
兴业中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人:兴业基金管理有限公司

基金托管人:中国银行股份有限公司

送出日期:2022 年 03 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年3月28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。

本报告期自2021年1月1日起至2021年12月31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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9 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	13
§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	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	22
§8 投资组合报告	46
8.1 期末基金资产组合情况	46
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	65
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	67
8.6 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	67
8.7 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	67
8.8 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	67
8.9 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	67
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	68

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	68
8.12 投资组合报告附注	68
§9 基金份额持有人信息	69
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
9.2 期末上市基金前十名持有人	69
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	70
9.4 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	70
§10 开放式基金份额变动	70
§11 重大事件揭示	70
11.1 基金份额持有人大会决议	70
11.2 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	71
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	71
11.4 基金投资策略的改变	71
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	71
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	71
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	71
11.8 其他重大事件	73
§12 影响投资者决策的其他重要信息	75
12.1 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	75
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	75
§13 备查文件目录	76
13.1 备查文件目录	76
13.2 存放地点	76
13.3 查阅方式	76

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	兴业中证500ETF（证券简称：兴业500；扩位证券简称：兴业中证500ETF）
场内简称	兴业中证500ETF（证券简称：兴业500；扩位证券简称：兴业中证500ETF）
基金主代码	510570
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020年06月30日
基金管理人	兴业基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	10,560,583.00份
基金合同存续期	不定期
上市日期	2020-08-12

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	胡斌
	联系电话	021-22211888
	电子邮箱	zhaoyue@cib-fund.com.cn
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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cib-fund.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市延安东路222号外滩中心30楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2021年	2020年06月30日（基金合同生效日）-2020年12月31日
本期已实现收益	5,348,130.76	-3,902,499.74
本期利润	10,969,465.91	-9,281,199.64
加权平均基金份额本期利润	0.1441	-0.0518
本期加权平均净值利润率	14.81%	-5.36%
本期基金份额净值增长率	14.33%	-5.09%
3.1.2 期末数据和指标	2021年末	2020年末
期末可供分配利润	898,996.80	-8,044,197.02
期末可供分配基金份额利润	0.0851	-0.0509
期末基金资产净值	11,459,579.80	150,016,385.98
期末基金份额净值	1.0851	0.9491
3.1.3 累计期末指标	2021年末	2020年末
基金份额累计净值增长率	8.51%	-5.09%

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	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益	①-③	②-④

		准差②	率③	率标准差 ④		
过去三个月	2.62%	0.71%	3.60%	0.76%	-0.98%	-0.05%
过去六个月	6.78%	0.90%	8.10%	0.96%	-1.32%	-0.06%
过去一年	14.33%	0.94%	15.58%	0.97%	-1.25%	-0.03%
自基金合同 生效起至今	8.51%	0.95%	27.71%	1.16%	-19.2 0%	-0.21%

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



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



本基金基金合同于2020年6月30日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 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12月31日，兴业基金共管理79只公募基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
那赛男	基金经理	2020-06-30	-	12年	中国籍，硕士学位，具有证券投资基金从业资格。2009年8月至2013年3月在博时基金管理有限公司ETF及量化投资部担任投资分析员；2013年4月至2015年6月在长盛基金管理有限公司权益投资部担任ETF专员；2015年7月至2016年11月在创金合信基金管理有限公司产品开发部从事相关研究工作；2016年11月至2018年4月在创金合信基金管理有限公司指数策略研究投资部历任研究员、基金经理助理，主要从事指数基金投资研究工作。2018年4月加入兴业基金管理有限公司，现任基金经理。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人通过事前识别、事中控制、事后检查三个步骤来保证公平交易。事前识别的任务是制定制度和业务流程、设置系统控制项以强制执行公平交易和防范反向交易；事中控制的工作是确保公司授权、研究、投资、交易等行为控制在事前设定的范围之内，各项业务操作根据制度和业务流程进行；事后检查公司投资行为与事前设定的流程、限额等有无偏差，编制投资组合公平交易报告，分析事中控制的效果。

4.3.2 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。

4.3.3 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，拟合指数收益表现，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，继续努力将基金的跟踪误差控制在较低水平。

报告期内，中证500指数上证15.58%，本基金涨幅14.33%，年化跟踪误差79bps。

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1.0851元，本报告期内，基金份额净值增长率为14.33%，同期业绩比较基准收益率为15.58%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022年市场开年就出现了明显的压力。食品饮料、医药及新能源等机构重仓品种全线大跌。当前国内依旧面临比较大的经济压力，而海外大宗商品依旧高热，导致通胀预期难以降温。美联储货币政策收紧预期从12月开始持续升温，美债利率全线上行。在年初市场调整之后，投资者会习惯性的放大这些对市场的不利因素。但我们认为当前我们反而应该更加积极的看待国内的稳增长政策。在货币政策已经明显宽松财政政策有望即将大规模发力的时间段，我们认为仍应该积极看待2022年市场。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人从合法经营、规范运作、勤勉尽责、保障基金持有人利益出发，严守合规底线、完善内部控制，2021年度主要从如下几个方面落实风险控制与合规管理、强化监察稽核职能：

1、建立健全公司治理结构、完善制度流程：报告期内公司持续优化公司治理和内部控制环境，进一步完善制度流程和授权管理机制，结合业务发展情况持续健全内部控制体系；

2、加强业务合规及信息披露审核：随着公司管理资产规模扩大以及产品线进一步丰富，公司持续加强对信息披露材料、营销材料、产品方案等开展合规审核，保证所披露信息的真实性、准确性和完整性，保证各项对外营销活动和宣传推介合法合规；

3、全面实施投资监督和风险监测：公司严格遵照法律法规、基金合同和公司制度要求对日常投资运作进行管理和监控，对基金运作合规情况进行监控并跟踪分析异常指标，及时沟通及风险提示，全方位防范控制基金运作风险。

4、开展各项稽核审计工作：根据法规要求，组织开展定期稽核、特定人员离任审计，依据风险导向组织重点业务领域专项审计，根据监管要求组织各项自查，对公司治理、投资研究、产品运作、业务开展合规性及内控完善性进行审查，不断促进公司内控制度执行有效。

5、落实全员合规理念、加强员工合规管理：报告期内公司重外规宣贯和培训，密切关注外部监管要求，重视外规要求传达与内化，通过线上、线下多种方式组织开展员工合规培训，加强对员工职业操守的教育和监督，提升员工合规内控意识；严格规范工作人员执业行为，开展警示案防教育，督促员工勤勉尽责，防范利用职务便利从事违法违规、超越权限或者其他损害客户合法权益的行为；组织开展定期常规信息管制抽查，以及异常行为专项排查，加强员工行为监督，强化员工合规管理。

6、持续完善内控合规体系建设、强化合规内控管理：报告期内，持续推进合规内控文化建设，完善法治管理体系，优化合规内控评价机制，强化合规引导，推进重点法规内化落地，有序开展各项合规内控工作，不断提升公司审慎规范经营和全面风险管理水平。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续本着诚实信用、勤勉尽责的原则，坚持风险控制为核心，确保管理基金的合规、安全运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

