

# 兴业中证 500 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:中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国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	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 中期财务会计报告(未经审计)	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	55
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	55
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	55
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	55
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	56
§8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2 期末上市基金前十名持有人	57
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58

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.....	58
§9 开放式基金份额变动.....	58
§10 重大事件揭示.....	58
10.1 基金份额持有人大会决议.....	58
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.....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
10.4 基金投资策略的改变.....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
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.....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
10.8 其他重大事件.....	60
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	61
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.....	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
§12 备查文件目录.....	62
12.1 备查文件目录.....	62
12.2 存放地点.....	62
12.3 查阅方式.....	62

## § 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	48,060,583.00份
基金合同存续期	不定期
上市日期	2020-08-12

### 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	王慧	许俊
	联系电话	021-22211888	010-66594319
	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

### 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	3,889,283.42
本期利润	9,406,949.11
加权平均基金份额本期利润	0.0680
本期加权平均净值利润率	7.06%
本期基金份额净值增长率	7.07%
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	406,479.81
期末可供分配基金份额利润	0.0085
期末基金资产净值	48,837,326.37
期末基金份额净值	1.0162
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	1.62%

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	1.36%	0.73%	1.18%	0.73%	0.18%	0.00%
过去三个月	9.25%	0.67%	8.86%	0.68%	0.39%	-0.01%
过去六个月	7.07%	0.98%	6.93%	0.99%	0.14%	-0.01%
过去一年	1.62%	0.98%	16.09%	1.25%	-14.47%	-0.27%
自基金合同生效起至今	1.62%	0.98%	18.15%	1.25%	-16.53%	-0.27%

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



注：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	2020-06-30	-	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。
--	--	--	--	--

- 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，跟踪指数收益表现，通过运用定量分析等技术，分析和应对导致基金跟踪误差的因素，努力将基金的跟踪误差控制在较低水平。

##### 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1.0162元，本报告期内，基金份额净值增长率为7.07%，同期业绩比较基准收益率为6.93%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前新冠疫情依旧在困扰全球经济，全球各国政府为应对新冠疫情而推出的经济刺激计划短期难言退出。对金融市场而言，这意味着利率水平有可能会较长时间都维持在低位。7月下旬开始，大宗商品价格明显下跌，利率上行的概率进一步降低。低利率环境利好股票市场，我们预计下半年A股依旧会维持震荡上行的趋势。A股市场从5月开始出现了极端偏向成长的分化行情，以新能源汽车、半导体和部分医药板块为代表的成长股大幅上涨的同时，金融和消费白马出现大幅调整。我们认为下半年A股市场的风格会更加均衡。在成长股依旧能够提供足够弹性的同时，消费股等长周期核心资产依旧是长线资金的配置重点。

#### 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

根据《基金合同》，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

本报告期没有应分配但尚未分配的利润。

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

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

## § 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”部分未在本托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 中期财务会计报告(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：兴业中证500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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	2,863,925.73	1,975,267.98
结算备付金		27,185.39	37,698.59
存出保证金		13,538.34	92,816.83
交易性金融资产	6.4.7.2	46,115,112.05	148,182,270.47
其中：股票投资		46,115,112.05	148,182,270.47
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		2,516,942.52	-
应收利息	6.4.7.5	228.79	277.51
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		51,536,932.82	150,288,331.38
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年06月30日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,156,524.78	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		48,372.79	63,541.64
应付托管费		9,674.56	12,708.35
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	76,799.35	30,695.41
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	1,408,234.97	165,000.00
负债合计		2,699,606.45	271,945.40
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	48,060,583.00	158,060,583.00
未分配利润	6.4.7.10	776,743.37	-8,044,197.02
所有者权益合计		48,837,326.37	150,016,385.98
负债和所有者权益总计		51,536,932.82	150,288,331.38

注：1. 报告截止日2021年06月30日，基金份额净值1.0162元，基金份额总额48,060,583.00份。

2. 本基金合同于2020年6月30日生效，上年度可比期间不是完整报告期，按实际存续期计算。

## 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：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06月30日	上年度可比期间 2020年06月30日（基金 合同生效日）至202 0年06月30日
----	-----	-----------------------------------	---

一、收入		10,145,103.34	-92,786.16
1. 利息收入		3,347.71	39,428.84
其中：存款利息收入	6.4.7.11	3,347.71	39,428.84
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）		4,350,805.16	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,352,113.69	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.13.	-	-
收益	2	-	-
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	998,691.47	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	5,517,665.69	-132,215.00
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	273,284.78	-
<b>减：二、费用</b>		738,154.23	702.70
1. 管理人报酬	6.4.10.2. 1	331,246.86	-
2. 托管费	6.4.10.2. 2	66,249.37	-
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	186,081.14	-

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	154,576.86	702.70
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		9,406,949.11	-93,488.86
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		9,406,949.11	-93,488.86

注：本基金合同于2020年6月30日生效，上年度可比期间不是完整报告期，按实际存续期计算。

### 6.3 所有者权益（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：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)	158,060,583.00	-8,044,197.02	150,016,385.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	9,406,949.11	9,406,949.11
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）	-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
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）	48,060,583.00	776,743.37	48,837,326.37
项 目	上年度可比期间 2020年06月30日（基金合同生效日）至2020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）	218,060,583.00	-	218,060,583.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-93,488.86	-93,488.86
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	218,060,583.00	-93,488.86	217,967,094.14

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%,年跟踪误差不得超过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06月30日的财务状况以及2021年01月01日(基金合同生效日)至2021年06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

本基金本报告期间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	2,863,925.73
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	2,863,925.73

##### 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	45,976,146.26	46,115,112.05	138,965.79
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	45,976,146.26	46,115,112.05	138,965.79

#### 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 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	210.49
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	12.20
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	6.10
合计	228.79

