

兴业中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:兴业基金管理有限公司

基金托管人:中国银行股份有限公司

送出日期:2024 年 08 月 30 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年1月1日起至2024年6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
§5 托管人报告.....	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57
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.....	57
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.....	57
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.....	57
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.....	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	57
7.12 投资组合报告附注.....	58
§8 基金份额持有人信息.....	59

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2 期末上市基金前十名持有人	59
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
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	60
§9 开放式基金份额变动	60
§10 重大事件揭示	60
10.1 基金份额持有人大会决议	60
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	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4 基金投资策略的改变	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	61
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	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
10.8 其他重大事件	62
§11 影响投资者决策的其他重要信息	64
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	64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	64
§12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	65
12.3 查阅方式	65

§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	28,060,583.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020年08月12日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。主要投资策略包括资产配置策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略。
业绩比较基准	中证500指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险

	水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为交易型开放式指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
--	---

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		兴业基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张玲菡	许俊
	联系电话	021-22211888	010-66596688
	电子邮箱	zhaoyue@cib-fund.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.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		叶文煌	葛海蛟

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 (2024年01月01日- 2024年06月30日)
本期已实现收益	-1,440,983.16
本期利润	-1,749,011.47
加权平均基金份额本期利润	-0.0615
本期加权平均净值利润率	-7.56%
本期基金份额净值增长率	-6.78%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)
期末可供分配利润	-6,263,103.73
期末可供分配基金份额利润	-0.2232
期末基金资产净值	21,797,479.27
期末基金份额净值	0.7768
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)
基金份额累计净值增长率	-22.32%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

		准差②	率③	率标准差④		
过去一个月	-5.81%	0.89%	-6.89%	0.96%	1.08%	-0.07%
过去三个月	-5.08%	1.05%	-6.50%	1.14%	1.42%	-0.09%
过去六个月	-6.78%	1.47%	-8.96%	1.61%	2.18%	-0.14%
过去一年	-15.06%	1.17%	-17.60%	1.27%	2.54%	-0.10%
过去三年	-23.56%	1.13%	-27.40%	1.20%	3.84%	-0.07%
自基金合同生效起至今	-22.32%	1.09%	-14.22%	1.21%	-8.10%	-0.12%

注：本基金的业绩比较基准为标的指数，即中证500指数收益率。

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



§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

兴业基金管理有限公司（以下简称“兴业基金”或“公司”）成立于2013年4月17日，是兴业银行控股的全国性基金管理公司。公司注册资本12亿元人民币，其中，兴业银行出资10.8亿元，持股比例90%，中海集团投资有限公司出资1.2亿元，持股比例10%。公司业务范围包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。目前，兴业基金已在北京、上海、深圳、福州等地设立分公司，并全资拥有基金子公司--兴业财富资产管理有限公司。

站在新时代的潮头浪尖，兴业基金坚守“受人之托、代客理财”的初心本源，坚守“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化，以“市场化、专业化、数字化”为转型方向，不断提升主动管理能力，打磨产品线，强化核心竞争力，提升权益投资能力，巩固扩大固收优势并增强特色业务，致力于为广大投资者创造长期良好收益，为中国实体经济健康发展贡献自身应有力量。截至2024年6月30日，兴业基金共管理96只公募基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张诗悦	基金经理	2024-06-21	-	8年	中国籍，硕士学位，具有证券投资基金从业资格。2015年7月加入兴业基金管理有限公司，现任基金经理。
那赛男	基金经理	2020-06-30	-	14年	中国籍，硕士学位，具有证券投资基金从业资格。2009年8月至2013年3月在博时基金管理有限公司ETF及量化投资部担任投资分析员；2013年4月至2015年6月在长盛基金管理有限公司权益投资部担任ETF专员；2015年7月至2016年11月在创金合信基金管理有限公司产品开发部从事相关研究工作；2016年11月至2018年

					4月在创金合信基金管理有 限公司指数策略研究投资 部历任研究员、基金经理助 理，主要从事指数基金投资 研究工作。2018年4月加入 兴业基金管理有限公司。
--	--	--	--	--	--

- 1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期，除首任基金经理外，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；
- 2、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。
- 3、自2024年7月19日起那赛男不再担任本基金基金经理，详情请见本基金管理人于2024年7月20日发布的《兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告》。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

按照中证11个中证一级行业分类，中证500的前五大行业工业、原材料、信息技术、医药、金融占比超过70%，500工业、500原材、500信息、500医药和500金融指数上半年涨跌幅分别为-8.15%、-5.97%、-13.76%、-18.34%、-7.13%，整体表现不佳，消费、医药和信息跌幅较为明显。

中证500指数在宽基指数中表现居中，弱于沪深300，好于中证1000，中证500指数中科技、医药等成长属性强的行业贡献最为显著，和经济的相关性较强，和流动性的相关性也更强。在政策的稳步指引下，经济和信心的修复不是一蹴而就的，耐心是最好的解决方案，当前中证500的PB估值处在10年来的极低值，估值吸引力突出。中证500也逐步表现出了分红属性，截至2024年上半年，中证500近12个月股息率达到2.03%，股息率水平处在10年来的极高位。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴业中证500ETF（证券简称：兴业500；扩位证券简称：兴业中证500ETF）基金份额净值为0.7768元，本报告期内，基金份额净值增长率为-6.78%，同期业绩比较基准收益率为-8.96%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

估值委员会设主任委员一名，由分管运营的公司领导担任，副主任委员一名，由分管合规的公司领导担任，专业委员若干名，由研究部、投资管理部门（视会议议题内容

选择相关投资方向部门)、风险部门、监察稽核部门、基金运营部门负责人或其指定人员组成。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。

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

本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

会计师事务所对相关估值模型、假设及参数的适当性出具意见。

定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

本报告期内,参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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。

本基金自2023年07月06日起至2024年6月30日止净值低于五千万,已连续六十个工作日以上,本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计

算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，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。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	1,767,206.27	1,456,932.70
结算备付金		-	-
存出保证金		7,738.55	13,900.59
交易性金融资产	6.4.7.2	20,043,416.78	21,980,014.54
其中：股票投资		20,043,416.78	21,977,315.82
基金投资		-	-
债券投资		-	2,698.72
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		70,426.14	-