会计师事务所对相关估值模型、假设及参数的适当性出具意见。

定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

4.8 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。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

本报告期内，本基金自2021年06月30日起至2021年12月31日止基金资产净值低于五千万，已连续六十个工作日以上。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(22)第P01875号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金全体持有人
审计意见	我们审计了兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括2021年12月31日的资产负债表，2021年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了

	<p>兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
<p>形成审计意见的基础</p>	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
<p>强调事项</p>	<p>-</p>
<p>其他事项</p>	<p>-</p>
<p>其他信息</p>	<p>兴业基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金2021年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的</p>

	<p>事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（3）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。（4）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不</p>

	<p>充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	汪芳	王硕
会计师事务所的地址	上海市延安东路222号外滩中心30楼	
审计报告日期	2022-03-28	

§ 7 年度财务报表

7.1 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12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	626,968.65	1,975,267.98
结算备付金		-	37,698.59
存出保证金		50,467.68	92,816.83
交易性金融资产	7.4.7.2	10,977,754.93	148,182,270.47
其中：股票投资		10,976,458.83	148,182,270.47
基金投资		-	-
债券投资		1,296.10	-
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	163.43	277.51
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		11,655,354.69	150,288,331.38
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		3,614.40	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		5,957.16	63,541.64
应付托管费		1,191.43	12,708.35
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	13,963.75	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	7.4.7.8	171,048.15	165,000.00
负债合计		195,774.89	271,945.40
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	10,560,583.00	158,060,583.00

未分配利润	7.4.7.10	898,996.80	-8,044,197.02
所有者权益合计		11,459,579.80	150,016,385.98
负债和所有者权益总计		11,655,354.69	150,288,331.38

注：1. 报告截止日2021年12月31日，基金份额净值1.0851元，基金份额总额10,560,583.00份。

2. 本基金合同于2020年6月30日生效，上年财务报表的实际编制期间为2020年6月30日（基金合同生效日）至2020年12月31日。

7.2 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12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年06月30日（基金 合同生效日）至2020年 12月31日
一、收入		11,969,985.12	-8,279,157.73
1. 利息收入		7,040.19	138,920.28
其中：存款利息收入	7.4.7.11	7,039.98	138,915.16
债券利息收入		0.21	5.12
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）		5,948,619.16	-3,151,817.79
其中：股票投资收益	7.4.7.12	4,843,251.68	-3,257,407.12
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	4,228.63
资产支持证券投资	7.4.7.13.	-	-

收益	3		
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	1,105,367.48	101,360.70
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	5,621,335.15	-5,378,699.90
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	392,990.62	112,439.68
减：二、费用		1,000,519.21	1,002,041.91
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	376,504.00	432,198.16
2. 托管费	7.4.10.2.2	75,300.83	86,439.64
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	255,347.28	282,143.44
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	0.01
7. 其他费用	7.4.7.19	293,367.10	201,260.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		10,969,465.91	-9,281,199.64
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		10,969,465.91	-9,281,199.64

7.3 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12月31日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2021年01月01日至2021年12月31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)	-	10,969,465.91	10,969,465.91
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)	-147,500,000.00	-2,026,272.09	-149,526,272.09
其中：1. 基金申购款	15,000,000.00	767,070.94	15,767,070.94
2. 基金赎回款	-162,500,000.00	-2,793,343.03	-165,293,343.03
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)	10,560,583.00	898,996.80	11,459,579.80
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12月31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	-	-9,281,199.64	-9,281,199.64

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)	-60,000,000.00	1,237,002.62	-58,762,997.38
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-60,000,000.00	1,237,002.62	-58,762,997.38
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)	158,060,583.00	-8,044,197.02	150,016,385.98

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

官恒秋

张顺国

夏鹏

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人兴业基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]2463号文准予公开募集注册。本基金为交易型开放式基金,存续期限为不定期。本基金首次设立募集基金份额为218,060,583.00份,经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为毕马威华振验字第2000445号验资报告。《兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于2020年6月30日正式生效。本基金的基金管理人为兴业基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的《兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股及其备选成份股、其他股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、股指期货、债券(包括国债、地方政府债、政府支持机构债券、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、同业存单、现金，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%。如法律法规或中国证监会允许，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年跟踪误差不超过2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。本基金的业绩比较基准为标的指数，即中证500指数收益率。

7.4.2 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。

7.4.3 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12月31日的财务状况以及2021年1月1日至2021年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

2) 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。贷款及应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，贷款及应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次

输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1) 对于银行间市场交易的固定收益品种，以及交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照第三方估值机构提供的估值确定公允价值。

2) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。

3) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

4) 当投资品种不再存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

– 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

– 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

资产支持证券投资收益为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

– 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产/负债的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产/负债卖出或到期时转出计入投资收益。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.50%的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率逐日计提。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

- 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。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒介公告。

7.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》（中基协发[2014]24号），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
活期存款	626,968.65	1,975,267.98
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	626,968.65	1,975,267.98

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	10,734,119.68	10,976,458.83	242,339.15
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,000.00	1,296.10
	银行间市场	-	-
	合计	1,000.00	1,296.10
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-

合计	10,735,119.68	10,977,754.93	242,635.25
项目	上年度末 2020年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	153,560,970.37	148,182,270.47	-5,378,699.90
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	153,560,970.37	148,182,270.47	-5,378,699.90

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	138.25	212.83
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	-	18.70
应收债券利息	0.21	-
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	24.97	45.98
合计	163.43	277.51

7.4.7.6 其他资产

无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	13,963.75	30,695.41
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	13,963.75	30,695.41

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	170,000.00	130,000.00
应付指数使用费	1,048.15	35,000.00
合计	171,048.15	165,000.00

7.4.7.9 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12月31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	15,000,000.00	15,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-162,500,000.00	-162,500,000.00
本期末	10,560,583.00	10,560,583.00

7.4.7.10 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	5,348,130.76	5,621,335.15	10,969,465.91
本期基金份额交易产生的变动数	-680,815.37	-1,345,456.72	-2,026,272.09
其中：基金申购款	1,090,182.31	-323,111.37	767,070.94
基金赎回款	-1,770,997.68	-1,022,345.35	-2,793,343.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,091,778.82	-192,782.02	898,996.80

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至 2021年12月31日	2020年06月30日（基金合同生效日）至2020年12月31日
活期存款利息收入	4,721.51	134,674.08
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	1,527.69	3,728.58
其他	790.78	512.50
合计	7,039.98	138,915.16

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 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12月31 日	上年度可比期间 2020年06月30日(基金合同 生效日)至2020年12月31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	2,310,087.87	-2,986,708.07
股票投资收益——赎回差价收入	2,533,163.81	-270,699.05
股票投资收益——申购差价收入	-	-
合计	4,843,251.68	-3,257,407.12

7.4.7.12.2 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12月31日	上年度可比期间 2020年06月30日(基金合同生效 日)至2020年12月31日
卖出股票成交总额	121,434,862.68	50,710,132.92
减：卖出股票成本总额	119,124,774.81	53,696,840.99
买卖股票差价收入	2,310,087.87	-2,986,708.07

