

兴银中证 500 指数增强型证券投资基金

2025 年中期报告

2025 年 06 月 30 日

基金管理人:兴银基金管理有限责任公司

基金托管人:浙商银行股份有限公司

报告送出日期:2025 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及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。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年8月29日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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2025年1月1日起至6月30日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 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	8
3.3 其他指标	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
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	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13

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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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	53
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	53
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	53
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	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54

7.12 投资组合报告附注	54
§ 8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
8.3 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	55
§ 9 开放式基金份额变动	56
§ 10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
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	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
10.8 其他重大事件	58
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§ 12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴银中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	兴银中证 500 指数增强	
基金主代码	010253	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 03 月 01 日	
基金管理人	兴银基金管理有限责任公司	
基金托管人	浙商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	82,527,644.11 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	兴银中证 500 指数增强 A	兴银中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	010253	011205
报告期末下属分级基金的份 额总额	33,043,997.05 份	49,483,647.06 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型指数基金，在力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年化跟踪误差不超过 7.75%的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力求实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。	
投资策略	本基金为指数增强型股票基金，采取定量方法进行组合管理，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.75%的基础上，追求获得超越标的指数的回报。本基金主要投资于中证 500 指数的成份股及备选成份股，为了获得超越指数的投资回报，可以在被动跟踪指数的基础上进行一些优化调整，如在一定幅度内减少或增强成份股的权重、替换或者增加一些非成份股。	
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%	
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数类似的风险收益特征。	
	兴银中证 500 指数增强 A	兴银中证 500 指数增强 C
下属分级基金的风险收益特征	风险收益特征同上。	风险收益特征同上。

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		兴银基金管理有限责任公司	浙商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴真子	林彬
	联系电话	86-21-20296358	0571-88269636
	电子邮箱	wzz@hffunds.cn	zsyhzctgb@czbank.com
客户服务电话		40000-96326	95527
传真		86-21-68630069	0571-88268688
注册地址		福建省泉州市丰泽区滨海街 102 号厦门银行泉州分行大厦 19 楼 1908	浙江省杭州市萧山区鸿宁路 1788 号
办公地址		中国上海市浦东新区滨江大道 5129 号陆家嘴滨江中心 N1 幢三层、五层	杭州市拱墅区环城西路 76 号
邮政编码		200120	310006
法定代表人		易勇	陈海强（代为履行法定代表人职责）

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.hffunds.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	兴银基金管理有限责任公司	上海市浦东新区滨江大道 5129 号陆家嘴滨江中心 N1 幢三层、五层

§ 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（2025 年 01 月 01 日-2025 年 06 月 30 日）	
	兴银中证 500 指数增强 A	兴银中证 500 指数增强 C
本期已实现收益	774,657.47	1,121,829.72
本期利润	2,409,009.19	3,612,347.70
加权平均基金份额本期利润	0.0749	0.0674

本期加权平均净值利润率	8.21%	7.46%
本期基金份额净值增长率	7.36%	7.25%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2025 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	-1,504,133.37	-2,681,717.86
期末可供分配基金份额利润	-0.0455	-0.0542
期末基金资产净值	31,820,237.15	47,213,008.11
期末基金份额净值	0.9630	0.9541
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2025 年 06 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	-3.70%	-4.59%

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。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），即如果期末未分配利润（报表数，下同）的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

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。

3.2 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

兴银中证 500 指数增强 A 净值表现

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①—③	②—④
过去一个月	5.12%	0.73%	4.09%	0.75%	1.03%	-0.02%
过去三个月	3.92%	1.44%	0.97%	1.43%	2.95%	0.01%
过去六个月	7.36%	1.26%	3.21%	1.29%	4.15%	-0.03%
过去一年	20.86%	1.50%	18.83%	1.64%	2.03%	-0.14%
过去三年	-6.31%	1.19%	-7.61%	1.29%	1.30%	-0.10%
自基金合同生 效起至今	-3.70%	1.20%	-6.24%	1.25%	2.54%	-0.05%

