一年。

2、根据本基金基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起六个月内已使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

兴业基金管理有限公司（以下简称“兴业基金”或“公司”）成立于2013年4月17日，是兴业银行控股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2021年6月30日，兴业基金共管理76只公募基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
那赛男	基金经理	2020-09-11	-	11年	中国籍，硕士学位，具有证券投资基金从业资格。2009年8月至2013年3月在博时基金管理有限公司ETF及量化投资部担任投资分析员；2013年4月至2015年6月在长盛基金管理有限公司权益投资部担任ETF专员；2015年7月至2016年11月在创金合信基金管理有限公司产品开发部从事相关研究工作；2016年11月至2018年4月在创金合信基金管理有限公司指数策略研究投资部历任研究员、基金经理助理，主要从事指数基金投资研究工

					作。2018年4月加入兴业基金管理有限公司，现任基金经理。
朱小明	基金经理	2020-10-12	-	8年	中国籍，北京大学金融数学专业硕士研究生，8年证券从业经验。2012年7月至2014年6月，在国泰基金管理有限公司担任量化研究员；2014年7月至2016年6月，在德骏达隆资产管理有限公司担任量化投资岗；2016年7月至2019年10月，在万家基金管理有限公司担任量化投资岗，期间2017年4月至2019年10月分别担任万家180指数证券投资基金、万家中证红利指数证券投资基金（LOF）、万家上证50交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019年10月加入兴业基金管理有限公司，现任基金经理。

1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期，除首任基金经理外，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金作为被动投资的指数基金，其投资目标是通过跟踪、复制沪深300指数，为投资者获取市场长期的平均收益。报告期内我们严格按照基金合同规定，原则上采取完全复制的方法进行投资管理，努力拟合标的指数，减小跟踪误差，将基金跟踪误差控制在较低范围之内。回顾今年上半年，市场走势分化加大，以新能源汽车、光伏为代表的科技板块表现更佳。同期沪深300指数微涨0.24%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴业沪深300ETF基金份额净值为1.1005元，本报告期内，基金份额净值增长率为0.40%，同期业绩比较基准收益率为0.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望今年下半年，国内政策方面，“碳中和”是长期主线，但短期估值过高的问题需要留意。国外方面，美联储的货币政策是影响全球流动性的重要因素，需要加以关注。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、估值政策及重大变化

无。

2、估值政策重大变化对基金资产净值及当期损益的影响

无。

3、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

(1) 公司方面

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，由研究部门、投资管理部门（视会议议题内容选择相关投资方向部门）、风险管理部门、监察稽核部门、基金运营部门负责人或其指定人员组成。

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。

（2）托管银行

托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任，并且认真核查公司采用的估值政策和程序。

（3）会计师事务所

对相关估值模型、假设及参数的适当性出具审核意见和报告。

4、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

5、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息

无。

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2021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2021年中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 中期财务会计报告(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：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,229,287.09	663,754.50
结算备付金		5,097.78	192,505.79
存出保证金		12,663.50	101,054.15
交易性金融资产	6.4.7.2	48,220,058.41	124,684,126.60

其中：股票投资		48,220,058.41	124,684,126.60
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	165.06	210.73
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		50,467,271.84	125,641,651.77
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020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		-	-
应付证券清算款		482.71	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		38,834.52	53,322.86
应付托管费		7,766.88	10,664.60
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	32,532.74	209,049.29
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	582,612.77	135,000.00
负债合计		662,229.62	408,036.75
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	45,258,111.00	114,258,111.00
未分配利润	6.4.7.10	4,546,931.22	10,975,504.02
所有者权益合计		49,805,042.22	125,233,615.02
负债和所有者权益总计		50,467,271.84	125,641,651.77

注：报告截止日2021年6月30日，基金份额净值1.1005元，基金份额总额45,258,111.00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：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至2021年0 6月30日
一、收入		1,081,529.69
1. 利息收入		2,044.77
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,044.77
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		8,064,630.22
其中：股票投资收益	6.4.7.12	7,402,864.83
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-

衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	661,765.39
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-7,193,212.37
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	208,067.07
减：二、费用		572,039.40
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	274,771.18
2. 托管费	6.4.10.2.2	54,954.22
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	87,849.94
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.19	154,464.06
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		509,490.29
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		509,490.29

注：本基金合同于2020年09月11日生效，本报告期按实际存续期计算，无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴业沪深300交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	114,258,111.00	10,975,504.02	125,233,615.02
二、本期经营活动产	-	509,490.29	509,490.29