7.4.7.12.3 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12月31日	上年度可比期间 2020年06月30日(基金合同生效 日)至2020年12月31日
赎回基金份额对价总额	165,293,343.03	58,762,997.38
减：现金支付赎回款总额	89,995,988.03	32,800,361.38
减：赎回股票成本总额	72,764,191.19	26,233,335.05
赎回差价收入	2,533,163.81	-270,699.05

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2 021年12月31日	上年度可比期间 2020年06月30日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
债券投资收益——买卖债券 （、债转股及债券到期兑付） 差价收入	-	4,228.63
债券投资收益——赎回差价 收入	-	-
债券投资收益——申购差价 收入	-	-
合计	-	4,228.63

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年06月30日（基金合同生效日） 至2020年12月31日
卖出债券（、债转 股及债券到期兑 付）成交总额	-	29,133.87
减：卖出债券（、 债转股及债券到期 兑付）成本总额	-	24,900.00
减：应收利息总额	-	5.24
买卖债券差价收入	-	4,228.63

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年06月30日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,105,367.48	101,360.70
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,105,367.48	101,360.70

7.4.7.16 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20 21年12月31日	上年度可比期间 2020年06月30日（基金合同生效日） 至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	5,621,335.15	-5,378,699.90
——股票投资	5,621,039.05	-5,378,699.90
——债券投资	296.10	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允 价值变动产生的预估增 值税	-	-
合计	5,621,335.15	-5,378,699.90

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年06月30日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
----	-----------------------------------	---

基金赎回费收入	-	-
ETF基金替代损益	392,990.62	112,439.68
合计	392,990.62	112,439.68

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年06月30日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
交易所市场交易费用	255,347.28	282,143.44
银行间市场交易费用	-	-
合计	255,347.28	282,143.44

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年06月30日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	80,000.00
汇划手续费	651.79	860.66
其他费用_指数使用费	72,715.31	70,000.00
公证费	10,000.00	-
律师费	40,000.00	-
开户费	-	400.00
合计	293,367.10	201,260.66

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
兴业基金管理有限公司（以下简称“兴业基金”）	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）	基金托管人
兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）	基金管理人的控股股东
中海集团投资有限公司	基金管理人的股东
兴业财富资产管理有限公司（以下简称“兴业财富”）	基金管理人控制的公司

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日 至2021年12月31 日	上年度可比期间 2020年06月30日（基金合同 生效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	376,504.00	432,198.16
其中：支付销售机构的客户维护费	-	32,916.43

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日 至2021年12月31 日	上年度可比期间 2020年06月30日（基金合同生 效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	75,300.83	86,439.64

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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.10.5 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12月31日		上年度可比期间 2020年06月30日（基金合同生效日） 至2020年12月31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	626,968.65	4,721.51	1,975,267.98	134,674.08

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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期间内及上年度可比期间未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.7 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。

7.4.11 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。

7.4.12 期末（2021年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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。

7.4.12.2 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
002683	广东	2021-1-1	-	30.12	-	-	1,000	33,891.74	30,120.00	-

	宏 大	2-2 0								
--	--------	----------	--	--	--	--	--	--	--	--

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

二级风险防范是指公司内部控制与风险管理委员会、投资决策委员会和风险管理部层次对公司风险进行的预防和控制。管理层下设内部控制与风险管理委员会，对公司在经营管理和基金运作中的风险进行研究、分析与评估，制定相应风险控制制度并监督其执行，全面、及时、有效地防范公司经营过程中可能面临的各类风险。

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

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

7.4.13.2 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的证券不得超过该证券的10%。本基金的交易所交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手，并完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	1,296.10	-
未评级	-	-
合计	1,296.10	-

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年1 2月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	626,968.65	-	-	-	626,968.65
存出保证金	50,467.68	-	-	-	50,467.68
交易性金融资产	1,296.10	-	-	10,976,458.83	10,977,754.93
应收利息	-	-	-	163.43	163.43
资产总计	678,732.43	0.00	0.00	10,976,622.26	11,655,354.69
负债					
应付证券清算款	-	-	-	3,614.40	3,614.40
应付管理人报酬	-	-	-	5,957.16	5,957.16
应付托管费	-	-	-	1,191.43	1,191.43
应付交易费用	-	-	-	13,963.75	13,963.75
其他负债	-	-	-	171,048.15	171,048.15
负债总计	0.00	-	-	195,774.89	195,774.89
利率敏感度缺口	678,732.43	0.00	0.00	10,780,847.37	11,459,579.80
上年度末 2020年1 2月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
假设	2、利率曲线平行移动		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
	市场利率上升25个基点	-19.10	0.00
	市场利率下降25个基点	19.43	0.00

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31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	10,976,458.83	95.78	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	10,976,458.83	95.78	148,182,270.47	98.78

7.4.13.4.3.2 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12月31日	上年度末 2020年12月31日
	1、股票价格上升5%	548,822.94	7,409,113.52
	2、股票价格下降5%	-548,822.94	-7,409,113.52

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相若。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2021年12月31日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币10,947,634.93元，属于第二层次的余额为人民币30,120.00元，无属于第三层次的余额（于2020年12月31日，第一层次的余额为人民币148,008,819.47元，属于第二层次的余额为人民币173,451.00元，无属于第三层次的余额）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于本基金投资的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

(iii) 第三层次公允价值计量的金融工具

无

§ 8 投资组合报告

8.1 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	10,976,458.83	94.18
	其中：股票	10,976,458.83	94.18
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,296.10	0.01
	其中：债券	1,296.10	0.01
	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	626,968.65	5.38
8	其他各项资产	50,631.11	0.43
9	合计	11,655,354.69	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	123,366.40	1.08
B	采矿业	444,526.60	3.88
C	制造业	6,556,388.83	57.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	416,431.90	3.63
E	建筑业	213,062.00	1.86
F	批发和零售业	361,920.80	3.16
G	交通运输、仓储和邮政业	260,037.80	2.27
H	住宿和餐饮业	67,784.00	0.59
I	信息传输、软件和信息技术	788,379.10	6.88

	术服务业		
J	金融业	836,388.10	7.30
K	房地产业	282,855.00	2.47
L	租赁和商务服务业	138,316.00	1.21
M	科学研究和技术服务业	56,120.00	0.49
N	水利、环境和公共设施管理业	108,381.00	0.95
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	26,856.00	0.23
R	文化、体育和娱乐业	145,657.00	1.27
S	综合	84,948.30	0.74
	合计	10,911,418.83	95.22

8.2.2 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	65,040.00	0.57
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	-	-
K	房地产业	-	-
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	65,040.00	0.57