兴银中证 500 指数增强 C 净值表现

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①—③	②—④
过去一个月	5.10%	0.74%	4.09%	0.75%	1.01%	-0.01%
过去三个月	3.85%	1.44%	0.97%	1.43%	2.88%	0.01%
过去六个月	7.25%	1.26%	3.21%	1.29%	4.04%	-0.03%
过去一年	20.60%	1.50%	18.83%	1.64%	1.77%	-0.14%

过去三年	-6.88%	1.19%	-7.61%	1.29%	0.73%	-0.10%
自基金合同生效起至今	-4.59%	1.20%	-6.24%	1.25%	1.65%	-0.05%

注：1、本基金成立于 2021 年 3 月 1 日；2、比较基准：中证 500 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021年03月01日-2025年06月30日)



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021年03月01日-2025年06月30日)



注：1、本基金成立于 2021 年 3 月 1 日；2、比较基准：中证 500 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。

3.3 其他指标

注：无。

§ 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

兴银基金管理有限责任公司，注册地为福建省泉州市丰泽区，公司主要办公场所位于上海市浦东新区。公司股东为华福证券有限责任公司与国脉科技股份有限公司。本公司经证监会证监许可（2013）1289 号文批准，于 2013 年 10 月 25 日成立。2016 年 9 月 23 日，公司股东同比例增资，公司注册资本由 10,000 万元变更为 14,300 万元。增资后股东出资比例维持不变，华福证券有限责任公司出资比例为 76%，国脉科技股份有限公司出资比例为 24%。2016 年 10 月 24 日，公司法定名称由“华福基金管理有限责任公司”变更为“兴银基金管理有限责任公司”。截至报告期末，本公司共管理基金 60 只。

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		
翁子晨	本基金的基金经理。	2024-07-26	-	4 年	硕士研究生，FRM（金融风险管理师），具有基金从业资格。历任致诚卓远（珠海）投资管理合伙企业（有限合伙）研究员、华兴证券有限公司研究员、成都朋锦仲阳投资管理中心（有限合伙）研究员。2023 年 3 月加入兴银基金管理有限责任公司，历任指数与量化投资部研究员、基金经理助理，现任指数与量化投资部基金经理。

注：1、任职日期和离任日期一般情况下指公司做出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

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《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规的规定，基金合同、招募说明书等基金法律文件的约定，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，不存在违法违规或损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，本基金管理人按照法律法规关于公平交易的相关规定，严格执行公司公平交易管理制度，加强了对所管理的不同投资组合间向交易价差的分析，确保公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人制定了异常交易监控管理的制度，并根据法律法规及监管规定结合实践予以修订完善。本报告期内，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

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

本基金的收益来源主要包括基准指数收益（Beta）和相对于基准的超额收益（Alpha）。由于本基金的业绩基准已固定，以下将重点阐述本基金获取超额收益的投资策略。

在超额收益获取方面，本基金持续采用对标国内领先对冲基金的量化投资框架，通过多因子选股策略挖掘超额收益。受限于选股范围，本基金的超额收益目标定位于低波动、稳定增长。参考国际经验，预计国内大型宽基指数增强基金的长期超额收益水平将逐步趋近年化 1%—3% 的区间，与美国市场接近（例如美国公募基金基于标普 500 的增强策略，其长期超额收益多集中于 1% 左右）。

本基金采用的多因子策略涵盖行业配置、盈利能力、成长性、公司规模、估值水平、风险因子、市场情绪以及分析师预期等多个维度，并进一步细化为若干子因子。基金管理团队将根据市场环境变化和最新因子研究进展，动态优化因子库与量化模型，力求策略能够持续适应市场波动，稳健追踪并捕捉高质量因子带来的投资机会。

在超额回撤控制方面，当前量化策略整体超额水平趋于收敛，风险控制成为提升超额夏普率的关键因素。本基金严格遵循 Barra 风险控制及优化模型，致力于规避非预期风险暴露。考虑到 2025 年可能面临的国内外突发事件及政策扰动，市场风格仍存在快速切换的风险，这将对量化策略的稳定性构成挑战。为此，在传统风险管理框架基础上，本基金进一步引入极端行情风险约束机