#### 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	76,799.35
银行间市场应付交易费用	-
合计	76,799.35

#### 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	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
应退替代款	1,288,932.41
合计	1,408,234.97

#### 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	158,060,583.00	158,060,583.00
本期申购	2,500,000.00	2,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-112,500,000.00	-112,500,000.00
本期末	48,060,583.00	48,060,583.00

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。

#### 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	-3,575,536.57	-4,468,660.45	-8,044,197.02
本期利润	3,889,283.42	5,517,665.69	9,406,949.11
本期基金份额交易产生的变动数	92,732.96	-678,741.68	-586,008.72
其中：基金申购款	-63,387.99	-181,095.87	-244,483.86
基金赎回款	156,120.95	-497,645.81	-341,524.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	406,479.81	370,263.56	776,743.37

#### 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	2,579.44
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	406.34	
其他	361.93	
合计	3,347.71	

### 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	2,043,903.77
股票投资收益——赎回差价收入	1,308,209.92
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	3,352,113.69

#### 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	89,424,628.14
减：卖出股票成本总额	87,380,724.37
买卖股票差价收入	2,043,903.77

#### 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	112,841,524.86
减：现金支付赎回款总额	61,807,492.86
减：赎回股票成本总额	49,725,822.08
赎回差价收入	1,308,209.92

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

#### 6.4.7.13.2 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。



#### 6.4.7.14 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。

#### 6.4.7.15 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	998,691.47
基金投资产生的股利收益	-
合计	998,691.47

#### 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	5,517,665.69
——股票投资	5,517,665.69
——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	5,517,665.69

#### 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	273,284.78
合计	273,284.78

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代股票的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

#### 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	186,081.14
银行间市场交易费用	-
合计	186,081.14

#### 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	274.30
其他费用_指数使用费	70,000.00
合计	154,576.86

#### 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
基金管理人控制的公司	基金管理人、基金销售机构
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

#### 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	上年度可比期间 2020年06月30日（基金合同 生效日）至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	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 2021年01月01日 至2021年06月30 日	上年度可比期间 2020年06月30日（基金合同 生效日）至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	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

本基金本报告期间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

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

	本期	上年度可比期间

关联方名称	2021年01月01日至2021年06月30日		2020年06月30日（基金合同生效日）至2020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	2,863,925.73	2,579.44	216,152,954.00	39,428.84

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

本基金本报告期间未发生其他关联方交易事项。

#### 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
600811	东方集团	2021-06-30	-	3.05	-	-	25,200	128,751.34	76,860.00	-

600	士 兰 微	202								
460		1-0	-	56.	-	-	6,300	117,052.4	355,005.0	-
		6-3		35				6	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公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金的交易所交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手，并完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。

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

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

截止本报告期末及上年度末，本基金无重大流动性风险。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	2,863,925.73	-	-	-	2,863,925.73
结算备付金	27,185.39	-	-	-	27,185.39
存出保证金	13,538.34	-	-	-	13,538.34
交易性金融资产	-	-	-	46,115,112.05	46,115,112.05
应收证券清算款	-	-	-	2,516,942.52	2,516,942.52
应收利息	-	-	-	228.79	228.79
资产总计	2,904,649.46	0.00	0.00	48,632,283.36	51,536,932.82
负债					
应付证券清算款	-	-	-	2,445,457.19	2,445,457.19



应付管理人报酬	-	-	-	48,372.79	48,372.79
应付托管费	-	-	-	9,674.56	9,674.56
应付交易费用	-	-	-	76,799.35	76,799.35
其他负债	-	-	-	119,302.56	119,302.56
负债总计	0.00	-	-	2,699,606.45	2,699,606.45
利率敏感度缺口	2,904,649.46	0.00	0.00	45,932,676.91	48,837,326.37
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	1,975,267.98	-	-	-	1,975,267.98
结算备付金	37,698.59	-	-	-	37,698.59
存出保证金	92,816.83	-	-	-	92,816.83
交易性金融资产	-	-	-	148,182,270.47	148,182,270.47
应收利息	-	-	-	277.51	277.51
资产总计	2,105,783.40	0.00	0.00	148,182,547.98	150,288,331.38
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	63,541.64	63,541.64
应付托管费	-	-	-	12,708.35	12,708.35
应付交易费用	-	-	-	30,695.41	30,695.41
其他负债	-	-	-	165,000.00	165,000.00
负债总计	0.00	-	-	271,945.40	271,945.40
利率敏感度缺口	2,105,783.40	0.00	0.00	147,910,602.58	150,016,385.98

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的影响不重大。

#### 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	46,115,112.05	94.43	148,182,270.47	98.78
交易性金融资产—基金投资	0.00	0.00	0.00	0.00
交易性金融资产—债券投资	0.00	-	0.00	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	0.00	-	0.00	-

合计	46,115,112.05	94.43	148,182,270.47	98.78
----	---------------	-------	----------------	-------

#### 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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	1、股票价格上升5%	2,305,755.60	7,409,113.52
	2、股票价格下降5%	-2,305,755.60	-7,409,113.52

#### 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	46,115,112.05	89.48
	其中：股票	46,115,112.05	89.48
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	2,891,111.12	5.61

8	其他各项资产	2,530,709.65	4.91
9	合计	51,536,932.82	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	425,250.00	0.87
B	采矿业	1,642,150.20	3.36
C	制造业	29,305,651.95	60.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,086,065.65	2.22
E	建筑业	833,562.00	1.71
F	批发和零售业	1,628,260.80	3.33
G	交通运输、仓储和邮政业	885,426.40	1.81
H	住宿和餐饮业	290,916.00	0.60
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,622,491.65	7.42
J	金融业	2,686,461.90	5.50
K	房地产业	1,495,206.00	3.06
L	租赁和商务服务业	613,206.00	1.26
M	科学研究和技术服务业	136,296.00	0.28
N	水利、环境和公共设施管理业	416,106.00	0.85
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	37,628.80	0.08
Q	卫生和社会工作	137,880.00	0.28
R	文化、体育和娱乐业	462,132.00	0.95
S	综合	410,420.70	0.84
	合计	46,115,112.05	94.43