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 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	300751	迈为股份	200	128,460.00	1.12
2	600563	法拉电子	400	92,960.00	0.81
3	002340	格林美	8,100	83,835.00	0.73
4	603267	鸿远电子	400	71,776.00	0.63
5	601555	东吴证券	7,960	70,525.60	0.62
6	600522	中天科技	4,000	67,840.00	0.59
7	600884	杉杉股份	2,000	65,540.00	0.57
8	000723	美锦能源	4,000	64,920.00	0.57
9	603589	口子窖	900	63,783.00	0.56
10	000009	中国宝安	4,410	63,636.30	0.56
11	601615	明阳智能	2,400	62,640.00	0.55
12	600157	永泰能源	34,400	62,608.00	0.55
13	300474	景嘉微	400	60,880.00	0.53
14	002385	大北农	5,700	59,793.00	0.52
15	600885	宏发股份	800	59,712.00	0.52

16	600399	抚顺特钢	2,400	59,448.00	0.52
17	002013	中航机电	3,200	58,176.00	0.51
18	601117	中国化学	4,800	57,600.00	0.50
19	603893	瑞芯微	400	54,760.00	0.48
20	002384	东山精密	2,000	54,200.00	0.47
21	300223	北京君正	400	53,600.00	0.47
22	300088	长信科技	4,000	53,120.00	0.46
23	600486	扬农化工	400	52,480.00	0.46
24	300285	国瓷材料	1,200	51,084.00	0.45
25	000733	振华科技	400	49,712.00	0.43
26	600298	安琪酵母	800	48,288.00	0.42
27	600256	广汇能源	7,200	47,088.00	0.41
28	300253	卫宁健康	2,800	46,928.00	0.41
29	600754	锦江酒店	800	46,880.00	0.41
30	300763	锦浪科技	200	46,310.00	0.40
31	603127	昭衍新药	400	46,172.00	0.40
32	002138	顺络电子	1,200	45,816.00	0.40
33	002185	华天科技	3,600	45,756.00	0.40
34	300724	捷佳伟创	400	45,720.00	0.40
35	600141	兴发集团	1,200	45,456.00	0.40
36	300037	新宙邦	400	45,200.00	0.39
37	603456	九洲药业	800	45,008.00	0.39
38	002268	卫士通	800	44,752.00	0.39
39	000988	华工科技	1,600	44,576.00	0.39
40	603613	国联股份	400	43,000.00	0.38
41	300058	蓝色光标	4,000	42,920.00	0.37
42	600862	中航高科	1,200	42,912.00	0.37
43	601689	拓普集团	800	42,400.00	0.37
44	600487	亨通光电	2,800	42,336.00	0.37
45	000630	铜陵有色	12,100	42,108.00	0.37
46	600418	江淮汽车	2,400	41,760.00	0.36

47	002797	第一创业	5,700	41,724.00	0.36
48	601636	旗滨集团	2,400	41,040.00	0.36
49	002080	中材科技	1,200	40,824.00	0.36
50	300136	信维通信	1,600	40,512.00	0.35
51	600765	中航重机	800	40,392.00	0.35
52	002028	思源电气	800	39,368.00	0.34
53	600392	盛和资源	2,000	39,240.00	0.34
54	600516	方大炭素	3,600	38,952.00	0.34
55	002212	天融信	2,000	38,340.00	0.33
56	601168	西部矿业	2,800	38,108.00	0.33
57	000998	隆平高科	1,600	37,216.00	0.32
58	300418	昆仑万维	1,600	37,040.00	0.32
59	601077	渝农商行	9,600	36,960.00	0.32
59	000728	国元证券	4,800	36,960.00	0.32
61	000807	云铝股份	3,300	36,861.00	0.32
62	600637	东方明珠	3,900	36,855.00	0.32
63	002444	巨星科技	1,200	36,612.00	0.32
64	603707	健友股份	870	36,540.00	0.32
65	000738	航发控制	1,200	36,336.00	0.32
66	000513	丽珠集团	900	36,189.00	0.32
67	002465	海格通信	3,300	36,036.00	0.31
68	300363	博腾股份	400	35,780.00	0.31
69	000636	风华高科	1,200	35,760.00	0.31
70	600699	均胜电子	1,600	35,152.00	0.31
71	600529	山东药玻	800	35,120.00	0.31
72	600177	雅戈尔	5,000	34,450.00	0.30
73	000039	中集集团	2,000	34,320.00	0.30
74	600875	东方电气	1,600	34,272.00	0.30
75	002439	启明星辰	1,200	34,236.00	0.30
76	300308	中际旭创	800	34,000.00	0.30
77	300699	光威复材	400	33,792.00	0.29

78	000547	航天发展	2,000	33,400.00	0.29
79	600233	圆通速递	2,000	33,360.00	0.29
80	600705	中航产融	8,400	33,348.00	0.29
81	002030	达安基因	1,660	33,299.60	0.29
82	603568	伟明环保	900	32,877.00	0.29
83	300296	利亚德	3,200	32,800.00	0.29
84	603077	和邦生物	9,600	32,736.00	0.29
85	000932	华菱钢铁	6,400	32,704.00	0.29
86	002409	雅克科技	400	32,468.00	0.28
87	300146	汤臣倍健	1,200	32,352.00	0.28
88	002673	西部证券	4,000	32,280.00	0.28
89	000983	山西焦煤	3,900	32,253.00	0.28
90	600038	中直股份	400	32,120.00	0.28
91	300618	寒锐钴业	400	32,072.00	0.28
92	600733	北汽蓝谷	3,200	32,064.00	0.28
93	000519	中兵红箭	1,200	32,004.00	0.28
94	002353	杰瑞股份	800	32,000.00	0.28
95	600482	中国动力	1,600	31,520.00	0.28
96	600704	物产中大	5,300	31,376.00	0.27
97	601016	节能风电	4,800	31,248.00	0.27
97	600316	洪都航空	800	31,248.00	0.27
97	000960	锡业股份	1,600	31,248.00	0.27
100	600739	辽宁成大	1,600	31,232.00	0.27
101	002156	通富微电	1,600	31,088.00	0.27
102	600027	华电国际	5,800	31,030.00	0.27
103	600879	航天电子	3,700	30,488.00	0.27
104	002831	裕同科技	900	30,321.00	0.26
105	002507	涪陵榨菜	800	30,240.00	0.26
105	002223	鱼跃医疗	800	30,240.00	0.26
107	600369	西南证券	5,700	30,153.00	0.26
108	002683	宏大爆破	1,000	30,120.00	0.26