生的基金净值变动数(本期利润)			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-69,000,000.00	-6,938,063.09	-75,938,063.09
其中: 1. 基金申购款	3,000,000.00	516,859.29	3,516,859.29
2. 基金赎回款	-72,000,000.00	-7,454,922.38	-79,454,922.38
四、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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	45,258,111.00	4,546,931.22	49,805,042.22

注: 本基金合同于2020年09月11日生效, 本报告期按实际存续期计算, 无上年度可比期间数据。

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

庄孝强

夏鹏

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

兴业沪深300交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人兴业基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《兴业沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]773号文准予公开募集注册。本基金为交易型开放式基金,存续期限为不定期。本基金首次设立募集基金份额为216,258,111.00份,经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为毕马威华振验字第2000593号验资报告。《兴业沪深300交易型开放式指数证券投资基金

基金合同》(以下简称“基金合同”)于2020年9月11日正式生效。本基金的基金管理人为兴业基金管理有限公司,基金托管人为中信银行股份有限公司(以下简称“中信银行”)。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的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2021年6月30日的财务状况以及2021年1月1日至2021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

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说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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]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，对受让方不再缴纳印花税。

(5) 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	
	2021年06月30日	
活期存款	2,229,287.09	
定期存款	-	
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	-	
合计	2,229,287.09	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2021年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	44,525,768.77	48,220,058.41	3,694,289.64
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	44,525,768.77	48,220,058.41	3,694,289.64

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工具。

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

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产余额。

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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	157.06
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2.30
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	5.70
合计	165.06

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	32,532.74
银行间市场应付交易费用	-

合计	32,532.74
----	-----------

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用-审计费	24,795.19
预提费用-信息披露费	59,507.37
应付指数使用费	35,000.00
可退替代款	5,701.80
应退替代款	457,608.41
合计	582,612.77

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	114,258,111.00	114,258,111.00
本期申购	3,000,000.00	3,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-72,000,000.00	-72,000,000.00
本期末	45,258,111.00	45,258,111.00

注：本期申购含红利再投、转换入份（金）额，本期赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.10 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	2,282,280.39	8,693,223.63	10,975,504.02
本期利润	7,702,702.66	-7,193,212.37	509,490.29
本期基金份额交易产	-4,534,046.12	-2,404,016.97	-6,938,063.09

生的变动数			
其中：基金申购款	95,963.07	420,896.22	516,859.29
基金赎回款	-4,630,009.19	-2,824,913.19	-7,454,922.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,450,936.93	-904,005.71	4,546,931.22

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	1,086.87
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	306.79
其他	651.11
合计	2,044.77

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	3,678,322.45
股票投资收益——赎回差价收入	3,724,542.38
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	7,402,864.83

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	42,803,920.18

减：卖出股票成本总额	39,125,597.73
买卖股票差价收入	3,678,322.45

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
赎回基金份额对价总额	79,454,922.38
减：现金支付赎回款总额	31,259,142.38
减：赎回股票成本总额	44,471,237.62
赎回差价收入	3,724,542.38

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	661,765.39
基金投资产生的股利收益	-
合计	661,765.39

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
------	----

	2021年01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	-7, 193, 212. 37
——股票投资	-7, 193, 212. 37
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-7, 193, 212. 37

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	-
ETF基金替代损益	208, 067. 07
合计	208, 067. 07

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	87, 849. 94
银行间市场交易费用	-
合计	87, 849. 94

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
汇划手续费	161.50
其他费用_指数使用费	70,000.00
合计	154,464.06

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
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
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
中海集团投资有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	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	274,771.18
其中：支付销售机构的客户维护费	-

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	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	54,954.22

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期未发生与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)交易的情况。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
中信银行	2,229,287.09	1,086.87

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中信银行保管，按银行同业利率计息。

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

本基金本报告期无须说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的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（2021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	股票	停牌	停牌	期末	复牌	复牌	数量 (股)	期末成本 总额	期末估值 总额	备注
----	----	----	----	----	----	----	-----------	------------	------------	----

代 码	名 称	日 期	原 因	估 值 单 价	日 期	开 盘 单 价				
002 024	苏 宁 易 购	202 1-0 6-1 6	重 大 事 项 停 牌	5.5 9	202 1-0 7-0 6	6.1 5	19,600	185,145.1 9	109,564.0 0	-

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末未持有按信用评级列示的债券。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度，按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严