## 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	000799	酒鬼酒	1,800	460,080.00	0.94
2	603486	科沃斯	1,800	410,544.00	0.84
3	002709	天赐材料	3,690	393,280.20	0.81
4	000009	中国宝安	19,810	361,928.70	0.74
5	600460	士兰微	6,300	355,005.00	0.73
6	600089	特变电工	27,000	346,950.00	0.71
7	002340	格林美	36,000	336,600.00	0.69
8	603737	三棵树	1,860	327,360.00	0.67
9	002074	国轩高科	7,200	313,632.00	0.64
10	601233	桐昆股份	12,600	303,534.00	0.62
11	300207	欣旺达	9,000	293,040.00	0.60
12	600563	法拉电子	1,800	285,048.00	0.58
13	300316	晶盛机电	5,400	272,700.00	0.56
14	300285	国瓷材料	5,400	263,250.00	0.54
15	603893	瑞芯微	1,800	251,028.00	0.51
16	002185	华天科技	16,200	249,318.00	0.51
17	601127	小康股份	3,600	240,012.00	0.49
18	300146	汤臣倍健	7,200	236,880.00	0.49
19	601636	旗滨集团	12,600	233,856.00	0.48
20	600779	水井坊	1,800	227,430.00	0.47
21	600885	宏发股份	3,600	225,720.00	0.46
22	688099	晶晨股份	2,000	224,400.00	0.46

23	600733	北汽蓝谷	16,200	218,376.00	0.45
24	002648	卫星石化	5,420	212,409.80	0.43
25	600884	杉杉股份	9,000	209,880.00	0.43
26	002138	顺络电子	5,400	209,358.00	0.43
27	002223	鱼跃医疗	5,400	205,902.00	0.42
28	600754	锦江酒店	3,600	205,020.00	0.42
29	300253	卫宁健康	12,600	205,002.00	0.42
30	600486	扬农化工	1,800	201,186.00	0.41
31	688002	睿创微纳	2,000	199,660.00	0.41
32	600219	南山铝业	54,000	194,400.00	0.40
33	002625	光启技术	9,000	187,290.00	0.38
34	600704	物产中大	23,400	184,158.00	0.38
35	002444	巨星科技	5,400	184,032.00	0.38
36	300223	北京君正	1,800	181,656.00	0.37
37	300037	新宙邦	1,800	180,180.00	0.37
38	000513	丽珠集团	3,600	180,072.00	0.37
39	002797	第一创业	25,200	179,928.00	0.37
40	002422	科伦药业	9,000	179,550.00	0.37
41	002212	天融信	9,000	177,930.00	0.36
42	300474	景嘉微	1,800	176,256.00	0.36
43	688208	道通科技	2,000	173,980.00	0.36
44	002180	纳思达	5,400	173,880.00	0.36
45	601168	西部矿业	14,400	171,792.00	0.35
46	002385	大北农	25,200	171,360.00	0.35
46	000807	云铝股份	14,400	171,360.00	0.35
48	601099	太平洋	50,400	170,856.00	0.35
49	000547	航天发展	9,000	169,830.00	0.35
50	000988	华工科技	7,200	169,344.00	0.35
51	000830	鲁西化工	9,000	168,570.00	0.35
52	002078	太阳纸业	12,600	168,210.00	0.34
53	002028	思源电气	5,400	166,266.00	0.34

54	600862	中航高科	5,400	166,212.00	0.34
55	000636	风华高科	5,400	163,188.00	0.33
56	300001	特锐德	5,400	162,594.00	0.33
57	002353	杰瑞股份	3,600	160,920.00	0.33
58	601117	中国化学	18,000	157,680.00	0.32
59	600201	生物股份	9,000	157,050.00	0.32
60	002439	启明星辰	5,400	156,654.00	0.32
61	600392	盛和资源	9,000	156,240.00	0.32
62	002030	达安基因	7,160	152,078.40	0.31
63	000630	铜陵有色	55,800	151,776.00	0.31
64	300463	迈克生物	3,600	151,524.00	0.31
65	002250	联化科技	5,400	150,660.00	0.31
66	600549	厦门钨业	7,200	149,976.00	0.31
67	600739	辽宁成大	7,200	149,832.00	0.31
68	002511	中顺洁柔	5,400	148,770.00	0.30
69	300088	长信科技	18,000	148,680.00	0.30
70	600068	葛洲坝	19,800	148,302.00	0.30
71	002075	沙钢股份	13,300	145,103.00	0.30
72	002013	中航机电	14,400	145,008.00	0.30
73	600177	雅戈尔	21,600	142,344.00	0.29
74	300618	寒锐钴业	1,800	141,912.00	0.29
75	601997	贵阳银行	19,800	141,768.00	0.29
76	002080	中材科技	5,400	141,318.00	0.29
77	002127	南极电商	14,400	140,688.00	0.29
78	300308	中际旭创	3,600	138,672.00	0.28
79	600316	洪都航空	3,600	138,528.00	0.28
80	603260	合盛硅业	1,800	138,438.00	0.28
81	300244	迪安诊断	3,600	137,880.00	0.28
82	600699	均胜电子	5,400	137,808.00	0.28
82	000021	深科技	7,200	137,808.00	0.28
84	300699	光威复材	1,800	136,710.00	0.28