109	300017	网宿科技	4,500	30,105.00	0.26
110	600988	赤峰黄金	2,000	29,800.00	0.26
111	300212	易华录	840	29,694.00	0.26
112	300383	光环新网	2,000	29,680.00	0.26
113	000623	吉林敖东	1,600	29,552.00	0.26
114	600642	申能股份	4,000	29,480.00	0.26
115	600549	厦门钨业	1,300	29,419.00	0.26
116	601997	贵阳银行	4,500	29,295.00	0.26
117	600580	卧龙电驱	1,600	29,264.00	0.26
118	601128	常熟银行	4,400	29,084.00	0.25
119	002299	圣农发展	1,200	29,004.00	0.25
120	600039	四川路桥	2,400	28,896.00	0.25
121	002508	老板电器	800	28,816.00	0.25
122	002926	华西证券	2,900	28,565.00	0.25
123	000629	攀钢钒钛	7,300	28,397.00	0.25
124	600511	国药股份	900	28,377.00	0.25
125	600188	兖矿能源	1,200	28,236.00	0.25
126	000739	普洛药业	800	28,072.00	0.24
127	002131	利欧股份	11,400	28,044.00	0.24
128	600732	爱旭股份	1,200	28,032.00	0.24
129	600497	驰宏锌锗	5,600	27,944.00	0.24
130	601198	东兴证券	2,400	27,912.00	0.24
131	002273	水晶光电	1,600	27,824.00	0.24
132	603198	迎驾贡酒	400	27,780.00	0.24
133	002078	太阳纸业	2,400	27,576.00	0.24
134	000999	华润三九	800	27,392.00	0.24
135	600372	中航电子	1,200	26,868.00	0.23
136	300244	迪安诊断	800	26,856.00	0.23
137	000750	国海证券	6,500	26,715.00	0.23
138	002092	中泰化学	2,800	26,712.00	0.23
139	600166	福田汽车	7,700	26,488.00	0.23

140	600909	华安证券	4,890	26,454.90	0.23
141	603218	日月股份	800	26,360.00	0.23
142	600867	通化东宝	2,400	26,304.00	0.23
143	600170	上海建工	7,300	26,280.00	0.23
144	000887	中鼎股份	1,200	26,172.00	0.23
145	600201	生物股份	1,600	26,160.00	0.23
146	300168	万达信息	2,000	26,040.00	0.23
146	000050	深天马 A	2,000	26,040.00	0.23
148	600521	华海药业	1,200	25,992.00	0.23
149	300070	碧水源	3,600	25,884.00	0.23
150	600160	巨化股份	2,000	25,820.00	0.23
151	002065	东华软件	3,300	25,740.00	0.22
152	300251	光线传媒	2,000	25,700.00	0.22
153	000975	银泰黄金	2,920	25,637.60	0.22
154	600153	建发股份	2,800	25,396.00	0.22
155	600535	天士力	1,600	25,360.00	0.22
156	000825	太钢不锈	3,600	25,344.00	0.22
156	000021	深科技	1,600	25,344.00	0.22
158	002936	郑州银行	8,020	25,343.20	0.22
159	002603	以岭药业	1,280	25,088.00	0.22
160	603866	桃李面包	880	24,992.00	0.22
161	002203	海亮股份	2,000	24,860.00	0.22
162	600008	首创环保	7,290	24,858.90	0.22
163	002002	鸿达兴业	4,100	24,846.00	0.22
164	002739	万达电影	1,600	24,768.00	0.22
165	002249	大洋电机	2,800	24,612.00	0.21
166	002557	洽洽食品	400	24,544.00	0.21
167	002500	山西证券	3,700	24,420.00	0.21
168	000830	鲁西化工	1,600	24,416.00	0.21
169	002506	协鑫集成	6,400	24,320.00	0.21
170	300026	红日药业	3,100	24,273.00	0.21

171	002191	劲嘉股份	1,600	24,208.00	0.21
172	002408	齐翔腾达	2,300	24,150.00	0.21
173	002430	杭氧股份	800	24,008.00	0.21
174	002373	千方科技	1,600	23,920.00	0.21
175	601005	重庆钢铁	11,400	23,826.00	0.21
176	300115	长盈精密	1,200	23,808.00	0.21
177	002152	广电运通	2,000	23,800.00	0.21
178	601866	中远海发	7,300	23,725.00	0.21
179	600348	华阳股份	2,000	23,700.00	0.21
180	600998	九州通	1,600	23,552.00	0.21
181	300182	捷成股份	3,700	23,421.00	0.20
182	300463	迈克生物	800	23,352.00	0.20
183	600801	华新水泥	1,200	23,160.00	0.20
184	600236	桂冠电力	3,600	23,112.00	0.20
185	002153	石基信息	800	22,992.00	0.20
186	002195	二三四五	9,800	22,932.00	0.20
187	300357	我武生物	400	22,920.00	0.20
188	002266	浙富控股	3,200	22,784.00	0.20
189	603156	养元饮品	800	22,728.00	0.20
190	002422	科伦药业	1,200	22,716.00	0.20
191	603883	老百姓	460	22,714.80	0.20
192	000027	深圳能源	2,800	22,680.00	0.20
193	002056	横店东磁	1,200	22,644.00	0.20
194	601699	潞安环能	2,000	22,620.00	0.20
195	600803	新奥股份	1,225	22,491.00	0.20
196	300024	机器人	2,000	22,340.00	0.19
197	002595	豪迈科技	800	22,208.00	0.19
198	002127	南极电商	3,200	22,080.00	0.19
199	600066	宇通客车	2,000	22,040.00	0.19
200	002368	太极股份	800	22,032.00	0.19
201	300630	普利制药	400	22,016.00	0.19

202	002294	信立泰	800	21,856.00	0.19
203	600208	新湖中宝	7,300	21,754.00	0.19
204	000997	新大陆	1,200	21,744.00	0.19
205	600118	中国卫星	800	21,720.00	0.19
206	600859	王府井	800	21,600.00	0.19
207	600498	烽火通信	1,200	21,576.00	0.19
208	002250	联化科技	1,200	21,564.00	0.19
209	000656	金科股份	4,800	21,504.00	0.19
210	600271	航天信息	1,600	21,424.00	0.19
211	000878	云南铜业	1,600	21,392.00	0.19
212	300315	掌趣科技	4,400	21,384.00	0.19
213	600415	小商品城	4,400	21,340.00	0.19
214	601872	招商轮船	5,200	21,320.00	0.19
215	600673	东阳光	2,400	21,312.00	0.19
216	300009	安科生物	1,620	21,205.80	0.19
217	002019	亿帆医药	1,200	21,144.00	0.18
218	601179	中国西电	3,800	21,090.00	0.18
219	002004	华邦健康	2,900	20,996.00	0.18
220	600258	首旅酒店	800	20,904.00	0.18
221	000400	许继电气	800	20,880.00	0.18
222	002939	长城证券	1,600	20,720.00	0.18
223	600380	健康元	1,600	20,544.00	0.18
224	600171	上海贝岭	800	20,528.00	0.18
225	600216	浙江医药	1,200	20,496.00	0.18
226	600863	内蒙华电	5,200	20,488.00	0.18
227	601778	晶科科技	2,400	20,472.00	0.18
228	600517	国网英大	2,800	20,412.00	0.18
229	000540	中天金融	7,700	20,328.00	0.18
230	002505	鹏都农牧	5,300	20,246.00	0.18
231	600839	四川长虹	6,100	20,191.00	0.18
232	002221	东华能源	1,600	20,144.00	0.18