格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

截止本报告期末及上年度末，本基金无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年06 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	2,229,287.09	-	-	-	2,229,287.09
结算备付金	5,097.78	-	-	-	5,097.78
存出保证金	12,663.50	-	-	-	12,663.50
交易性金融资产	-	-	-	48,220,058.41	48,220,058.41
应收利息	-	-	-	165.06	165.06
资产总计	2,247,048.37	-	-	48,220,223.47	50,467,271.84
负债					
应付证券清算款	-	-	-	463,792.92	463,792.92
应付管理人报酬	-	-	-	38,834.52	38,834.52
应付托管费	-	-	-	7,766.88	7,766.88
应付交易费用	-	-	-	32,532.74	32,532.74
其他负债	-	-	-	119,302.56	119,302.56

负债总计	-	-	-	662,229.62	662,229.62
利率敏感度缺口	2,247,048.37	-	-	47,557,993.85	49,805,042.22
上年度末 2020年12 月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	663,754.50	-	-	-	663,754.50
结算备付金	192,505.79	-	-	-	192,505.79
存出保证金	101,054.15	-	-	-	101,054.15
交易性金融资产	-	-	-	124,684,126.60	124,684,126.60
应收利息	-	-	-	210.73	210.73
资产总计	957,314.44	-	-	124,684,337.33	125,641,651.77
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	53,322.86	53,322.86
应付托管费	-	-	-	10,664.60	10,664.60
应付交易费用	-	-	-	209,049.29	209,049.29
其他负债	-	-	-	135,000.00	135,000.00
负债总计	-	-	-	408,036.75	408,036.75
利率敏感度缺口	957,314.44	-	-	124,276,300.58	125,233,615.02

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险可来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项，也可来源于市场整体波动。

本基金基金管理人在构建和管理投资组合过程中，通过对宏观经济情况及政策分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金基金管理人定期结合宏观及微观环境变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行动态修正，以主动应对可能发生的其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，基金管理人对本基金所持仓证券价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量，以测试本基金所面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日		上年度末 2020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	48,220,058.41	96.82	124,684,126.60	99.56
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	48,220,058.41	96.82	124,684,126.60	99.56

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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	股票价格上升5%	2,411,002.92	6,234,206.33
	股票价格下降5%	-2,411,002.92	-6,234,206.33

6.4.14 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	48,220,058.41	95.55
	其中：股票	48,220,058.41	95.55
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,234,384.87	4.43
8	其他各项资产	12,828.56	0.03
9	合计	50,467,271.84	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	586,129.40	1.18
B	采矿业	989,764.00	1.99
C	制造业	26,338,579.89	52.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	833,981.00	1.67
E	建筑业	570,271.00	1.15
F	批发和零售业	423,306.00	0.85
G	交通运输、仓储和邮政业	1,425,354.60	2.86
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,622,213.74	3.26
J	金融业	11,251,290.96	22.59
K	房地产业	1,076,070.00	2.16
L	租赁和商务服务业	790,486.00	1.59
M	科学研究和技术服务业	654,342.00	1.31
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	971,816.82	1.95
R	文化、体育和娱乐业	238,796.00	0.48
S	综合	-	-
	合计	47,772,401.41	95.92

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-

C	制造业	188,139.00	0.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	102,078.00	0.20
K	房地产业	157,440.00	0.32
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	447,657.00	0.90

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	1,400	2,879,380.00	5.78
2	601318	中国平安	23,600	1,517,008.00	3.05
3	000858	五粮液	5,000	1,489,450.00	2.99

4	600036	招商银行	27,200	1,473,968.00	2.96
5	601012	隆基股份	11,500	1,021,660.00	2.05
6	000333	美的集团	12,400	884,988.00	1.78
7	300059	东方财富	21,280	697,771.20	1.40
8	000651	格力电器	12,800	666,880.00	1.34
9	600276	恒瑞医药	9,800	666,106.00	1.34
10	601166	兴业银行	32,200	661,710.00	1.33
11	002594	比亚迪	2,400	602,400.00	1.21
12	603259	药明康德	3,800	595,042.00	1.19
13	000001	平安银行	25,200	570,024.00	1.14
14	601888	中国中免	1,800	540,180.00	1.08
15	002415	海康威视	8,100	522,450.00	1.05
16	600900	长江电力	24,600	507,744.00	1.02
17	600887	伊利股份	13,600	500,888.00	1.01
18	600030	中信证券	18,800	468,872.00	0.94
19	000568	泸州老窖	1,900	448,286.00	0.90
20	002714	牧原股份	6,920	420,874.40	0.85
21	600309	万华化学	3,800	413,516.00	0.83
22	000002	万科 A	17,100	407,151.00	0.82
23	002475	立讯精密	8,800	404,800.00	0.81
24	601398	工商银行	77,000	398,090.00	0.80
25	600031	三一重工	13,100	380,817.00	0.76
26	600436	片仔癀	800	358,640.00	0.72
27	600809	山西汾酒	800	358,400.00	0.72
28	000725	京东方 A	56,200	350,688.00	0.70
29	603288	海天味业	2,690	346,875.50	0.70
30	300015	爱尔眼科	4,709	334,244.82	0.67
31	601919	中远海控	10,900	332,886.00	0.67
32	603501	韦尔股份	1,000	322,000.00	0.65
33	300122	智飞生物	1,700	317,441.00	0.64
34	002352	顺丰控股	4,600	311,420.00	0.63