85	002465	海格通信	14,400	136,224.00	0.28
86	002507	涪陵榨菜	3,600	135,576.00	0.28
87	600988	赤峰黄金	9,000	134,910.00	0.28
88	600066	宇通客车	10,800	134,892.00	0.28
89	601689	拓普集团	3,600	134,748.00	0.28
90	000983	山西焦煤	16,200	134,622.00	0.28
91	601005	重庆钢铁	50,400	134,568.00	0.28
92	300009	安科生物	9,020	134,398.00	0.28
93	600418	江淮汽车	10,800	134,244.00	0.27
94	600516	方大炭素	18,000	133,920.00	0.27
95	600637	东方明珠	16,200	132,678.00	0.27
96	002273	水晶光电	9,000	132,210.00	0.27
97	300168	万达信息	9,000	131,400.00	0.27
98	000039	中集集团	7,200	130,896.00	0.27
99	002572	索菲亚	5,400	130,680.00	0.27
100	002156	通富微电	5,400	129,816.00	0.27
101	002092	中泰化学	12,600	129,402.00	0.26
102	600867	通化东宝	10,800	128,952.00	0.26
102	002299	圣农发展	5,400	128,952.00	0.26
104	000050	深天马 A	9,000	127,620.00	0.26
105	600380	健康元	9,000	123,570.00	0.25
106	600487	亨通光电	10,800	123,120.00	0.25
107	601128	常熟银行	19,800	122,760.00	0.25
108	600369	西南证券	25,200	122,724.00	0.25
109	000723	美锦能源	16,200	122,472.00	0.25
110	600529	山东药玻	3,600	122,220.00	0.25
111	000750	国海证券	28,800	122,112.00	0.25
112	603589	口子窖	1,800	121,842.00	0.25
113	600879	航天电子	16,200	121,824.00	0.25
114	002926	华西证券	12,600	121,338.00	0.25
114	000825	太钢不锈	16,200	121,338.00	0.25



116	600909	华安证券	21,590	120,256.30	0.25
117	002373	千方科技	7,200	120,240.00	0.25
118	000975	银泰黄金	12,620	120,016.20	0.25
119	600511	国药股份	3,600	119,016.00	0.24
120	000932	华菱钢铁	18,000	118,800.00	0.24
121	002294	信立泰	3,600	118,440.00	0.24
122	300070	碧水源	16,200	118,422.00	0.24
123	601198	东兴证券	10,800	118,044.00	0.24
124	600166	福田汽车	34,200	117,990.00	0.24
125	002131	利欧股份	50,400	117,936.00	0.24
126	600271	航天信息	9,000	117,270.00	0.24
126	002152	广电运通	9,000	117,270.00	0.24
128	300482	万孚生物	1,810	117,088.90	0.24
129	002382	蓝帆医疗	5,607	116,905.95	0.24
130	601615	明阳智能	7,200	116,568.00	0.24
131	000998	隆平高科	7,200	115,488.00	0.24
132	300357	我武生物	1,800	115,416.00	0.24
132	000960	锡业股份	7,200	115,416.00	0.24
134	601866	中远海发	30,600	114,750.00	0.23
135	002065	东华软件	14,400	114,192.00	0.23
136	300296	利亚德	14,400	112,608.00	0.23
137	603866	桃李面包	3,580	111,696.00	0.23
138	002372	伟星新材	5,400	111,618.00	0.23
139	000623	吉林敖东	7,200	111,528.00	0.23
140	688088	虹软科技	2,000	111,500.00	0.23
141	300115	长盈精密	5,400	111,240.00	0.23
142	600998	九州通	7,200	110,664.00	0.23
143	600188	兖州煤业	7,200	110,592.00	0.23
143	000012	南玻 A	10,800	110,592.00	0.23
145	600642	申能股份	18,000	110,520.00	0.23
146	600171	上海贝岭	3,600	109,548.00	0.22

147	600827	百联股份	5,400	108,810.00	0.22
148	002500	山西证券	16,200	108,702.00	0.22
149	600315	上海家化	1,800	108,252.00	0.22
150	002831	裕同科技	3,600	106,884.00	0.22
151	600535	天士力	7,200	106,632.00	0.22
152	601699	潞安环能	9,000	106,290.00	0.22
153	000739	普洛药业	3,600	105,840.00	0.22
154	002603	以岭药业	3,600	104,976.00	0.21
155	600859	王府井	3,600	103,968.00	0.21
156	300383	光环新网	7,200	103,608.00	0.21
157	603156	养元饮品	3,600	102,888.00	0.21
158	300271	华宇软件	5,337	102,737.25	0.21
159	002670	国盛金控	9,000	102,510.00	0.21
160	600536	中国软件	1,800	102,474.00	0.21
161	600153	建发股份	12,600	102,060.00	0.21
162	600415	小商品城	19,800	101,970.00	0.21
163	600256	广汇能源	30,600	101,898.00	0.21
164	600141	兴发集团	5,400	101,682.00	0.21
165	600707	彩虹股份	10,800	101,628.00	0.21
166	600497	XD驰宏锌	23,400	100,854.00	0.21
167	600498	烽火通信	5,400	100,602.00	0.21
168	002690	美亚光电	1,800	100,368.00	0.21
169	002683	宏大爆破	3,600	99,972.00	0.20
170	000027	深圳能源	10,800	99,036.00	0.20
171	600875	东方电气	9,000	98,730.00	0.20
172	600895	张江高科	5,400	98,658.00	0.20
173	002221	东华能源	9,000	98,550.00	0.20
174	600208	新湖中宝	32,400	98,496.00	0.20
175	600667	太极实业	10,800	98,280.00	0.20
176	600008	首创环保	32,490	97,794.90	0.20
177	300251	光线传媒	9,000	97,290.00	0.20