应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		21,888,787.74	23,450,847.83
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末
		2024年06月30日	2023年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		48,949.98	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		9,293.92	9,957.69
应付托管费		1,858.80	1,991.55
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	31,205.77	55,234.22
负债合计		91,308.47	67,183.46
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	28,060,583.00	28,060,583.00
未分配利润	6.4.7.8	-6,263,103.73	-4,676,918.63
净资产合计		21,797,479.27	23,383,664.37
负债和净资产总计		21,888,787.74	23,450,847.83

注：报告截止日2024年06月30日，基金份额净值0.7768元，基金份额总额28,060,583.00份。

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：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至202 3年06月30日
一、营业总收入		-1,615,920.76	-526,834.59
1.利息收入		3,107.22	1,981.75
其中：存款利息收入	6.4.7.9	3,107.22	1,981.75
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）		-1,212,520.56	-583,362.63
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-1,505,585.84	-927,015.98
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	982.54	2.38
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	292,082.74	343,650.97
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.15	-308,028.31	88,016.89
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”	6.4.7.16	-98,479.11	-33,470.60

号填列)			
减：二、营业总支出		133,090.71	94,905.56
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	57,808.95	54,886.29
2.托管费	6.4.10.2.2	11,561.85	10,977.26
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用	6.4.7.18	63,719.91	29,042.01
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,749,011.47	-621,740.15
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,749,011.47	-621,740.15
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,749,011.47	-621,740.15

6.3 净资产变动表

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：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	28,060,583.00	-4,676,918.63	23,383,664.37
二、本期期初净资产	28,060,583.00	-4,676,918.63	23,383,664.37

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-1,586,185.10	-1,586,185.10
（一）、综合收益总额	-	-1,749,011.47	-1,749,011.47
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-	162,826.37	162,826.37
其中：1.基金申购款	27,500,000.00	-4,956,778.36	22,543,221.64
2.基金赎回款	-27,500,000.00	5,119,604.73	-22,380,395.27
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	28,060,583.00	-6,263,103.73	21,797,479.27
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	10,560,583.00	-1,226,805.24	9,333,777.76
二、本期期初净资产	10,560,583.00	-1,226,805.24	9,333,777.76
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	50,000,000.00	-3,951,404.33	46,048,595.67
（一）、综合收益总额	-	-621,740.15	-621,740.15
（二）、本期基金	50,000,000.00	-3,329,664.18	46,670,335.82

份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	85,000,000.00	-5,311,856.75	79,688,143.25
2.基金赎回款	-35,000,000.00	1,982,192.57	-33,017,807.43
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	60,560,583.00	-5,178,209.57	55,382,373.43

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

叶文煌

张顺国

楼怡斐

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

兴业中证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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的《兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股及其备选成份股、其他股票(包

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

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
----	--------------------

活期存款	1,767,206.27
等于：本金	1,767,035.84
加：应计利息	170.43
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	1,767,206.27

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	22,333,534.43	-	20,043,416.78	-2,290,117.65
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	22,333,534.43	-	20,043,416.78	-2,290,117.65
----	---------------	---	---------------	---------------

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付交易费用	4,616.31
其中：交易所市场	4,616.31
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	24,863.02
应付指数使用费	1,726.44
合计	31,205.77

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
----	-------------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	28,060,583.00	28,060,583.00
本期申购	27,500,000.00	27,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-27,500,000.00	-27,500,000.00
本期末	28,060,583.00	28,060,583.00

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	403,067.97	-5,079,986.60	-4,676,918.63
本期期初	403,067.97	-5,079,986.60	-4,676,918.63
本期利润	-1,440,983.16	-308,028.31	-1,749,011.47
本期基金份额交易产生的变动数	240,004.19	-77,177.82	162,826.37
其中：基金申购款	-85,352.09	-4,871,426.27	-4,956,778.36
基金赎回款	325,356.28	4,794,248.45	5,119,604.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-797,911.00	-5,465,192.73	-6,263,103.73

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
活期存款利息收入	2,774.66
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	258.87
其他	73.69
合计	3,107.22

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,111,804.76
股票投资收益——赎回差价收入	-393,781.08
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-1,505,585.84

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出股票成交总额	13,084,723.64
减：卖出股票成本总额	14,168,788.80
减：交易费用	27,739.60
买卖股票差价收入	-1,111,804.76

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
赎回基金份额对价总额	22,380,395.27
减：现金支付赎回款总额	12,735,542.27
减：赎回股票成本总额	10,038,634.08
减：交易费用	-
赎回差价收入	-393,781.08

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
----	-------------------------------

债券投资收益——利息收入	1.76
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	980.78
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	982.54

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,983.26
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,000.00
减：应计利息总额	2.48
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	980.78

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益--买卖权证差价收入。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益--其他投资收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	292,082.74
基金投资产生的股利收益	-
合计	292,082.74

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	-308,028.31
——股票投资	-307,330.91
——债券投资	-697.40
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-308,028.31

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
基金赎回费收入	-
ETF基金替代损益	-98,479.11

合计	-98,479.11
----	------------

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期内未发生信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	-
汇划手续费	388.40
其他费用_指数使用费	3,468.49
公证费	10,000.00
律师费	25,000.00
合计	63,719.91

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期间存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
兴业基金管理有限公司(以下简称"兴业基金")	基金管理人
中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(以下简称"中海集团")	基金管理人的股东
兴业财富资产管理有限公司(以下简称"兴业财富")	基金管理人控制的公司
兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	本基金的联接基金

注：下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

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

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至20 24年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至20 23年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	57,808.95	54,886.29
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,913.51	4,549.84

应支付基金管理人的净管理费	53,895.44	50,336.45
---------------	-----------	-----------

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0.50%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×0.50%÷当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	11,561.85	10,977.26

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0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年06月30日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
兴业中证500交易	16,089,900.00	57.3399%	16,800,000.00	59.8705%

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

注：关联方投资本基金采用公允费率，即按照基金法律文件条款执行。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行 股份有限公司	1,767,206.27	2,774.66	3,399,554.84	1,541.84

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率或协议利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期末，本基金持有基金管理人的非控股股东关联方发行的股票中远海发(601866.SH)16,900股，占本基金资产净值的0.2000%(上年度末：16,900股，占本基金资产净值的0.1691%)。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间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