35	002304	洋河股份	1,500	310,800.00	0.62
36	000661	长春高新	800	309,600.00	0.62
37	300124	汇川技术	4,050	300,753.00	0.60
38	601328	交通银行	60,500	296,450.00	0.60
39	601899	紫金矿业	30,500	295,545.00	0.59
40	002230	科大讯飞	4,300	290,594.00	0.58
41	000100	TCL科技	36,200	276,930.00	0.56
42	300014	亿纬锂能	2,600	270,218.00	0.54
43	600438	通威股份	6,000	259,620.00	0.52
44	600000	浦发银行	25,800	258,000.00	0.52
45	002460	赣锋锂业	2,100	254,289.00	0.51
46	300142	沃森生物	4,100	252,970.00	0.51
47	002027	分众传媒	26,600	250,306.00	0.50
48	002241	歌尔股份	5,800	247,892.00	0.50
49	600763	通策医疗	600	246,600.00	0.50
50	600837	海通证券	21,100	242,650.00	0.49
51	603799	华友钴业	2,100	239,820.00	0.48
52	002271	东方雨虹	4,200	232,344.00	0.47
53	601816	京沪高铁	43,200	228,528.00	0.46
54	002142	宁波银行	5,800	226,026.00	0.45
55	000338	潍柴动力	12,600	225,162.00	0.45
56	601601	中国太保	7,700	223,069.00	0.45
57	601668	中国建筑	46,300	215,295.00	0.43
58	300347	泰格医药	1,100	212,630.00	0.43
59	600690	海尔智家	8,200	212,462.00	0.43
60	600585	海螺水泥	5,000	205,250.00	0.41
61	600016	民生银行	46,500	205,065.00	0.41
62	000063	中兴通讯	5,900	196,057.00	0.39
63	600570	恒生电子	2,100	195,825.00	0.39
64	002371	北方华创	700	194,166.00	0.39
65	600703	三安光电	6,000	192,300.00	0.39

66	603986	兆易创新	1,020	191,658.00	0.38
67	601288	农业银行	63,200	191,496.00	0.38
68	600048	保利地产	15,800	190,232.00	0.38
69	600919	江苏银行	26,040	184,884.00	0.37
70	601229	上海银行	22,000	180,400.00	0.36
71	600196	复星医药	2,500	180,325.00	0.36
72	002311	海大集团	2,200	179,520.00	0.36
73	600660	福耀玻璃	3,200	178,720.00	0.36
74	601688	华泰证券	11,300	178,540.00	0.36
75	002129	中环股份	4,600	177,560.00	0.36
76	600104	上汽集团	8,000	175,760.00	0.35
77	600050	中国联通	40,600	175,392.00	0.35
78	600406	国电南瑞	7,380	171,511.20	0.34
79	002410	广联达	2,500	170,500.00	0.34
80	601211	国泰君安	9,900	169,686.00	0.34
81	300498	温氏股份	11,500	165,255.00	0.33
82	601766	中国中车	26,500	161,120.00	0.32
83	688111	金山办公	400	157,920.00	0.32
84	601169	北京银行	32,300	157,301.00	0.32
85	600999	招商证券	8,000	152,160.00	0.31
86	002821	凯莱英	400	149,040.00	0.30
87	600019	宝钢股份	19,400	148,216.00	0.30
88	688036	传音控股	700	146,650.00	0.29
89	601088	中国神华	7,300	142,496.00	0.29
90	601988	中国银行	45,900	141,372.00	0.28
91	002812	恩捷股份	600	140,460.00	0.28
92	601818	光大银行	35,900	135,702.00	0.27
93	000625	长安汽车	5,100	134,028.00	0.27
94	688012	中微公司	800	132,736.00	0.27
95	300413	芒果超媒	1,900	130,340.00	0.26
96	002493	荣盛石化	7,500	129,525.00	0.26