233	603650	彤程新材	400	20,128.00	0.18
234	002511	中顺洁柔	1,200	20,052.00	0.17
235	600536	中国软件	400	19,972.00	0.17
236	600155	华创阳安	2,000	19,920.00	0.17
237	300001	特锐德	800	19,896.00	0.17
238	000012	南玻A	2,000	19,860.00	0.17
239	600259	广晟有色	400	19,696.00	0.17
240	002382	蓝帆医疗	1,207	19,662.03	0.17
241	000060	中金岭南	4,000	19,640.00	0.17
242	002966	苏州银行	2,900	19,633.00	0.17
243	600282	南钢股份	5,300	19,610.00	0.17
244	002701	奥瑞金	2,800	19,600.00	0.17
245	601992	金隅集团	6,900	19,596.00	0.17
246	002372	伟星新材	800	19,456.00	0.17
247	600667	太极实业	2,400	19,392.00	0.17
248	002958	青农商行	5,000	19,300.00	0.17
249	000537	广宇发展	800	19,280.00	0.17
250	000970	中科三环	1,200	19,260.00	0.17
251	002670	国盛金控	2,000	19,200.00	0.17
252	600390	五矿资本	3,600	19,152.00	0.17
253	300741	华宝股份	400	19,140.00	0.17
254	000401	冀东水泥	1,600	19,136.00	0.17
255	000690	宝新能源	3,200	18,944.00	0.17
256	002396	星网锐捷	800	18,856.00	0.16
257	002281	光迅科技	800	18,632.00	0.16
258	601717	郑煤机	1,600	18,544.00	0.16
259	000709	河钢股份	7,500	18,450.00	0.16
260	600970	中材国际	1,600	18,288.00	0.16
260	002174	游族网络	1,200	18,288.00	0.16
262	002745	木林森	1,200	18,156.00	0.16
263	600158	中体产业	1,200	18,144.00	0.16

264	600895	张江高科	1,200	18,072.00	0.16
265	603225	新凤鸣	1,212	17,998.20	0.16
266	600985	淮北矿业	1,600	17,888.00	0.16
267	002128	电投能源	1,200	17,820.00	0.16
268	002572	索菲亚	800	17,760.00	0.15
269	600820	隧道股份	3,300	17,754.00	0.15
270	000778	新兴铸管	4,100	17,753.00	0.15
271	000598	兴蓉环境	2,800	17,696.00	0.15
272	002434	万里扬	1,200	17,688.00	0.15
273	000686	东北证券	2,000	17,560.00	0.15
274	600131	国网信通	800	17,480.00	0.15
275	600598	北大荒	1,200	17,472.00	0.15
276	600597	光明乳业	1,200	17,424.00	0.15
277	600409	三友化工	2,000	17,400.00	0.15
277	002010	传化智联	2,000	17,400.00	0.15
279	000930	中粮科技	1,600	17,392.00	0.15
280	603712	七一二	400	17,320.00	0.15
281	600755	厦门国贸	2,400	17,304.00	0.15
281	002048	宁波华翔	800	17,304.00	0.15
283	000581	威孚高科	800	17,232.00	0.15
284	600446	金证股份	1,200	17,184.00	0.15
285	600500	中化国际	2,000	17,120.00	0.15
286	600567	山鹰国际	5,200	17,108.00	0.15
287	600297	广汇汽车	6,400	17,088.00	0.15
288	000729	燕京啤酒	2,000	16,940.00	0.15
289	603858	步长制药	800	16,872.00	0.15
290	600325	华发股份	2,800	16,856.00	0.15
291	600022	山东钢铁	9,400	16,826.00	0.15
292	000883	湖北能源	3,200	16,768.00	0.15
293	601456	国联证券	1,200	16,764.00	0.15
294	600728	佳都科技	2,000	16,660.00	0.15

295	600572	康恩贝	3,300	16,500.00	0.14
296	600528	中铁工业	2,000	16,420.00	0.14
297	600707	彩虹股份	2,400	16,368.00	0.14
298	002075	沙钢股份	2,800	16,324.00	0.14
299	002532	天山铝业	2,000	16,300.00	0.14
300	600718	东软集团	1,200	16,272.00	0.14
301	600764	中国海防	400	16,264.00	0.14
302	300869	康泰医学	400	16,220.00	0.14
303	001914	招商积余	800	16,208.00	0.14
304	600315	上海家化	400	16,164.00	0.14
305	300482	万孚生物	410	16,145.80	0.14
306	600060	海信视像	1,200	16,140.00	0.14
307	002146	荣盛发展	3,700	16,095.00	0.14
308	300376	易事特	1,600	16,080.00	0.14
309	600827	百联股份	1,200	15,996.00	0.14
310	002183	怡亚通	2,400	15,888.00	0.14
311	300072	三聚环保	2,000	15,860.00	0.14
312	002124	天邦股份	2,460	15,842.40	0.14
313	300271	华宇软件	1,237	15,709.90	0.14
314	002925	盈趣科技	460	15,653.80	0.14
315	601577	长沙银行	2,000	15,620.00	0.14
316	600507	方大特钢	2,000	15,600.00	0.14
317	002399	海普瑞	900	15,390.00	0.13
318	600021	上海电力	1,200	15,384.00	0.13
319	000898	鞍钢股份	4,100	15,375.00	0.13
320	002440	闰土股份	1,600	15,344.00	0.13
321	601106	中国一重	4,400	15,312.00	0.13
321	600906	财达证券	1,200	15,312.00	0.13
323	601880	辽港股份	8,800	15,224.00	0.13
324	600808	马钢股份	4,100	15,129.00	0.13
325	002867	周大生	850	15,113.00	0.13

326	601200	上海环境	1,200	15,108.00	0.13
327	600737	中粮糖业	1,600	15,040.00	0.13
328	002690	美亚光电	400	14,984.00	0.13
329	002390	信邦制药	2,000	14,840.00	0.13
330	600373	中文传媒	1,200	14,832.00	0.13
331	000028	国药一致	400	14,792.00	0.13
332	601118	海南橡胶	2,800	14,784.00	0.13
332	600782	新钢股份	2,800	14,784.00	0.13
334	603638	艾迪精密	460	14,683.20	0.13
335	003022	联泓新科	400	14,576.00	0.13
336	000488	晨鸣纸业	2,000	14,480.00	0.13
337	600811	东方集团	4,800	14,448.00	0.13
338	600167	联美控股	1,600	14,416.00	0.13
339	600967	内蒙一机	1,200	14,340.00	0.13
340	002180	纳思达	300	14,328.00	0.13
341	603885	吉祥航空	800	14,200.00	0.12
342	000987	越秀金控	1,600	13,920.00	0.12
343	600037	歌华有线	1,600	13,888.00	0.12
344	603228	景旺电子	400	13,812.00	0.12
345	000961	中南建设	3,300	13,662.00	0.12
346	002416	爱施德	1,200	13,656.00	0.12
347	600908	无锡银行	2,400	13,608.00	0.12
347	002429	兆驰股份	2,800	13,608.00	0.12
349	002110	三钢闽光	2,000	13,600.00	0.12
350	601718	际华集团	4,500	13,410.00	0.12
351	601000	唐山港	4,800	13,200.00	0.12
352	002085	万丰奥威	2,400	13,176.00	0.11
353	600546	山煤国际	1,600	13,136.00	0.11
354	601869	长飞光纤	400	13,096.00	0.11
355	600663	陆家嘴	1,200	13,032.00	0.11
356	601598	中国外运	2,900	12,992.00	0.11