本基金本报告期末持有的债券中无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金所投资证券的发行人出现违约或拒绝支付到期利息、本金，或基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任等，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金基金管理人建立了较为完善的信用风险管理流程，通过对信用债券发行人基本面调研分析，结合流动性、信用利差、信用评级、违约风险等方面的综合评估结果，选取具有价格优势和套利机会的优质信用债券产品进行投资。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。本基金通过对银行间同业市场交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金基金管理人旗下其他基金共同持有一家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。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	-	2,698.72
未评级	-	-
合计	-	2,698.72

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

截止本报告期末及上年度末，本基金无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年0 6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,767,206.27	-	-	-	1,767,206.27
存出保证金	7,738.55	-	-	-	7,738.55
交易性金融资产	-	-	-	20,043,416.78	20,043,416.78
应收清算款	-	-	-	70,426.14	70,426.14
资产总计	1,774,944.82	-	-	20,113,842.92	21,888,787.74
负债					
应付清算款	-	-	-	48,949.98	48,949.98
应付管理人报酬	-	-	-	9,293.92	9,293.92
应付托管费	-	-	-	1,858.80	1,858.80
其他负债	-	-	-	31,205.77	31,205.77
负债总计	-	-	-	91,308.47	91,308.47
利率敏感度缺口	1,774,944.82	-	-	20,022,534.45	21,797,479.27
上年度末 2023年1 2月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					

货币资金	1,456,932.70	-	-	-	1,456,932.70
存出保证金	13,900.59	-	-	-	13,900.59
交易性金融资产	2,698.72	-	-	21,977,315.82	21,980,014.54
资产总计	1,473,532.01	-	-	21,977,315.82	23,450,847.83
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	9,957.69	9,957.69
应付托管费	-	-	-	1,991.55	1,991.55
其他负债	-	-	-	55,234.22	55,234.22
负债总计	-	-	-	67,183.46	67,183.46
利率敏感度缺口	1,473,532.01	-	-	21,910,132.36	23,383,664.37

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
假设	2、利率曲线平行移动		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	市场利率上升25个基点	0.00	-33.05
	市场利率下降25个基点	0.00	33.55

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	20,043,416.78	91.95	21,977,315.82	93.99
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-

一权证投资				
其他	-	-	-	-
合计	20,043,416.78	91.95	21,977,315.82	93.99

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除股票价格以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	股票价格上升5%	1,002,170.84	1,098,865.79
	股票价格下降5%	-1,002,170.84	-1,098,865.79

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	20,043,416.78	21,980,014.54
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	20,043,416.78	21,980,014.54

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间

及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	20,043,416.78	91.57
	其中：股票	20,043,416.78	91.57
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	1,767,206.27	8.07
8	其他各项资产	78,164.69	0.36

9	合计	21,888,787.74	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	133,352.00	0.61
B	采矿业	950,316.00	4.36
C	制造业	12,540,122.32	57.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	828,454.50	3.80
E	建筑业	208,418.00	0.96
F	批发和零售业	449,820.80	2.06
G	交通运输、仓储和邮政业	422,150.00	1.94
H	住宿和餐饮业	63,938.00	0.29
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,175,112.52	5.39
J	金融业	2,070,793.56	9.50
K	房地产业	255,972.00	1.17
L	租赁和商务服务业	179,088.00	0.82
M	科学研究和技术服务业	159,467.68	0.73
N	水利、环境和公共设施管理业	108,103.40	0.50
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	21,420.00	0.10
Q	卫生和社会工作	132,283.00	0.61
R	文化、体育和娱乐业	302,365.00	1.39
S	综合	42,240.00	0.19
	合计	20,043,416.78	91.95

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300502	新易盛	2,300	242,765.00	1.11
2	688169	石头科技	400	157,040.00	0.72
3	002028	思源电气	2,200	147,180.00	0.68
4	600066	宇通客车	5,200	134,160.00	0.62
5	601058	赛轮轮胎	8,800	123,200.00	0.57
6	300394	天孚通信	1,300	114,946.00	0.53
7	002340	格林美	17,900	114,023.00	0.52
8	000630	铜陵有色	31,200	112,632.00	0.52
9	601077	渝农商行	22,400	112,448.00	0.52
10	000988	华工科技	3,700	110,741.00	0.51
11	600418	江淮汽车	6,600	104,544.00	0.48
12	000933	神火股份	5,000	101,150.00	0.46
13	601168	西部矿业	5,500	98,725.00	0.45
14	601128	常熟银行	12,870	97,425.90	0.45
15	002966	苏州银行	12,960	97,200.00	0.45
16	601233	桐昆股份	6,000	95,760.00	0.44
17	002625	光启技术	5,500	95,425.00	0.44
18	002384	东山精密	4,600	95,220.00	0.44
19	000423	东阿阿胶	1,500	93,900.00	0.43
20	300866	安克创新	1,300	92,573.00	0.42
21	600988	赤峰黄金	5,600	91,504.00	0.42
22	601555	东吴证券	15,460	91,214.00	0.42

23	002078	太阳纸业	6,500	90,675.00	0.42
24	002532	天山铝业	11,000	89,210.00	0.41
25	600885	宏发股份	3,220	89,129.60	0.41
26	002138	顺络电子	3,200	87,872.00	0.40
27	002156	通富微电	3,800	85,082.00	0.39
28	002273	水晶光电	5,000	84,900.00	0.39
29	600096	云天化	4,300	83,506.00	0.38
30	600177	雅戈尔	11,700	83,304.00	0.38
31	002223	鱼跃医疗	2,200	82,720.00	0.38
32	600060	海信视像	3,300	81,642.00	0.37
33	002185	华天科技	10,000	81,500.00	0.37
34	300474	景嘉微	1,250	79,037.50	0.36
35	000009	中国宝安	9,110	78,346.00	0.36
36	002465	海格通信	7,500	77,700.00	0.36
37	600486	扬农化工	1,370	77,336.50	0.35
38	600352	浙江龙盛	9,000	77,310.00	0.35
39	002353	杰瑞股份	2,200	77,176.00	0.35
40	600157	永泰能源	64,800	76,464.00	0.35
41	600563	法拉电子	1,000	76,180.00	0.35
42	002128	电投能源	3,600	75,960.00	0.35
43	300207	欣旺达	5,000	75,850.00	0.35
44	600079	人福医药	4,400	75,548.00	0.35
45	601108	财通证券	11,400	75,354.00	0.35
46	300017	网宿科技	9,300	73,470.00	0.34
47	600348	华阳股份	7,350	73,206.00	0.34
48	300003	乐普医疗	4,900	72,716.00	0.33
49	300136	信维通信	3,700	72,446.00	0.33
50	000400	许继电气	2,100	72,261.00	0.33
51	000932	华菱钢铁	16,300	72,209.00	0.33
52	002797	第一创业	14,100	71,769.00	0.33
53	301236	软通动力	2,000	70,420.00	0.32