97	600028	中国石化	29,200	127,312.00	0.26
98	600745	闻泰科技	1,300	125,970.00	0.25
99	600346	恒力石化	4,800	125,952.00	0.25
100	600009	上海机场	2,600	125,138.00	0.25
101	002601	龙蟠佰利	3,500	121,030.00	0.24
102	601658	邮储银行	23,800	119,476.00	0.24
103	600132	重庆啤酒	600	118,770.00	0.24
104	002001	新和成	4,120	118,161.60	0.24
105	300433	蓝思科技	4,000	117,640.00	0.24
106	601390	中国中铁	22,200	116,328.00	0.23
107	601377	兴业证券	12,000	115,920.00	0.23
108	000538	云南白药	1,000	115,720.00	0.23
109	601628	中国人寿	3,400	115,226.00	0.23
110	601009	南京银行	10,800	113,616.00	0.23
111	601633	长城汽车	2,600	113,334.00	0.23
112	601857	中国石油	21,200	112,148.00	0.23
113	603882	金域医学	700	111,839.00	0.22
114	600893	航发动力	2,100	111,699.00	0.22
115	600588	用友网络	3,300	109,758.00	0.22
116	002024	苏宁易购	19,600	109,564.00	0.22
117	000166	申万宏源	23,300	109,044.00	0.22
118	600426	华鲁恒升	3,500	108,325.00	0.22
119	000776	广发证券	7,100	107,494.00	0.22
120	300003	乐普医疗	3,300	105,996.00	0.21
121	000963	华东医药	2,300	105,823.00	0.21
122	600111	北方稀土	5,100	105,570.00	0.21
123	002050	三花智控	4,400	105,512.00	0.21
124	601225	陕西煤业	8,900	105,465.00	0.21
125	600584	长电科技	2,700	101,736.00	0.20
126	600741	华域汽车	3,800	99,826.00	0.20
127	601939	建设银行	14,900	99,085.00	0.20

128	300408	三环集团	2,300	97,566.00	0.20
129	000768	中航西飞	3,700	97,236.00	0.20
130	601336	新华保险	2,100	96,411.00	0.19
131	000157	中联重科	10,400	96,096.00	0.19
132	601155	新城控股	2,300	95,680.00	0.19
133	600958	东方证券	9,500	94,905.00	0.19
134	002179	中航光电	1,200	94,824.00	0.19
135	600760	中航沈飞	1,560	94,068.00	0.19
136	002008	大族激光	2,300	92,897.00	0.19
137	002236	大华股份	4,400	92,840.00	0.19
138	600600	青岛啤酒	800	92,520.00	0.19
139	600926	杭州银行	6,200	91,450.00	0.18
140	601799	星宇股份	400	90,288.00	0.18
141	001979	招商蛇口	8,200	89,790.00	0.18
142	002202	金风科技	7,300	88,768.00	0.18
143	002007	华兰生物	2,400	88,032.00	0.18
144	000876	新希望	6,000	88,020.00	0.18
145	601901	方正证券	9,300	87,048.00	0.17
146	601006	大秦铁路	13,100	86,198.00	0.17
147	601100	恒立液压	1,000	85,920.00	0.17
148	603806	福斯特	800	84,104.00	0.17
149	000938	紫光股份	3,800	83,144.00	0.17
150	601989	中国重工	20,100	82,812.00	0.17
151	003816	中国广核	30,700	81,969.00	0.16
152	603659	璞泰来	600	81,960.00	0.16
153	002736	国信证券	7,600	81,700.00	0.16
154	002555	三七互娱	3,400	81,668.00	0.16
155	000069	华侨城 A	10,900	81,096.00	0.16
156	600015	华夏银行	13,100	81,089.00	0.16
157	000425	徐工机械	12,500	79,625.00	0.16
158	603993	洛阳钼业	15,400	79,464.00	0.16