178	600390	五矿资本	16,200	96,876.00	0.20
179	300741	华宝股份	1,900	96,368.00	0.20
180	600155	华创阳安	9,000	96,300.00	0.20
180	000999	华润三九	3,600	96,300.00	0.20
182	002595	豪迈科技	3,600	96,120.00	0.20
183	300024	机器人	9,000	96,030.00	0.20
184	600663	陆家嘴	7,200	95,904.00	0.20
185	600160	巨化股份	10,800	95,472.00	0.20
186	300212	易华录	3,540	95,261.40	0.20
187	600038	XD中直股	1,800	94,932.00	0.19
188	600801	华新水泥	5,400	94,878.00	0.19
189	600170	上海建工	34,200	94,392.00	0.19
190	300630	普利制药	1,800	94,320.00	0.19
190	002390	信邦制药	9,000	94,320.00	0.19
192	002506	协鑫集成	27,000	93,960.00	0.19
193	002019	亿帆医药	5,400	93,150.00	0.19
194	002174	游族网络	5,400	92,718.00	0.19
195	603883	XD老百姓	1,760	92,716.80	0.19
196	002966	苏州银行	12,600	92,610.00	0.19
197	002958	青农商行	21,600	92,448.00	0.19
198	688321	微芯生物	2,000	92,380.00	0.19
199	000878	云南铜业	7,200	92,376.00	0.19
200	002146	荣盛发展	16,200	91,368.00	0.19
201	600060	海信视像	5,400	91,260.00	0.19
201	000686	东北证券	10,800	91,260.00	0.19
203	600409	三友化工	9,000	90,990.00	0.19
204	000997	新大陆	5,400	89,586.00	0.18
205	000718	苏宁环球	10,800	89,532.00	0.18
206	002408	齐翔腾达	7,200	89,424.00	0.18
207	600372	中航电子	5,400	89,370.00	0.18
208	000401	冀东水泥	7,200	88,920.00	0.18

209	002281	光迅科技	3,600	88,560.00	0.18
210	300418	昆仑万维	5,400	88,452.00	0.18
211	002195	二三四五	43,200	87,696.00	0.18
212	600528	XD中铁工	10,800	87,480.00	0.18
213	002429	兆驰股份	14,400	87,408.00	0.18
214	300058	蓝色光标	14,400	87,120.00	0.18
215	600027	华电国际	25,200	86,688.00	0.18
216	603650	彤程新材	1,800	86,580.00	0.18
217	600216	浙江医药	5,400	86,454.00	0.18
218	600258	首旅酒店	3,600	85,896.00	0.18
219	002081	金螳螂	10,800	85,536.00	0.18
220	000961	中南建设	14,400	85,248.00	0.17
221	600325	华发股份	12,600	84,924.00	0.17
222	600500	中化国际	10,800	84,888.00	0.17
223	300017	网宿科技	14,400	84,240.00	0.17
223	000671	阳光城	16,200	84,240.00	0.17
225	300315	掌趣科技	19,800	84,150.00	0.17
226	601717	郑煤机	7,200	83,736.00	0.17
227	000540	中天金融	30,600	83,538.00	0.17
228	600282	南钢股份	23,400	83,304.00	0.17
229	002010	传化智联	10,800	83,268.00	0.17
230	000158	常山北明	7,200	82,728.00	0.17
231	600645	中源协和	3,600	82,620.00	0.17
232	603077	和邦生物	39,600	82,368.00	0.17
233	601992	金隅集团	30,600	82,314.00	0.17
234	603568	伟明环保	3,600	82,188.00	0.17
235	600765	中航重机	3,600	81,540.00	0.17
236	000060	中金岭南	18,000	81,360.00	0.17
237	000930	中粮科技	9,000	81,090.00	0.17
238	603858	步长制药	3,600	80,964.00	0.17
239	300182	捷成股份	16,200	80,838.00	0.17

240	601016	节能风电	21,600	80,784.00	0.17
240	600598	北大荒	5,400	80,784.00	0.17
242	600567	山鹰国际	23,400	80,730.00	0.17
243	601577	长沙银行	9,000	80,460.00	0.16
244	000898	鞍钢股份	18,000	80,100.00	0.16
245	600728	佳都科技	10,800	80,028.00	0.16
246	603198	迎驾贡酒	1,800	79,740.00	0.16
247	603638	艾迪精密	1,860	79,738.20	0.16
248	000709	河钢股份	32,400	79,704.00	0.16
249	600839	四川长虹	27,000	78,570.00	0.16
250	002004	华邦健康	12,600	78,246.00	0.16
251	000729	燕京啤酒	10,800	78,192.00	0.16
252	600597	光明乳业	5,400	77,814.00	0.16
253	002557	洽洽食品	1,800	77,580.00	0.16
254	603927	中科软	1,800	77,310.00	0.16
255	600808	马钢股份	18,000	77,220.00	0.16
256	600811	东方集团	25,200	76,860.00	0.16
256	002396	星网锐捷	3,600	76,860.00	0.16
258	002203	海亮股份	7,200	76,608.00	0.16
258	002191	劲嘉股份	7,200	76,608.00	0.16
260	600820	隧道股份	14,400	76,176.00	0.16
261	002124	天邦股份	10,760	75,427.60	0.15
262	600732	爱旭股份	5,400	75,168.00	0.15
263	603707	健友股份	1,800	75,150.00	0.15
264	002387	维信诺	7,200	75,096.00	0.15
265	000738	航发控制	3,600	74,988.00	0.15
265	000581	威孚高科	3,600	74,988.00	0.15
267	000629	攀钢钒钛	32,400	74,196.00	0.15
268	600755	厦门国贸	9,000	73,890.00	0.15
269	603225	新凤鸣	3,612	73,323.60	0.15
270	000488	晨鸣纸业	9,000	73,260.00	0.15