54	600873	梅花生物	7,000	70,140.00	0.32
55	601179	中国西电	8,700	69,948.00	0.32
56	002409	雅克科技	1,100	69,201.00	0.32
57	000783	长江证券	14,300	69,069.00	0.32
58	600497	驰宏锌锗	12,900	68,886.00	0.32
59	600642	申能股份	7,800	68,874.00	0.32
60	601990	南京证券	8,900	68,352.00	0.31
61	600109	国金证券	9,000	67,950.00	0.31
62	600765	中航重机	3,300	67,320.00	0.31
63	002281	光迅科技	1,800	67,266.00	0.31
64	603345	安井食品	900	66,879.00	0.31
65	002517	恺英网络	7,000	66,850.00	0.31
66	000039	中集集团	7,200	66,672.00	0.31
67	600398	海澜之家	7,200	66,528.00	0.31
68	601577	长沙银行	8,000	65,440.00	0.30
69	300012	华测检测	6,500	65,390.00	0.30
70	603816	顾家家居	2,000	64,580.00	0.30
71	002444	巨星科技	2,600	64,220.00	0.29
72	002673	西部证券	10,300	63,757.00	0.29
73	600839	四川长虹	14,100	63,309.00	0.29
74	000728	国元证券	10,400	63,024.00	0.29
75	601567	三星医疗	1,800	63,000.00	0.29
76	600141	兴发集团	3,300	62,964.00	0.29
77	600879	航天电子	8,100	62,937.00	0.29
78	300037	新宙邦	2,200	62,832.00	0.29
79	002008	大族激光	3,000	62,400.00	0.29
80	000878	云南铜业	5,000	62,300.00	0.29
81	000683	远兴能源	9,000	62,190.00	0.29
82	600862	中航高科	3,300	61,974.00	0.28
83	600985	淮北矿业	3,700	61,938.00	0.28
84	603160	汇顶科技	900	61,875.00	0.28

85	300395	菲利华	2,000	61,500.00	0.28
86	600298	安琪酵母	2,200	61,446.00	0.28
87	600895	张江高科	3,300	60,984.00	0.28
88	603338	浙江鼎力	1,000	60,420.00	0.28
89	601997	贵阳银行	11,400	60,078.00	0.28
90	002155	湖南黄金	3,300	59,730.00	0.27
91	600536	中国软件	1,995	59,690.40	0.27
92	300724	捷佳伟创	1,100	59,411.00	0.27
93	601717	郑煤机	4,000	59,200.00	0.27
94	603939	益丰药房	2,400	58,920.00	0.27
95	300285	国瓷材料	3,300	58,905.00	0.27
96	002195	岩山科技	23,400	58,734.00	0.27
97	002294	信立泰	2,200	58,586.00	0.27
98	000921	海信家电	1,800	58,032.00	0.27
99	000021	深科技	3,800	57,456.00	0.26
100	000960	锡业股份	3,700	57,313.00	0.26
101	600153	建发股份	6,400	57,152.00	0.26
102	600820	隧道股份	8,700	56,811.00	0.26
103	300487	蓝晓科技	1,350	56,376.00	0.26
104	601696	中银证券	6,200	56,296.00	0.26
105	300058	蓝色光标	10,300	56,032.00	0.26
106	000703	恒逸石化	7,900	56,011.00	0.26
107	601666	平煤股份	5,000	56,000.00	0.26
108	000831	中国稀土	2,200	55,770.00	0.26
109	600529	山东药玻	2,200	55,748.00	0.26
110	600863	内蒙华电	11,900	55,216.00	0.25
111	000066	中国长城	6,300	55,125.00	0.25
112	600699	均胜电子	3,700	54,834.00	0.25
113	002202	金风科技	8,100	54,432.00	0.25
114	300529	健帆生物	2,000	54,420.00	0.25
115	000738	航发控制	2,700	54,189.00	0.25

116	600546	山煤国际	3,700	54,094.00	0.25
117	603444	吉比特	300	53,403.00	0.24
118	603893	瑞芯微	900	53,253.00	0.24
119	002739	万达电影	4,400	53,196.00	0.24
120	601000	唐山港	11,300	53,110.00	0.24
121	600369	西南证券	14,800	52,984.00	0.24
122	600704	物产中大	12,200	52,948.00	0.24
123	600521	华海药业	3,100	52,855.00	0.24
124	300146	汤臣倍健	3,900	52,845.00	0.24
125	002738	中矿资源	1,960	52,528.00	0.24
126	601162	天风证券	24,000	52,320.00	0.24
127	300001	特锐德	2,600	52,312.00	0.24
128	300144	宋城演艺	6,500	52,195.00	0.24
129	002385	大北农	13,500	51,975.00	0.24
130	600282	南钢股份	10,400	51,792.00	0.24
131	600549	厦门钨业	3,000	51,750.00	0.24
132	000830	鲁西化工	4,400	50,996.00	0.23
133	601615	明阳智能	5,400	50,976.00	0.23
134	603589	口子窖	1,300	50,947.00	0.23
135	000623	吉林敖东	3,800	50,920.00	0.23
136	300567	精测电子	900	50,859.00	0.23
137	603658	安图生物	1,100	50,677.00	0.23
138	603596	伯特利	1,300	50,570.00	0.23
139	600637	东方明珠	8,300	50,464.00	0.23
140	600867	通化东宝	6,000	50,220.00	0.23
141	002152	广电运通	4,800	50,208.00	0.23
142	601198	东兴证券	6,300	50,148.00	0.23
143	300699	光威复材	2,000	49,660.00	0.23
144	002595	豪迈科技	1,300	49,621.00	0.23
145	002436	兴森科技	4,800	49,536.00	0.23
146	600021	上海电力	5,000	49,450.00	0.23