159	600143	金发科技	3,800	79,268.00	0.16
160	600176	中国巨石	5,059	78,465.09	0.16
161	600352	浙江龙盛	5,700	78,318.00	0.16
162	600010	包钢股份	50,300	77,965.00	0.16
163	603160	汇顶科技	600	77,778.00	0.16
164	002049	紫光国微	500	77,095.00	0.15
165	601138	工业富联	6,200	76,942.00	0.15
166	601788	光大证券	4,300	76,927.00	0.15
167	601600	中国铝业	14,400	76,320.00	0.15
168	603369	今世缘	1,400	75,824.00	0.15
169	601186	中国铁建	10,100	75,043.00	0.15
170	000786	北新建材	1,900	74,575.00	0.15
171	000783	长江证券	10,000	73,200.00	0.15
172	600547	山东黄金	3,800	73,036.00	0.15
173	601916	浙商银行	18,200	72,254.00	0.15
174	000596	古井贡酒	300	71,850.00	0.14
175	603833	欧派家居	500	70,980.00	0.14
176	300144	宋城演艺	4,200	70,560.00	0.14
177	601877	正泰电器	2,100	70,098.00	0.14
178	600989	宝丰能源	5,100	69,768.00	0.14
179	300274	阳光电源	600	69,036.00	0.14
180	002600	领益智造	7,500	68,925.00	0.14
181	688008	澜起科技	1,100	68,618.00	0.14
182	002414	高德红外	2,480	68,398.40	0.14
183	300033	同花顺	600	67,668.00	0.14
184	603899	晨光文具	800	67,648.00	0.14
185	603517	绝味食品	800	67,432.00	0.14
186	000895	双汇发展	2,100	66,780.00	0.13
187	002044	美年健康	7,300	66,503.00	0.13
188	601238	广汽集团	5,100	66,045.00	0.13
189	600085	同仁堂	1,600	65,360.00	0.13

190	002624	完美世界	2,714	64,891.74	0.13
191	600109	国金证券	5,100	64,719.00	0.13
192	601669	中国电建	16,700	64,629.00	0.13
193	002938	鹏鼎控股	1,800	64,584.00	0.13
194	601838	成都银行	5,000	63,200.00	0.13
195	600795	国电电力	25,900	62,937.00	0.13
196	002384	东山精密	3,000	62,520.00	0.13
197	300136	信维通信	2,000	61,760.00	0.12
198	600150	中国船舶	3,700	61,087.00	0.12
199	600886	国投电力	6,300	60,543.00	0.12
200	002602	世纪华通	9,400	60,348.00	0.12
201	000066	中国长城	4,100	59,860.00	0.12
202	601360	三六零	4,900	59,829.00	0.12
203	300676	华大基因	500	59,300.00	0.12
204	601985	中国核电	11,600	58,696.00	0.12
205	300628	亿联网络	700	58,660.00	0.12
206	000703	恒逸石化	4,800	57,360.00	0.12
207	603392	万泰生物	220	57,019.60	0.11
208	601108	财通证券	5,400	56,646.00	0.11
209	601066	中信建投	1,800	56,574.00	0.11
210	600029	南方航空	9,300	55,986.00	0.11
211	601555	东吴证券	6,700	55,878.00	0.11
212	688363	华熙生物	200	55,572.00	0.11
213	002916	深南电路	500	55,565.00	0.11
214	600161	天坛生物	1,600	54,800.00	0.11
215	688396	华润微	600	54,612.00	0.11
216	600383	金地集团	5,300	54,272.00	0.11
217	600332	白云山	1,600	54,160.00	0.11
218	600183	生益科技	2,300	53,843.00	0.11
219	000977	浪潮信息	1,900	53,447.00	0.11
220	601077	渝农商行	13,200	52,668.00	0.11

221	601800	中国交建	8,100	52,488.00	0.11
222	603019	中科曙光	1,900	52,459.00	0.11
223	600522	中天科技	5,200	52,000.00	0.10
224	600079	人福医药	1,800	50,886.00	0.10
225	601607	上海医药	2,400	50,712.00	0.10
226	002456	欧菲光	5,700	50,616.00	0.10
227	002157	正邦科技	4,200	50,190.00	0.10
228	600115	中国东航	9,800	49,784.00	0.10
229	601111	中国国航	6,300	49,014.00	0.10
230	601878	浙商证券	3,700	48,396.00	0.10
231	000656	金科股份	8,300	48,057.00	0.10
232	600061	国投资本	5,564	47,238.36	0.09
233	601727	上海电气	11,100	47,064.00	0.09
234	601618	中国中冶	15,600	46,488.00	0.09
235	600705	中航资本	12,000	46,440.00	0.09
236	600872	中炬高新	1,100	46,222.00	0.09
237	600521	华海药业	2,200	45,936.00	0.09
238	601021	春秋航空	800	45,520.00	0.09
239	601162	天风证券	9,300	45,198.00	0.09
240	603939	益丰药房	800	44,872.00	0.09
241	002463	沪电股份	2,900	44,863.00	0.09
242	600362	江西铜业	2,000	44,760.00	0.09
243	600848	上海临港	2,500	44,750.00	0.09
244	000728	国元证券	5,520	43,994.40	0.09
245	002252	上海莱士	5,800	43,442.00	0.09
246	601696	中银证券	2,100	43,239.00	0.09
247	601995	中金公司	700	43,050.00	0.09
248	600655	豫园股份	3,700	42,883.00	0.09
249	600606	绿地控股	7,800	42,510.00	0.09
250	000860	顺鑫农业	1,000	42,180.00	0.08
251	600845	宝信软件	820	41,738.00	0.08