271	600967	内蒙一机	7,200	72,864.00	0.15
272	002745	木林森	5,400	72,360.00	0.15
273	002368	太极股份	3,600	72,216.00	0.15
274	600737	中粮糖业	7,200	72,072.00	0.15
275	600580	卧龙电驱	5,400	71,820.00	0.15
276	600022	山东钢铁	41,400	71,208.00	0.15
277	002002	鸿达兴业	18,000	70,740.00	0.14
278	000869	张裕A	1,900	70,566.00	0.14
279	600718	东软集团	7,200	70,416.00	0.14
280	000877	天山股份	5,400	70,362.00	0.14
281	600782	新钢股份	12,600	70,308.00	0.14
282	002056	横店东磁	5,400	70,200.00	0.14
282	002048	宁波华翔	3,600	70,200.00	0.14
284	002867	周大生	3,550	70,183.50	0.14
285	002268	卫士通	3,600	70,128.00	0.14
286	600410	华胜天成	9,000	69,840.00	0.14
286	300002	神州泰岳	14,400	69,840.00	0.14
288	600037	歌华有线	7,200	69,192.00	0.14
289	000970	中科三环	7,200	68,760.00	0.14
290	000990	诚志股份	5,400	68,742.00	0.14
291	002925	盈趣科技	1,760	68,481.60	0.14
292	000400	许继电气	5,400	68,364.00	0.14
293	000028	国药一致	1,800	68,112.00	0.14
294	601880	辽港股份	39,600	67,716.00	0.14
294	600039	四川路桥	10,800	67,716.00	0.14
296	601106	中国一重	19,800	67,122.00	0.14
297	000778	新兴铸管	18,000	66,960.00	0.14
298	600064	南京高科	7,200	66,888.00	0.14
299	600348	华阳股份	9,000	66,780.00	0.14
300	601179	中国西电	16,200	66,744.00	0.14
300	300166	东方国信	5,400	66,744.00	0.14

302	600881	亚泰集团	23,400	66,690.00	0.14
303	600026	中远海能	10,800	66,528.00	0.14
304	002249	大洋电机	12,600	66,150.00	0.14
305	000883	湖北能源	14,400	66,096.00	0.14
306	600970	中材国际	7,200	66,024.00	0.14
307	600985	淮北矿业	5,400	65,934.00	0.14
308	000598	兴蓉环境	12,600	65,646.00	0.13
309	000887	中鼎股份	5,400	65,232.00	0.13
310	600398	海澜之家	9,000	65,160.00	0.13
311	603712	七一二	1,800	64,980.00	0.13
312	002701	奥瑞金	12,600	64,764.00	0.13
313	601200	上海环境	5,400	64,638.00	0.13
313	600126	杭钢股份	12,600	64,638.00	0.13
315	600195	中牧股份	5,400	64,584.00	0.13
316	002563	森马服饰	5,400	64,530.00	0.13
317	000690	宝新能源	12,600	64,386.00	0.13
318	600167	联美控股	7,200	64,296.00	0.13
319	601118	海南橡胶	12,600	64,134.00	0.13
320	600572	康恩贝	14,400	63,936.00	0.13
320	600260	凯乐科技	7,200	63,936.00	0.13
322	601598	中国外运	12,600	63,630.00	0.13
323	002266	浙富控股	12,600	62,874.00	0.13
324	600908	无锡银行	10,800	62,640.00	0.13
325	300072	三聚环保	10,800	61,992.00	0.13
326	603000	人民网	3,600	61,884.00	0.13
326	002183	怡亚通	10,800	61,884.00	0.13
328	001914	招商积余	3,600	61,848.00	0.13
329	600158	中体产业	5,400	61,614.00	0.13
330	600517	国网英大	9,000	61,290.00	0.13
331	300026	红日药业	14,400	61,200.00	0.13
332	600259	广晟有色	1,800	60,858.00	0.12

333	000402	金融街	9,000	60,750.00	0.12
334	002110	三钢闽光	9,000	60,660.00	0.12
335	002085	万丰奥威	10,800	60,480.00	0.12
336	600803	新奥股份	3,625	59,848.75	0.12
337	000528	柳工	7,200	59,040.00	0.12
338	000685	中山公用	7,200	58,752.00	0.12
339	002242	九阳股份	1,800	58,482.00	0.12
340	300376	易事特	7,200	57,888.00	0.12
340	000519	中兵红箭	5,400	57,888.00	0.12
342	002399	海普瑞	3,600	57,348.00	0.12
343	600435	北方导航	7,200	57,168.00	0.12
344	002038	双鹭药业	5,400	56,862.00	0.12
345	002128	露天煤业	5,400	56,214.00	0.12
346	000089	深圳机场	7,200	55,944.00	0.11
347	601718	际华集团	19,800	55,836.00	0.11
348	002233	塔牌集团	5,400	55,512.00	0.11
349	601456	国联证券	3,600	55,440.00	0.11
350	003022	联泓新科	1,800	55,260.00	0.11
351	603885	吉祥航空	3,600	54,936.00	0.11
352	600307	酒钢宏兴	23,400	54,288.00	0.11
353	002416	爱施德	5,400	54,162.00	0.11
354	601975	招商南油	25,200	53,928.00	0.11
355	003035	南网能源	5,400	53,676.00	0.11
356	600120	浙江东方	12,520	53,585.60	0.11
357	601333	广深铁路	25,200	53,424.00	0.11
358	300133	华策影视	9,000	53,280.00	0.11
359	600373	中文传媒	5,400	53,244.00	0.11
360	600648	外高桥	3,600	53,208.00	0.11
361	002505	鹏都农牧	23,400	52,416.00	0.11
362	601860	紫金银行	14,400	52,272.00	0.11
362	600804	鹏博士	10,800	52,272.00	0.11