357	002038	双鹭药业	1,200	12,972.00	0.11
358	601991	大唐发电	4,000	12,960.00	0.11
358	300166	东方国信	1,200	12,960.00	0.11
360	600398	海澜之家	2,000	12,820.00	0.11
361	600435	北方导航	1,200	12,816.00	0.11
362	601333	广深铁路	5,700	12,768.00	0.11
363	000869	张裕 A	400	12,744.00	0.11
364	000559	万向钱潮	2,000	12,740.00	0.11
365	300257	开山股份	800	12,704.00	0.11
366	600582	天地科技	2,900	12,702.00	0.11
367	002233	塔牌集团	1,200	12,696.00	0.11
368	000990	诚志股份	800	12,656.00	0.11
369	600329	中新药业	400	12,564.00	0.11
370	601608	中信重工	2,800	12,488.00	0.11
371	600120	浙江东方	2,820	12,464.40	0.11
372	002155	湖南黄金	1,200	12,432.00	0.11
373	000528	柳工	1,600	12,336.00	0.11
374	000877	天山股份	800	12,248.00	0.11
375	002081	金螳螂	2,000	12,160.00	0.11
376	000671	阳光城	4,000	12,080.00	0.11
377	601611	中国核建	1,200	11,964.00	0.10
378	600648	外高桥	900	11,907.00	0.10
379	600026	中远海能	2,000	11,840.00	0.10
380	603317	天味食品	440	11,796.40	0.10
381	000090	天健集团	2,000	11,740.00	0.10
382	000967	盈峰环境	1,600	11,728.00	0.10
383	000089	深圳机场	1,600	11,712.00	0.10
384	600307	酒钢宏兴	5,300	11,660.00	0.10
385	000415	渤海租赁	4,000	11,640.00	0.10
386	603000	人民网	800	11,536.00	0.10
387	603927	中科软	420	11,491.20	0.10

388	601098	中南传媒	1,200	11,484.00	0.10
389	000959	首钢股份	2,000	11,460.00	0.10
390	601975	招商南油	5,700	11,457.00	0.10
391	600566	济川药业	400	11,336.00	0.10
392	600376	首开股份	2,000	11,320.00	0.10
392	000402	金融街	2,000	11,320.00	0.10
394	000718	苏宁环球	2,400	11,304.00	0.10
395	600064	南京高科	1,200	11,208.00	0.10
396	002387	维信诺	1,200	11,136.00	0.10
397	000158	常山北明	1,600	11,072.00	0.10
398	601860	紫金银行	3,300	11,055.00	0.10
399	601958	金钼股份	1,600	10,960.00	0.10
400	000758	中色股份	2,000	10,920.00	0.10
401	300133	华策影视	1,600	10,832.00	0.09
402	600643	爱建集团	1,600	10,816.00	0.09
403	600062	华润双鹤	800	10,696.00	0.09
404	000685	中山公用	1,200	10,620.00	0.09
405	600959	江苏有线	3,200	10,528.00	0.09
406	600195	中牧股份	800	10,456.00	0.09
407	600729	重庆百货	400	10,408.00	0.09
408	000563	陕国投 A	3,200	10,336.00	0.09
409	600126	杭钢股份	2,000	10,260.00	0.09
410	600901	江苏租赁	2,000	10,180.00	0.09
411	600717	天津港	2,420	10,139.80	0.09
412	003035	南网能源	1,200	9,948.00	0.09
413	600556	天下秀	800	9,880.00	0.09
413	002705	新宝股份	400	9,880.00	0.09
415	600299	安迪苏	800	9,856.00	0.09
416	002423	中粮资本	1,200	9,720.00	0.08
417	601928	凤凰传媒	1,200	9,708.00	0.08
418	601969	海南矿业	800	9,608.00	0.08

419	000717	韶钢松山	2,000	9,500.00	0.08
420	600056	中国医药	800	9,448.00	0.08
421	600968	海油发展	3,200	9,376.00	0.08
422	002244	滨江集团	2,000	9,320.00	0.08
423	002242	九阳股份	400	9,280.00	0.08
424	002563	森马服饰	1,200	9,276.00	0.08
425	600776	东方通信	800	9,208.00	0.08
426	001965	招商公路	1,200	9,204.00	0.08
427	002424	贵州百灵	1,200	9,120.00	0.08
428	603379	三美股份	400	9,112.00	0.08
429	002458	益生股份	800	9,048.00	0.08
430	600266	城建发展	2,000	9,000.00	0.08
431	002375	亚厦股份	1,200	8,988.00	0.08
432	000937	冀中能源	1,600	8,816.00	0.08
433	601156	东航物流	400	8,752.00	0.08
434	600339	中油工程	2,800	8,624.00	0.08
435	600928	西安银行	2,000	8,600.00	0.08
436	603515	欧普照明	400	8,304.00	0.07
437	600649	城投控股	2,000	8,220.00	0.07
438	600006	东风汽车	1,200	8,172.00	0.07
439	002653	海思科	400	8,160.00	0.07
440	600095	湘财股份	800	8,096.00	0.07
441	600787	中储股份	1,200	7,488.00	0.07
442	000031	大悦城	2,000	7,460.00	0.07
443	600623	华谊集团	800	7,280.00	0.06
444	002468	申通快递	800	7,272.00	0.06
445	601139	深圳燃气	800	7,064.00	0.06
446	601828	美凯龙	800	7,048.00	0.06
447	600377	宁沪高速	800	6,896.00	0.06
448	000062	深圳华强	400	6,892.00	0.06
449	600956	新天绿能	400	6,884.00	0.06

450	600871	石化油服	3,200	6,848.00	0.06
451	601298	青岛港	1,200	6,828.00	0.06
452	001872	招商港口	400	6,780.00	0.06
453	000156	华数传媒	800	6,768.00	0.06
454	000553	安道麦A	800	6,752.00	0.06
455	002815	崇达技术	400	6,740.00	0.06
456	601228	广州港	2,000	6,660.00	0.06
457	603708	家家悦	400	6,656.00	0.06
458	601568	北元集团	800	6,504.00	0.06
459	002302	西部建设	800	6,424.00	0.06
460	002946	新乳业	400	6,376.00	0.06
461	600835	上海机电	400	6,368.00	0.06
462	001203	大中矿业	400	6,032.00	0.05
463	000046	泛海控股	3,200	6,016.00	0.05
464	002948	青岛银行	1,200	5,556.00	0.05
465	002945	华林证券	400	5,464.00	0.05
466	600823	世茂股份	1,600	5,248.00	0.05
467	600639	浦东金桥	400	5,108.00	0.04
468	600657	信达地产	1,200	4,476.00	0.04
469	601665	齐鲁银行	800	4,464.00	0.04
470	601003	柳钢股份	800	4,176.00	0.04
471	600350	山东高速	800	4,128.00	0.04
472	603056	德邦股份	400	4,092.00	0.04
473	600903	贵州燃气	400	3,872.00	0.03
474	600917	重庆燃气	400	3,356.00	0.03
475	601187	厦门银行	400	2,760.00	0.02