252	601990	南京证券	3,900	41,028.00	0.08
253	688126	沪硅产业	1,400	40,852.00	0.08
254	603195	公牛集团	200	40,400.00	0.08
255	600011	华能国际	9,500	40,090.00	0.08
256	601872	招商轮船	8,580	39,639.60	0.08
257	000708	中信特钢	1,900	39,596.00	0.08
258	601933	永辉超市	8,200	38,786.00	0.08
259	603658	安图生物	510	38,642.70	0.08
260	601216	君正集团	7,500	38,175.00	0.08
261	002739	万达电影	2,400	37,896.00	0.08
262	600018	上港集团	7,900	37,683.00	0.08
263	002508	老板电器	800	37,200.00	0.07
264	600489	中金黄金	4,300	37,066.00	0.07
265	002120	韵达股份	2,700	36,531.00	0.07
266	300450	先导智能	600	36,084.00	0.07
267	002673	西部证券	4,300	35,475.00	0.07
268	603338	浙江鼎力	600	35,214.00	0.07
269	600118	中国卫星	1,200	35,112.00	0.07
270	300529	健帆生物	400	34,544.00	0.07
271	601998	中信银行	6,500	33,150.00	0.07
272	688009	中国通号	5,700	32,433.00	0.07
273	601319	中国人保	5,300	31,429.00	0.06
274	300595	欧普康视	300	31,065.00	0.06
275	603233	大参林	600	30,666.00	0.06
276	601881	中国银河	2,800	30,184.00	0.06
277	002939	长城证券	2,500	27,825.00	0.06
278	600233	圆通速递	2,700	27,027.00	0.05
279	002032	苏泊尔	400	25,516.00	0.05
280	601231	环旭电子	1,500	25,215.00	0.05
281	000800	一汽解放	2,300	24,886.00	0.05
282	600482	中国动力	1,400	24,388.00	0.05

283	601236	红塔证券	1,700	23,052.00	0.05
284	600340	华夏幸福	4,300	22,532.00	0.05
285	600025	华能水电	3,800	22,002.00	0.04
286	603087	甘李药业	200	21,316.00	0.04
287	600918	中泰证券	1,800	19,476.00	0.04
288	601808	中海油服	1,200	17,232.00	0.03
289	002153	石基信息	680	15,986.80	0.03
290	300601	康泰生物	100	14,900.00	0.03
291	002558	巨人网络	1,000	13,300.00	0.03
292	601698	中国卫通	800	12,952.00	0.03
293	002945	华林证券	700	9,674.00	0.02
294	600299	安迪苏	800	9,568.00	0.02
295	002773	康弘药业	300	6,939.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	002422	科伦药业	5,300	105,735.00	0.21
2	000723	美锦能源	10,900	82,404.00	0.17
3	002958	青农商行	14,800	63,344.00	0.13
4	000961	中南建设	10,100	59,792.00	0.12
5	002146	荣盛发展	9,200	51,888.00	0.10
6	000671	阳光城	8,800	45,760.00	0.09
7	000627	天茂集团	10,700	38,734.00	0.08

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	600519	贵州茅台	1,466,020.00	1.17
2	601012	隆基股份	489,930.00	0.39
3	600809	山西汾酒	472,635.00	0.38
4	601816	京沪高铁	439,203.00	0.35
5	300274	阳光电源	392,782.00	0.31
6	688169	石头科技	291,000.00	0.23
7	300450	先导智能	256,376.00	0.20
8	688111	金山办公	248,168.95	0.20
9	600426	华鲁恒升	242,794.00	0.19
10	603806	福斯特	239,084.00	0.19
11	601888	中国中免	233,088.00	0.19
12	300595	欧普康视	211,073.00	0.17
13	600132	重庆啤酒	205,073.00	0.16
14	603501	韦尔股份	195,845.00	0.16
15	600050	中国联通	186,701.00	0.15
16	601658	邮储银行	185,928.00	0.15
17	603882	金域医学	182,371.00	0.15
18	600143	金发科技	178,287.00	0.14
19	600900	长江电力	147,484.00	0.12
20	601799	星宇股份	146,701.00	0.12

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	2,293,802.00	1.83
2	000333	美的集团	1,577,330.00	1.26
3	000651	格力电器	1,022,951.00	0.82
4	300059	东方财富	1,000,493.80	0.80
5	002415	海康威视	988,867.00	0.79