147	000729	燕京啤酒	5,600	49,448.00	0.23
148	600118	中国卫星	2,200	48,906.00	0.22
149	300088	长信科技	10,400	48,880.00	0.22
149	000598	兴蓉环境	6,500	48,880.00	0.22
151	603606	东方电缆	1,000	48,810.00	0.22
152	600763	通策医疗	900	48,645.00	0.22
153	002508	老板电器	2,200	48,620.00	0.22
154	002407	多氟多	3,960	48,430.80	0.22
155	000519	中兵红箭	3,300	48,411.00	0.22
156	601966	玲珑轮胎	2,600	47,762.00	0.22
157	000723	美锦能源	10,000	47,600.00	0.22
158	002262	恩华药业	2,000	47,480.00	0.22
159	000027	深圳能源	6,500	47,450.00	0.22
160	002558	巨人网络	5,000	47,200.00	0.22
161	600970	中材国际	3,900	47,034.00	0.22
162	000883	湖北能源	7,800	46,878.00	0.22
163	603156	养元饮品	2,200	46,794.00	0.21
164	300024	机器人	4,800	46,752.00	0.21
165	300383	光环新网	5,500	46,475.00	0.21
166	002025	航天电器	1,000	46,380.00	0.21
167	605358	立昂微	2,000	46,280.00	0.21
168	600143	金发科技	7,000	46,270.00	0.21
169	000997	新大陆	3,300	45,903.00	0.21
170	600909	华安证券	10,890	45,846.90	0.21
171	002850	科达利	600	45,828.00	0.21
172	603979	金诚信	900	45,477.00	0.21
173	000750	国海证券	15,600	45,396.00	0.21
174	300114	中航电测	1,000	45,250.00	0.21
175	600038	中直股份	1,100	45,221.00	0.21
176	002439	启明星辰	2,600	44,876.00	0.21
177	603568	伟明环保	2,180	44,864.40	0.21

178	600582	天地科技	6,500	44,785.00	0.21
179	601016	节能风电	14,970	44,760.30	0.21
180	000513	丽珠集团	1,200	44,652.00	0.20
181	002430	杭氧股份	2,000	44,500.00	0.20
182	300776	帝尔激光	960	44,121.60	0.20
183	002472	双环传动	2,000	44,040.00	0.20
184	600535	天士力	3,500	44,030.00	0.20
185	603000	人民网	2,200	43,978.00	0.20
186	600008	首创环保	16,390	43,925.20	0.20
187	300002	神州泰岳	5,400	43,848.00	0.20
188	600499	科达制造	5,200	43,836.00	0.20
189	600998	九州通	8,981	43,827.28	0.20
190	000060	中金岭南	10,300	43,672.00	0.20
191	601866	中远海发	16,900	43,602.00	0.20
192	600380	健康元	3,900	43,563.00	0.20
193	002984	森麒麟	1,800	43,362.00	0.20
194	600392	盛和资源	5,000	43,100.00	0.20
195	000636	风华高科	3,300	43,098.00	0.20
196	603379	三美股份	1,100	43,054.00	0.20
197	603486	科沃斯	900	42,462.00	0.19
198	000591	太阳能	9,000	42,390.00	0.19
199	600325	华发股份	6,500	42,250.00	0.19
200	600673	东阳光	6,000	42,240.00	0.19
201	002926	华西证券	6,400	42,176.00	0.19
202	300251	光线传媒	5,000	42,050.00	0.19
203	601636	旗滨集团	6,500	41,925.00	0.19
204	300253	卫宁健康	7,100	41,890.00	0.19
205	603087	甘李药业	900	41,688.00	0.19
206	600583	海油工程	7,000	41,370.00	0.19
206	600155	华创云信	7,000	41,370.00	0.19
208	600498	烽火通信	2,600	41,340.00	0.19

209	002056	横店东磁	3,300	41,151.00	0.19
210	600707	彩虹股份	6,000	40,860.00	0.19
211	600872	中炬高新	1,800	40,842.00	0.19
212	300054	鼎龙股份	1,800	40,824.00	0.19
213	603225	新凤鸣	2,612	40,721.08	0.19
214	601156	东航物流	2,000	40,700.00	0.19
215	600170	上海建工	18,900	40,635.00	0.19
216	603826	坤彩科技	1,400	40,558.00	0.19
217	002432	九安医疗	1,000	40,540.00	0.19
218	600166	福田汽车	18,000	40,500.00	0.19
218	000629	钒钛股份	16,200	40,500.00	0.19
220	002500	山西证券	8,600	40,420.00	0.19
221	000887	中鼎股份	3,300	40,392.00	0.19
222	002065	东华软件	8,900	40,228.00	0.18
223	002372	伟星新材	2,600	40,092.00	0.18
224	600511	国药股份	1,300	40,027.00	0.18
225	002429	兆驰股份	8,300	39,923.00	0.18
226	000818	航锦科技	1,800	39,744.00	0.18
227	002497	雅化集团	4,400	39,248.00	0.18
228	002203	海亮股份	4,900	39,102.00	0.18
229	300373	扬杰科技	1,000	38,900.00	0.18
230	600580	卧龙电驱	3,200	38,880.00	0.18
231	002064	华峰化学	5,400	38,718.00	0.18
232	002120	韵达股份	5,000	38,700.00	0.18
233	601456	国联证券	4,000	38,560.00	0.18
234	601958	金钼股份	3,700	38,517.00	0.18
235	300676	华大基因	1,100	38,511.00	0.18
236	603688	石英股份	1,300	38,493.00	0.18
237	000998	隆平高科	3,900	38,337.00	0.18
238	300070	碧水源	9,100	38,129.00	0.17
239	002624	完美世界	5,000	38,000.00	0.17