364	601000	唐山港	21,600	52,056.00	0.11
365	600446	金证股份	3,600	51,984.00	0.11
366	300257	开山股份	3,600	51,732.00	0.11
367	000758	中色股份	10,800	51,300.00	0.11
368	603317	天味食品	1,740	51,208.20	0.10
369	600266	城建发展	10,800	51,192.00	0.10
370	600764	中国海防	1,800	50,940.00	0.10
371	000959	首钢股份	9,000	50,580.00	0.10
372	600329	中新药业	1,800	50,562.00	0.10
373	600376	首开股份	9,000	50,400.00	0.10
374	600928	西安银行	10,800	50,328.00	0.10
375	600643	爱建集团	7,200	50,256.00	0.10
376	000090	天健集团	9,000	49,770.00	0.10
377	000967	盈峰环境	7,200	49,464.00	0.10
378	600729	重庆百货	1,800	49,410.00	0.10
379	600582	天地科技	12,600	49,140.00	0.10
380	002839	张家港行	9,000	48,960.00	0.10
381	600507	方大特钢	7,200	48,816.00	0.10
382	600673	东阳光	10,800	48,492.00	0.10
383	002440	闰土股份	5,400	47,790.00	0.10
383	000559	万向钱潮	9,000	47,790.00	0.10
385	600131	国网信通	3,600	47,664.00	0.10
386	601098	中南传媒	5,400	47,628.00	0.10
387	601991	大唐发电	18,000	47,520.00	0.10
388	600094	大名城	12,600	47,502.00	0.10
389	002705	新宝股份	1,800	47,250.00	0.10
390	603228	景旺电子	1,800	47,160.00	0.10
391	601608	中信重工	12,600	47,124.00	0.10
392	600901	江苏租赁	9,000	46,800.00	0.10
393	601958	金钼股份	7,200	46,656.00	0.10
394	300113	顺网科技	3,600	46,584.00	0.10

395	000681	视觉中国	3,600	46,548.00	0.10
396	002317	众生药业	5,400	46,494.00	0.10
397	000563	陕国投 A	14,400	46,368.00	0.09
398	002936	郑州银行	12,600	46,242.00	0.09
399	603515	欧普照明	1,800	46,206.00	0.09
400	600388	龙净环保	5,400	46,008.00	0.09
401	600776	东方通信	3,600	44,640.00	0.09
402	300180	华峰超纤	9,000	44,550.00	0.09
403	600959	江苏有线	14,400	43,920.00	0.09
404	601869	长飞光纤	1,800	43,848.00	0.09
405	002434	万里扬	5,400	43,794.00	0.09
406	600056	中国医药	3,600	43,740.00	0.09
407	000415	渤海租赁	18,000	43,560.00	0.09
408	601828	美凯龙	3,600	43,200.00	0.09
409	600062	华润双鹤	3,600	42,876.00	0.09
410	600649	城投控股	9,000	42,840.00	0.09
411	002375	亚厦股份	5,400	42,768.00	0.09
412	600717	天津港	10,820	42,414.40	0.09
413	600095	湘财股份	3,600	42,156.00	0.09
414	000501	鄂武商 A	3,600	42,120.00	0.09
415	600863	内蒙华电	18,000	41,940.00	0.09
416	601969	海南矿业	3,600	41,868.00	0.09
417	002155	湖南黄金	5,400	41,850.00	0.09
418	000717	韶钢松山	9,000	41,310.00	0.08
419	002468	申通快递	5,400	41,148.00	0.08
420	000078	海王生物	12,600	41,076.00	0.08
421	002424	贵州百灵	5,400	39,744.00	0.08
422	600006	东风汽车	5,400	39,420.00	0.08
423	601611	中国核建	5,400	38,988.00	0.08
424	600633	浙数文化	5,400	38,772.00	0.08
424	600546	山煤国际	5,400	38,772.00	0.08

426	002653	海思科	1,800	38,736.00	0.08
427	601928	凤凰传媒	5,400	38,556.00	0.08
428	000826	启迪环境	7,200	38,520.00	0.08
429	600787	中储股份	7,200	38,376.00	0.08
430	603888	新华网	1,800	38,106.00	0.08
431	600556	天下秀	3,600	38,016.00	0.08
432	002244	滨江集团	9,000	37,710.00	0.08
433	603377	东方时尚	3,520	37,628.80	0.08
434	600021	上海电力	5,400	37,314.00	0.08
435	600968	海油发展	14,400	37,296.00	0.08
436	600823	世茂股份	9,000	36,360.00	0.07
437	002583	海能达	7,200	36,288.00	0.07
438	002458	益生股份	3,600	35,892.00	0.07
439	600339	中油工程	12,600	35,784.00	0.07
440	600377	宁沪高速	3,600	35,136.00	0.07
441	603379	三美股份	1,800	33,678.00	0.07
442	601298	青岛港	5,400	33,372.00	0.07
442	000553	安道麦A	3,600	33,372.00	0.07
444	600350	山东高速	5,400	33,210.00	0.07
445	000813	德展健康	7,200	32,688.00	0.07
446	000031	大悦城	9,000	32,400.00	0.07
447	600566	济川药业	1,800	32,220.00	0.07
448	600466	蓝光发展	10,800	31,860.00	0.07
449	600623	华谊集团	3,600	31,716.00	0.06
450	600312	平高电气	5,400	31,536.00	0.06
451	603708	家家悦	1,800	31,266.00	0.06
452	601568	北元集团	3,600	30,816.00	0.06
453	001872	招商港口	1,800	30,456.00	0.06
454	000062	深圳华强	1,800	30,438.00	0.06
455	002532	天山铝业	3,600	30,204.00	0.06
456	300010	豆神教育	5,300	30,051.00	0.06