6	002594	比亚迪	893,201.00	0.71
7	000001	平安银行	859,033.00	0.69
8	002475	立讯精密	846,199.00	0.68
9	000725	京东方 A	770,179.00	0.61
10	000568	泸州老窖	714,196.00	0.57
11	000002	万科 A	704,420.00	0.56
12	002714	牧原股份	617,760.00	0.49
13	300015	爱尔眼科	606,887.00	0.48
14	002142	宁波银行	545,380.00	0.44
15	002352	顺丰控股	545,281.00	0.44
16	002304	洋河股份	498,514.00	0.40
17	300014	亿纬锂能	488,680.00	0.39
18	002812	恩捷股份	460,689.00	0.37
19	000661	长春高新	448,742.00	0.36
20	300347	泰格医药	443,642.00	0.35

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	12,127,408.53
卖出股票收入（成交）总额	42,803,920.18

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货，也无期间损益。

7.10.2 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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金投资范围不包含国债期货。

7.11.3 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，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	12,663.50
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	165.06
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,828.56

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。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 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
887	51,023.80	29,502,611.00	65.187 5%	15,755,500.00	34.812 5%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份 额比例
1	兴业财富—兴业银行“现金宝(4号)”—私人银行类人民币理财产品	28,748,111.00	63.52%
2	福州融航资产管理有限公司—融航聚塔11号私募证券投资基金	754,500.00	1.67%
3	陈露茵	644,600.00	1.42%
4	郭林发	460,800.00	1.02%
5	时桂清	315,400.00	0.70%
6	沈金娣	250,000.00	0.55%
7	郑宜昌	222,500.00	0.49%
8	武杰	200,000.00	0.44%
9	章霞	200,000.00	0.44%
10	吴献忠	200,000.00	0.44%
11	黄寿南	200,000.00	0.44%
12	张立	200,000.00	0.44%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	10,000.00	0.0221%

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	114,258,111.00
本报告期基金总申购份额	3,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	72,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	45,258,111.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

无。

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、2021年6月30日，钱睿南先生担任兴业基金管理有限公司副总经理，详见本公司于2021年7月1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	交	股票交易	应支付该券商的佣金	备
----	---	------	-----------	---

名称	易单元数量	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	注
国盛证券	2	4,777,795.00	8.70%	3,493.85	8.70%	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	50,153,533.71	91.30%	36,677.46	91.30%	-

①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

- i 资历雄厚，信誉良好，注册资本不少于3 亿元人民币。
- ii 财务状况良好，经营行为规范，最近一年未因发生重大违规行为而受到有关管理机关处罚。
- iii 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需 要，并能为本基金提供全面的信息服务。
- iv 投研交综合实力较强。
- v 其他因素(综合能力一般，但在某些特色领域或行业，研究能力、深度和质量在行业领先)。

②券商专用交易单元选择程序：

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

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③在上述租用的券商交易单元中，本期未剔除券商交易单元，新增交易单元：华安证券股份有限公司。

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旗下基金2020年第四季度报告	中国证监会规定的媒介	2021-01-22
2	兴业基金管理有限公司关于旗下10只指数基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告	中国证监会规定的媒介	2021-03-26
3	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）（2021年第1号）	中国证监会规定的媒介	2021-03-26
4	兴业沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同	中国证监会规定的媒介	2021-03-26
5	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	2021-03-26
6	兴业基金管理有限公司旗下公募基金2020年年度报告	中国证监会规定的媒介	2021-03-31
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	2021-04-17
8	兴业基金管理有限公司旗下基金2021年第一季度报告	中国证监会规定的媒介	2021-04-22
9	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	2021-07-01

§ 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
机构	1	20210101-20210630	80,006,111.00	0.00	51,258,000.00	28,748,111.00	63.52%
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。

注：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

本报告期内，兴业沪深300交易型开放式指数证券投资基金于2021年3月26日公告《兴业基金管理有限公司关于旗下10只指数基金根据〈公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引〉修改基金合同部分条款的公告》，根据中国证监会2021年1月22日颁布、同年2月1日实施的《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》及本基金基金合同的有关规定，对本基金的基金合同、招募说明书和产品资料概要等法律文件的相关条款进行修改。修订后的《兴业沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《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）（2021年第1号）》及《兴业沪深300交易型开放式指数证券投资基金产品资料概要更新》于2021年3月26日起生效。

§ 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

除上述第（六）项文件存放于基金托管人处外，其他备查文件等文本存放于基金管理人处，投资人在办公时间内可免费查阅。

12.3 查阅方式

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
二〇二一年八月三十一日