240	688114	华大智造	800	37,928.00	0.17
241	600004	白云机场	4,000	37,920.00	0.17
242	002044	美年健康	10,000	37,800.00	0.17
243	300009	安科生物	4,420	37,746.80	0.17
244	300073	当升科技	1,100	37,741.00	0.17
245	300763	锦浪科技	900	37,476.00	0.17
246	600737	中粮糖业	3,900	37,401.00	0.17
247	600755	厦门国贸	5,200	37,284.00	0.17
248	002958	青农商行	13,800	36,984.00	0.17
249	603077	和邦生物	22,400	36,960.00	0.17
250	300296	利亚德	8,200	36,900.00	0.17
251	600390	五矿资本	9,100	36,855.00	0.17
252	600754	锦江酒店	1,600	36,768.00	0.17
253	002507	涪陵榨菜	3,000	36,750.00	0.17
254	601216	君正集团	9,900	36,531.00	0.17
255	300677	英科医疗	1,360	36,461.60	0.17
256	603712	七一二	2,000	36,380.00	0.17
257	300118	东方日升	3,000	36,300.00	0.17
258	603728	鸣志电器	900	36,207.00	0.17
259	002936	郑州银行	20,892	36,143.16	0.17
260	600655	豫园股份	7,000	36,050.00	0.17
261	002408	齐翔腾达	6,400	35,840.00	0.16
262	300558	贝达药业	1,100	35,805.00	0.16
263	002756	永兴材料	1,000	35,780.00	0.16
264	600329	达仁堂	1,100	35,629.00	0.16
265	002299	圣农发展	2,600	35,464.00	0.16
266	002373	千方科技	3,900	35,373.00	0.16
267	603298	杭叉集团	1,800	35,352.00	0.16
267	601665	齐鲁银行	7,200	35,352.00	0.16
269	002414	高德红外	6,000	35,340.00	0.16
270	603179	新泉股份	900	35,316.00	0.16

271	002572	索菲亚	2,300	35,259.00	0.16
272	600859	王府井	3,000	35,220.00	0.16
273	603228	景旺电子	1,100	34,980.00	0.16
274	000050	深天马 A	4,800	34,944.00	0.16
275	600516	方大炭素	8,100	34,911.00	0.16
276	600566	济川药业	1,100	34,881.00	0.16
277	300390	天华新能	2,030	34,875.40	0.16
278	688180	君实生物	1,200	34,860.00	0.16
279	002244	滨江集团	4,800	34,848.00	0.16
280	603737	三棵树	960	34,819.20	0.16
281	600373	中文传媒	2,300	34,132.00	0.16
282	600968	海油发展	8,200	33,784.00	0.15
283	002653	海思科	1,100	33,770.00	0.15
284	000778	新兴铸管	9,700	33,756.00	0.15
285	600131	国网信通	2,000	33,740.00	0.15
286	600848	上海临港	3,700	33,707.00	0.15
287	600528	中铁工业	4,600	33,672.00	0.15
288	002568	百润股份	2,000	33,660.00	0.15
289	600435	北方导航	3,900	33,618.00	0.15
290	002939	长城证券	5,000	33,500.00	0.15
291	601933	永辉超市	13,500	33,480.00	0.15
292	603858	步长制药	2,200	33,330.00	0.15
293	002831	裕同科技	1,300	33,267.00	0.15
294	601598	中国外运	5,900	33,217.00	0.15
294	600399	抚顺特钢	5,900	33,217.00	0.15
296	002670	国盛金控	3,900	33,033.00	0.15
297	600801	华新水泥	2,400	33,000.00	0.15
298	603885	吉祥航空	3,000	32,970.00	0.15
299	300568	星源材质	4,000	32,800.00	0.15
300	000709	河钢股份	16,900	32,786.00	0.15
301	300803	指南针	900	32,769.00	0.15

302	600739	辽宁成大	3,900	32,643.00	0.15
303	601991	大唐发电	10,800	32,508.00	0.15
304	603650	彤程新材	1,100	32,505.00	0.15
305	600884	杉杉股份	4,000	32,480.00	0.15
306	601611	中国核建	4,000	32,360.00	0.15
307	000893	亚钾国际	2,000	32,320.00	0.15
308	601098	中南传媒	2,600	32,292.00	0.15
309	002019	亿帆医药	2,600	32,136.00	0.15
310	601231	环旭电子	2,000	32,100.00	0.15
311	600901	江苏金租	6,340	32,017.00	0.15
312	002506	协鑫集成	16,500	32,010.00	0.15
313	603927	中科软	1,768	31,983.12	0.15
314	600816	建元信托	11,700	31,707.00	0.15
315	600483	福能股份	2,700	31,482.00	0.14
316	300595	欧普康视	2,000	31,360.00	0.14
317	002268	电科网安	2,200	31,306.00	0.14
318	300601	康泰生物	2,000	31,220.00	0.14
319	002557	洽洽食品	1,100	31,009.00	0.14
320	000825	太钢不锈	9,100	30,758.00	0.14
321	603456	九洲药业	2,200	30,184.00	0.14
322	600598	北大荒	2,400	29,976.00	0.14
323	002261	拓维信息	2,700	29,889.00	0.14
324	000739	普洛药业	2,200	29,854.00	0.14
325	600416	湘电股份	3,000	29,820.00	0.14
326	600906	财达证券	5,200	29,796.00	0.14
327	601118	海南橡胶	6,500	29,575.00	0.14
328	600271	航天信息	4,000	29,440.00	0.14
329	002368	太极股份	1,300	29,315.00	0.13
330	000155	川能动力	2,700	29,079.00	0.13
331	600995	南网储能	3,000	28,980.00	0.13
332	600129	太极集团	1,000	28,920.00	0.13

333	600378	昊华科技	1,000	28,900.00	0.13
334	603883	老百姓	1,557	28,586.52	0.13
335	601928	凤凰传媒	2,600	28,496.00	0.13
336	301358	湖南裕能	900	28,314.00	0.13
337	600517	国网英大	6,500	28,145.00	0.13
338	000987	越秀资本	5,660	28,073.60	0.13
339	000563	陕国投 A	10,000	27,500.00	0.13
340	601880	辽港股份	22,200	27,306.00	0.13
341	603882	金域医学	1,000	27,190.00	0.12
342	600258	首旅酒店	2,200	27,170.00	0.12
342	300604	长川科技	1,000	27,170.00	0.12
344	601608	中信重工	7,100	27,051.00	0.12
345	603707	健友股份	2,271	26,979.48	0.12
346	002240	盛新锂能	2,000	26,840.00	0.12
347	002531	天顺风能	3,000	26,820.00	0.12
348	600056	中国医药	2,620	26,514.40	0.12
349	002683	广东宏大	1,300	26,169.00	0.12
350	000937	冀中能源	3,900	26,130.00	0.12
351	600208	新湖中宝	16,500	26,070.00	0.12
352	688331	荣昌生物	600	25,920.00	0.12
353	002080	中材科技	2,000	25,800.00	0.12
354	600062	华润双鹤	1,300	25,454.00	0.12
355	600377	宁沪高速	2,000	25,200.00	0.12
356	002266	浙富控股	9,000	25,110.00	0.12
357	601212	白银有色	9,000	25,020.00	0.11
358	300748	金力永磁	1,920	24,883.20	0.11
359	300888	稳健医疗	980	24,794.00	0.11
360	002423	中粮资本	3,300	24,717.00	0.11
361	603529	爱玛科技	900	24,597.00	0.11
362	600871	石化油服	14,000	24,360.00	0.11
363	600827	百联股份	3,300	24,354.00	0.11