457	000061	农产品	5,400	29,808.00	0.06
458	601778	晶科科技	5,400	29,484.00	0.06
459	600835	上海机电	1,800	29,250.00	0.06
460	000046	泛海控股	12,600	28,980.00	0.06
461	601228	广州港	9,000	28,620.00	0.06
462	002302	西部建设	3,600	28,440.00	0.06
463	600871	石化油服	14,400	28,368.00	0.06
464	000937	冀中能源	7,200	28,296.00	0.06
465	000156	华数传媒	3,600	27,756.00	0.06
466	002946	新乳业	1,800	27,270.00	0.06
467	002948	青岛银行	5,400	26,838.00	0.05
468	002635	安洁科技	1,800	26,334.00	0.05
469	600657	信达地产	7,200	25,056.00	0.05
470	600639	浦东金桥	1,800	24,570.00	0.05
471	601139	深圳燃气	3,600	23,616.00	0.05
471	002419	天虹股份	3,600	23,616.00	0.05
473	002815	崇达技术	1,800	22,464.00	0.05
474	600640	号百控股	1,800	21,942.00	0.04
475	002818	富森美	1,800	21,708.00	0.04
476	601003	柳钢股份	3,600	21,240.00	0.04
477	600956	新天绿能	1,800	21,078.00	0.04
478	603056	德邦股份	1,800	19,782.00	0.04
479	000537	广宇发展	3,600	18,828.00	0.04
480	601512	中新集团	1,800	17,928.00	0.04
481	601187	厦门银行	1,800	17,064.00	0.03
482	601801	皖新传媒	3,600	16,992.00	0.03
483	600903	贵州燃气	1,800	16,560.00	0.03
484	603256	宏和科技	1,800	16,452.00	0.03
485	002423	中粮资本	1,800	16,290.00	0.03
486	000732	泰禾集团	7,200	15,552.00	0.03
487	600917	重庆燃气	1,800	14,706.00	0.03

488	601068	中铝国际	1,800	6,210.00	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

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	000799	酒鬼酒	1,236,167.00	0.82
2	601636	旗滨集团	648,789.00	0.43
3	300253	卫宁健康	591,870.00	0.39
4	300037	新宙邦	581,213.00	0.39
5	002422	科伦药业	525,248.00	0.35
6	002439	启明星辰	496,181.00	0.33
7	300308	中际旭创	482,852.00	0.32
8	600177	雅戈尔	463,049.00	0.31
9	600988	赤峰黄金	436,757.00	0.29
10	600068	葛洲坝	416,573.00	0.28
11	600536	中国软件	416,207.00	0.28
12	002180	纳思达	414,099.00	0.28
13	600066	宇通客车	407,817.00	0.27
14	002127	南极电商	403,535.00	0.27
15	600637	东方明珠	401,153.00	0.27
16	600563	法拉电子	385,491.00	0.26
17	600369	西南证券	375,153.00	0.25
18	601117	中国化学	366,640.00	0.24
19	600487	亨通光电	365,914.00	0.24
20	300383	光环新网	359,597.00	0.24

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	300274	阳光电源	2,623,976.00	1.75
2	300012	华测检测	1,400,471.00	0.93
3	300595	欧普康视	1,114,235.00	0.74
4	300496	中科创达	1,103,275.84	0.74
5	600426	华鲁恒升	1,059,997.00	0.71
6	002709	天赐材料	1,047,205.00	0.70
7	600132	重庆啤酒	941,396.00	0.63
8	000799	酒鬼酒	869,689.00	0.58
9	603882	金域医学	865,342.00	0.58
10	002340	格林美	831,969.00	0.55
11	600143	金发科技	789,373.00	0.53
12	002568	百润股份	769,081.80	0.51
13	300285	国瓷材料	749,684.00	0.50
14	603806	福斯特	748,834.00	0.50
15	002074	国轩高科	747,405.00	0.50
16	000009	中国宝安	743,051.00	0.50
17	300207	欣旺达	682,790.00	0.46
18	603444	吉比特	655,113.00	0.44
19	601966	玲珑轮胎	647,811.00	0.43
20	600079	人福医药	635,954.00	0.42

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	28,494,835.34
卖出股票收入（成交）总额	89,424,628.14

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 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 国轩高科2020年10月30日收到证监会整改报告以及董事长收到深圳证券交易所通报批评处分，其余前十名发行主体未被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚。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	13,538.34
2	应收证券清算款	2,516,942.52
3	应收股利	-
4	应收利息	228.79
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,530,709.65

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净	流通受限情况说明



				值比例 (%)	
1	600460	士兰微	355,005.00	0.73	停牌

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
791	60,759.27	22,543,383.00	46.9062%	25,517,200.00	53.0938%

### 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	22,423,144.00	46.66%
2	许安澜	1,100,000.00	2.29%
3	许梅蓉	1,060,000.00	2.21%
4	诸世昂	1,000,000.00	2.08%
5	黄洪萍	597,000.00	1.24%
6	郭顺发	520,200.00	1.08%
7	胡欣	500,000.00	1.04%

8	高芸	500,000.00	1.04%
9	宋淑英	500,000.00	1.04%
10	钱中明	497,255.00	1.03%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年06月30日)基金份额总额	218,060,583.00
本报告期期初基金份额总额	158,060,583.00
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	112,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	48,060,583.00

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

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

本报告期内本基金管理人和托管人托管业务部门及其相关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	91,802,137.16	77.89%	67,136.15	77.89%	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	26,064,003.12	22.11%	19,060.80	22.11%	-

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	-	-	-	-	-

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构处罚。
- 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，本期未新增及剔除券商交易单元。

## 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	兴业中证500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	兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同	中国证监会规定的媒介	2021-03-26
5	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	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	100,008,444.00	0.00	77,585,300.00	22,423,144.00	46.66%
产品特有风险							
<p>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。</p>							

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，兴业中证500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《兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）（2021年第1号）》及《兴业中证500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  
二〇二一年八月三十一日