8.3.2 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	600460	士兰微	1,200	65,040.00	0.57

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	1,282,671.00	0.86
2	601636	旗滨集团	665,631.00	0.44
3	300037	新宙邦	664,699.00	0.44
4	300253	卫宁健康	657,248.00	0.44
5	002422	科伦药业	571,480.00	0.38
6	002439	启明星辰	561,548.00	0.37
7	300308	中际旭创	532,267.00	0.35
8	688029	南微医学	513,051.14	0.34
9	002180	纳思达	482,482.00	0.32
10	600177	雅戈尔	471,077.00	0.31
11	002127	南极电商	447,499.00	0.30
12	600988	赤峰黄金	444,492.00	0.30
13	000723	美锦能源	443,120.00	0.30
14	600068	葛洲坝	430,326.00	0.29
15	600563	法拉电子	423,044.00	0.28
16	600536	中国软件	421,947.00	0.28
17	600066	宇通客车	415,575.00	0.28
18	300383	光环新网	411,118.00	0.27
19	600637	东方明珠	408,542.00	0.27
20	601117	中国化学	400,488.00	0.27

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。

8.4.2 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	002709	天赐材料	1,502,144.90	1.00
3	300012	华测检测	1,400,471.00	0.93
4	000799	酒鬼酒	1,353,798.00	0.90
5	002340	格林美	1,292,157.00	0.86
6	000009	中国宝安	1,188,488.00	0.79
7	002074	国轩高科	1,172,551.00	0.78
8	300595	欧普康视	1,114,235.00	0.74
9	300496	中科创达	1,103,275.84	0.74
10	300207	欣旺达	1,060,863.00	0.71
11	600426	华鲁恒升	1,059,997.00	0.71
12	300285	国瓷材料	1,032,099.00	0.69
13	300316	晶盛机电	967,818.00	0.65
14	600132	重庆啤酒	941,396.00	0.63
15	002185	华天科技	866,580.00	0.58
16	603882	金域医学	865,342.00	0.58
17	688029	南微医学	810,851.51	0.54
18	688002	睿创微纳	805,617.11	0.54
19	300146	汤臣倍健	801,087.00	0.53
20	600143	金发科技	789,373.00	0.53

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。

8.4.3 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	41,928,013.31
卖出股票收入（成交）总额	121,434,862.68

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	1,296.10	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,296.10	0.01

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113633	科沃转债	10	1,296.10	0.01

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包含国债期货

8.11.2 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。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金投资范围不包含国债期货

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本报告期，基金投资的前十名证券发行主体中，美锦能源公司高级管理人员姚鹏收到山西证监局出具的警示函，其余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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	50,467.68
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	163.43

5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	50,631.11

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 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。

8.12.5.2 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
488	21,640.54	0.00	0.00%	10,560,583.00	100.00%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	许安澜	1,100,000.00	10.42%
2	许梅蓉	1,060,000.00	10.04%
3	高芸	500,000.00	4.73%
4	杨儒超	293,000.00	2.77%
5	李仁豪	200,000.00	1.89%

6	安景文	200,000.00	1.89%
7	陈伟君	200,000.00	1.89%
8	梁宇栋	160,000.00	1.52%
9	王雪芳	150,000.00	1.42%
10	宋淑英	150,000.00	1.42%
11	姜游福	150,000.00	1.42%

9.3 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%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 10 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	15,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	162,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	10,560,583.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金自2021年12月24日起至2021年12月28日以通讯方式召开了基金份额持有人大会，于2021年12月29日表决通过了《关于持续运作兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金的议案》。

11.2 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、2021年10月27日，庄孝强先生离任兴业基金管理有限公司总经理助理，详见本公司于2021年10月28日发布的《兴业基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。

3、2021年11月10日，王慧女士离任兴业基金管理有限公司督察长，胡斌先生代任督察长，详见本公司于2021年11月11日发布的《兴业基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。

4、2021年11月10日，张玲菡女士任兴业基金管理有限公司副总经理，详见本公司于2021年11月11日发布的《兴业基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。

5、本报告期托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内应支付给会计师事务所的报酬为5万元，目前事务所已提供审计服务的连续年限为2年。由德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）执行年度报告审计。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1、本报告期内，公司收到中国证券监督管理委员会上海监管局对我司采取责令改正措施的决定、对相关责任人出具警示函的决定。公司高度重视，制定并实施相关整改措施，及时向监管机构提交整改报告。报告期内，公司已完成整改。

2、本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	132,799,484.96	81.32%	97,117.85	81.32%	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	30,498,851.43	18.68%	22,304.06	18.68%	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	4	-	-	-	-	-

①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

- i 资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于3 亿元人民币。
- ii 财务状况良好，经营行为规范，最近一年未因发生重大违规行为而受到有关管理机关处罚。
- iii 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需

要，并能为本基金提供全面的信息服务。

iv 投研交综合实力较强。

v 其他因素(综合能力一般，但在某些特色领域或行业，研究能力、深度和质量在行业领先)。

②券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

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

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③在上述租用的券商交易单元中，本期无新增、剔除交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

11.8 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基金产品资料概要更新	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
6	兴业基金管理有限公司旗下	中国证监会规定的媒介	2021-03-31

	公募基金2020年年度报告		
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
10	兴业基金管理有限公司旗下基金2021年第二季度报告	中国证监会规定的媒介	2021-07-21
11	兴业基金管理有限公司旗下公募基金产品资料概要更新	中国证监会规定的媒介	2021-08-24
12	兴业基金管理有限公司旗下基金2021年中期报告	中国证监会规定的媒介	2021-08-31
13	兴业基金管理有限公司旗下基金2021年第三季度报告	中国证监会规定的媒介	2021-10-27
14	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	2021-10-28
15	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	2021-11-11
16	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	2021-11-11
17	兴业基金管理有限公司关于以通讯方式召开兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证监会规定的媒介	2021-11-26
18	兴业基金管理有限公司关于以通讯方式召开兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证监会规定的媒介	2021-11-27
19	兴业基金管理有限公司关于	中国证监会规定的媒介	2021-11-29

	以通讯方式召开兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告		
20	兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公证书	中国证监会规定的媒介	2021-12-30
21	兴业基金管理有限公司关于兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	中国证监会规定的媒介	2021-12-30

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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
个人	1	20210101-20210712	100,008,444.00	0.00	100,008,444.00	0.00	0.00%
	2	20211222-20211223	0.00	10,000,000.00	10,000,000.00	0.00	0.00%
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。

12.2 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。

§ 13 备查文件目录

13.1 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

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的住所

13.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅。

网站：<http://www.cib-fund.com.cn>

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人兴业基金管理有限公司。

客户服务中心电话 4000095561

兴业基金管理有限公司
二〇二二年三月三十一日