364	601155	新城控股	2,700	23,949.00	0.11
365	600967	内蒙一机	3,300	23,760.00	0.11
365	600959	江苏有线	9,000	23,760.00	0.11
367	000559	万向钱潮	5,200	23,192.00	0.11
368	001286	陕西能源	2,000	23,060.00	0.11
369	688122	西部超导	600	22,992.00	0.11
370	600663	陆家嘴	2,600	22,932.00	0.11
371	002487	大金重工	1,000	22,880.00	0.10
372	601992	金隅集团	16,700	22,879.00	0.10
373	600925	苏能股份	4,500	22,725.00	0.10
374	300765	新诺威	900	22,707.00	0.10
375	603218	日月股份	2,200	22,594.00	0.10
376	300212	易华录	1,340	22,552.20	0.10
377	300357	我武生物	1,100	22,242.00	0.10
378	003035	南网能源	5,000	22,000.00	0.10
379	601106	中国一重	9,500	21,945.00	0.10
380	600316	洪都航空	1,300	21,619.00	0.10
381	600764	中国海防	1,100	21,593.00	0.10
382	600977	中国电影	2,000	21,520.00	0.10
383	002607	中公教育	14,000	21,420.00	0.10
383	001227	兰州银行	9,000	21,420.00	0.10
385	601019	山东出版	1,800	21,276.00	0.10
386	001872	招商港口	1,100	21,175.00	0.10
387	000537	中绿电	2,200	20,966.00	0.10
388	600500	中化国际	6,000	20,940.00	0.10
389	601399	国机重装	8,100	20,898.00	0.10
390	002690	美亚光电	1,250	20,625.00	0.09
391	000898	鞍钢股份	9,700	20,564.00	0.09
392	600578	京能电力	6,300	20,412.00	0.09
393	600126	杭钢股份	4,800	19,728.00	0.09
394	603233	大参林	1,372	19,619.60	0.09

395	600808	马钢股份	9,700	19,594.00	0.09
396	600315	上海家化	1,100	19,558.00	0.09
397	600350	山东高速	2,200	19,470.00	0.09
398	000785	居然之家	8,000	19,440.00	0.09
399	000958	电投产融	5,300	19,398.00	0.09
400	002608	江苏国信	2,500	19,375.00	0.09
401	300861	美畅股份	1,000	19,350.00	0.09
402	603786	科博达	300	19,245.00	0.09
403	688005	容百科技	825	19,206.00	0.09
404	002563	森马服饰	3,300	19,173.00	0.09
405	601298	青岛港	2,000	19,120.00	0.09
406	000156	华数传媒	3,000	18,840.00	0.09
407	600481	双良节能	4,000	18,680.00	0.09
408	301267	华夏眼科	900	18,648.00	0.09
409	603127	昭衍新药	1,384	18,365.68	0.08
410	300438	鹏辉能源	1,000	18,340.00	0.08
411	000967	盈峰环境	4,300	18,189.00	0.08
412	600339	中油工程	5,800	18,096.00	0.08
413	301029	怡合达	920	18,087.20	0.08
414	600095	湘财股份	3,000	17,880.00	0.08
415	002518	科士达	1,000	17,700.00	0.08
416	002867	周大生	1,350	17,631.00	0.08
417	600098	广州发展	2,700	17,280.00	0.08
418	603290	斯达半导	200	17,222.00	0.08
419	601858	中国科传	900	17,208.00	0.08
420	603185	弘元绿能	1,000	17,090.00	0.08
421	300682	朗新集团	2,000	17,020.00	0.08
422	002153	石基信息	2,960	16,960.80	0.08
423	603517	绝味食品	1,100	16,940.00	0.08
424	601568	北元集团	4,500	16,695.00	0.08
425	600022	山东钢铁	13,600	16,592.00	0.08

426	603317	天味食品	1,396	15,928.36	0.07
427	000401	冀东水泥	3,900	15,834.00	0.07
428	601228	广州港	5,000	15,250.00	0.07
429	000539	粤电力 A	3,000	15,240.00	0.07
430	601965	中国汽研	900	15,201.00	0.07
431	688777	中控技术	400	15,080.00	0.07
432	688349	三一重能	600	14,904.00	0.07
433	600928	西安银行	4,500	14,715.00	0.07
434	601139	深圳燃气	2,200	14,696.00	0.07
435	000959	首钢股份	5,400	14,688.00	0.07
436	600361	创新新材	3,600	14,508.00	0.07
437	603056	德邦股份	1,100	14,410.00	0.07
438	003022	联泓新科	1,000	13,710.00	0.06
439	000032	深桑达 A	900	13,482.00	0.06
440	600032	浙江新能	1,800	13,104.00	0.06
441	688525	佰维存储	200	12,830.00	0.06
442	600299	安迪苏	1,300	12,610.00	0.06
443	001203	大中矿业	1,300	12,493.00	0.06
444	600927	永安期货	1,100	12,265.00	0.06
445	600612	老凤祥	200	11,638.00	0.05
446	603868	飞科电器	300	11,520.00	0.05
447	000031	大悦城	4,800	11,232.00	0.05
448	688425	铁建重工	3,000	11,040.00	0.05
449	002945	华林证券	1,100	10,978.00	0.05
450	688213	思特威	200	9,700.00	0.04
451	601158	重庆水务	2,000	9,600.00	0.04
452	603305	旭升集团	900	9,504.00	0.04
453	003031	中瓷电子	200	9,248.00	0.04
454	601828	美凯龙	3,600	9,180.00	0.04
455	688065	凯赛生物	200	9,078.00	0.04
456	600956	新天绿能	1,100	8,987.00	0.04

457	002865	钧达股份	200	7,676.00	0.04
458	688475	萤石网络	200	6,822.00	0.03
459	688387	信科移动	1,200	6,048.00	0.03
460	301165	锐捷网络	200	5,968.00	0.03
461	002791	坚朗五金	200	5,174.00	0.02
462	688561	奇安信	200	4,724.00	0.02
463	688172	燕东微	200	3,236.00	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	300502	新易盛	179,409.20	0.77
2	688169	石头科技	157,432.00	0.67
3	300394	天孚通信	139,596.00	0.60
4	002028	思源电气	134,522.00	0.58
5	300418	昆仑万维	130,429.00	0.56
6	002422	科伦药业	123,596.00	0.53
7	002463	沪电股份	122,168.00	0.52
8	000933	神火股份	106,208.00	0.45
9	000988	华工科技	106,194.00	0.45
10	000975	山金国际	104,378.00	0.45
11	002340	格林美	100,300.00	0.43
12	301236	软通动力	96,296.00	0.41
13	002966	苏州银行	95,155.00	0.41
14	300866	安克创新	91,922.00	0.39
15	002078	太阳纸业	91,842.00	0.39

16	000630	铜陵有色	91,600.00	0.39
17	300037	新宙邦	90,962.00	0.39
18	002517	恺英网络	90,706.00	0.39
19	002138	顺络电子	89,213.00	0.38
20	000009	中国宝安	88,713.00	0.38

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	002463	沪电股份	289,495.00	1.24
2	300418	昆仑万维	256,710.00	1.10
3	002422	科伦药业	249,704.00	1.07
4	000975	山金国际	228,448.00	0.98
5	300394	天孚通信	150,401.00	0.64
6	300502	新易盛	150,304.60	0.64
7	002028	思源电气	134,543.00	0.58
8	600160	巨化股份	116,549.00	0.50
9	002032	苏泊尔	115,008.00	0.49
10	000988	华工科技	107,288.00	0.46
11	000933	神火股份	107,022.00	0.46
12	002600	领益智造	104,832.00	0.45
13	002340	格林美	100,589.00	0.43
14	301236	软通动力	99,617.00	0.43
15	600415	小商品城	95,931.00	0.41
16	002966	苏州银行	95,544.00	0.41
17	002131	利欧股份	94,564.00	0.40
18	000630	铜陵有色	93,125.00	0.40
19	600161	天坛生物	92,766.00	0.40

20	002078	太阳纸业	91,656.00	0.39
----	--------	------	-----------	------

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	13,081,946.75
卖出股票收入（成交）总额	13,084,723.64

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包含国债期货

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金投资范围不包含国债期货

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内基金投资的前十名证券不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本基金为指数型基金，上述股票系标的指数成分股，投资决策程序符合公司投资制度的规定。

7.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	7,738.55
2	应收清算款	70,426.14
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	78,164.69

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债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
495	56,688.05	18,205,490.00	64.8792%	9,855,093.00	35.1208%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中国银行股份有限公司-兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	16,089,900.00	57.34%
2	许安澜	1,100,000.00	3.92%
3	许梅蓉	1,060,000.00	3.78%
4	华泰证券股份有限公司	982,390.00	3.50%
5	兴银理财有限责任公司-兴银理财兴承恒享增盈两年定期开放3号固收类理财产品	615,400.00	2.19%
6	高芸	500,000.00	1.78%
7	马敬兴	356,700.00	1.27%
8	杨儒超	293,000.00	1.04%
9	兴银理财有限责任公司-兴银理财灵动全天候10号净值型理财产品	267,800.00	0.95%
10	兴银理财有限责任公司-兴银理财增盈稳享封闭式28号固收类理财产品	250,000.00	0.89%

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	28,060,583.00
本报告期基金总申购份额	27,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	27,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	28,060,583.00

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金于2024年3月7日至2024年3月21日以通讯方式召开了基金份额持有人大会，2024年3月22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》，决议自该日起生效。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、2024年3月22日，钱睿南先生离任兴业基金管理有限公司副总经理职务。详见本公司于2024年3月23日发布的《兴业基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。

2、本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，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。

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	
长江证券	2	4,276,082.88	16.34%	3,189.57	16.34%	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	21,890,587.51	83.66%	16,328.52	83.66%	-
华安证券	2	-	-	-	-	-

华创 证券	2	-	-	-	-	-
天风 证券	2	-	-	-	-	-
兴业 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法违规行为而受到有关管理机关处罚。iii 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，合规风控能力较强，并能满足各产品运作高度保密的要求。iv 具备各标准化产品运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理各标准化产品进行证券交易的需要，并能为各标准化产品提供全面的信息服务，交易能力较强。v 研究综合实力较强。vi 其他因素（例如，虽综合能力一般，但在某些特色领域或行业，其研究能力、深度和质量在行业领先）。开立交易单元原则上券商应至少已提供两个季度以上的研究服务，并且在最近一季度服务评价评分中排名在前十名。

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

③在上述租用的券商交易单元中，本期无新增交易单元，无剔除交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期间无租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

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	兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金2023年第四季度报告	中国证监会规定的媒介	2024-01-22
2	兴业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	中国证监会规定的媒介	2024-02-19

	的公告		
3	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	2024-02-20
4	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二次提示性公告	中国证监会规定的媒介	2024-02-21
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	中国证监会规定的媒介	2024-03-01
6	兴业基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金风险评价结果的通知	中国证监会规定的媒介	2024-03-21
7	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	2024-03-23
8	兴业基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定的媒介	2024-03-23
9	兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金2023年年度报告	中国证监会规定的媒介	2024-03-30
10	兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金2024年第一季度报告	中国证监会规定的媒介	2024-04-20
11	兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定的媒介	2024-06-22

12	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	2024-06-25
13	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）（2024年第2号）	中国证监会规定的媒介	2024-06-25

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20240305-20240306	0.00	12,077,300.00	12,077,300.00	0.00	0.00%
联接基金	1	20240101-20240630	16,800,000.00	40,000.00	750,100.00	16,089,900.00	57.34%

产品特有风险

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

上述份额占比为四舍五入，保留两位小数后的结果。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

兴业中证500交易型开放式指数证券投资基金于2024年3月7日至2024年3月21日以通讯方式召开了基金份额持有人大会，2024年3月22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》，决议自该日起生效。

§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
二〇二四年八月三十日