制，以降低策略波动性，提升超额收益的稳定性和持续性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴银中证 500 指数增强 A 基金份额净值为 0.9630 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 7.36%，同期业绩比较基准收益率为 3.21%；截至报告期末兴银中证 500 指数增强 C 基金份额净值为 0.9541 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 7.25%，同期业绩比较基准收益率为 3.21%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们在 2024 年报中提出对“贸易战 2.0”的判断正在逐步兑现。随着特朗普主导下的贸易保护主义的升级，全球供应链及国际贸易格局面临深度重塑，未来对国内外资本市场的扰动可能持续增强。然而，在更加积极的财政政策与稳健的货币政策引导下，国内经济延续复苏态势。促消费、控内卷等一系列逆周期政策有望进一步提振市场信心，为 A 股提供重要支撑。

从市场结构来看，上半年成长风格如我们预期般领涨全 A 市场，驱动指数整体上行。展望 2025 年下半年，我们预计 A 股市场将延续成长主导的偏强格局，其中大盘成长风格或迎来相对于小盘的补涨行情。AI 大模型的快速演进有望持续催化科技与科创板，重点关注半导体、算力基础设施、软件算法等细分领域的投资机会。随着资本市场改革深化，创新成长型企业有望通过估值修复与盈利释放成为市场核心驱动力。

与此同时，国家政策对产业升级与科技创新的持续支持，叠加国际供应链重构所带来的国产替代机遇，将为成长风格提供更坚实的基本面支撑，特别是在新兴科技、新能源、高端制造等战略性新兴产业中更为显著。相较而言，价值板块虽受益于稳增长政策，但在经济复苏节奏存在不确定性的背景下，其相对表现可能略显乏力。

总体而言，我们对 2025 年下半年 A 股市场持乐观态度。基金管理团队将在严格控制风险的基础上，持续优化量化投资策略，积极把握结构性与趋势性机会。同时，基金所跟踪的中证 500 指数作为中盘成长型宽基指数的代表，有望在 2025 年迎来良好表现。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

根据证监会的相关规定，本公司为建立健全有效的估值政策和程序，成立估值小组，明确参与估值流程各方的人员分工和职责。估值小组组长由分管基金事务部的公司领导担任，成员由基金事务部、合规与风险管理部、研究发展部、权益投资部/固定收益部（视会议议题内容选择相关投资方向部门）部门负责人组成。估值小组成员具备应有的经验、专业胜任能力和独立性，分工明确，在上市公司研究和估值、基金投资、投资品种所属行业的专业研究、估值政策、估值流程和程序、基金的风险控制与绩效评估、会计政策与基金核算以及相关事项的合法合规性审核和监督等各个方面具备专业能力。估值小组严格按照工作流程诚实守信、勤勉尽责地讨论和决策估值事项。日常估值项目由基金事务部严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定执行。当经

济环境和证券市场发生重大变化时，针对特殊估值工作，按照以下工作流程进行：由公司估值小组依据行业协会提供的估值模型和行业做法选定与当时市场经济环境相适应的估值方法并征求托管行、会计师事务所的相关意见，由基金事务部做出提示，对其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响是否在 0.25% 以上进行测算，并对确认产生影响的品种根据前述估值模型、估值流程计算，提供相关投资品种的公允价值以进行估值处理，待清算人员复核后，将估值结果反馈基金经理，并提交公司估值小组。其他特殊情形，可由基金经理主动做出提示，并由研究员提供研究报告，交估值小组审议，同时按流程对外公布。

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理参与对估值问题的讨论，对估值结果提出反馈意见，但不介入基金日常估值业务。

3、本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

4、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息

无。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行利润分配，符合法律法规的规定及《基金合同》的约定。

本报告期本基金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

报告期内本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本基金的管理人——兴银基金管理有限责任公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对兴银基金管理有限责任公司编制和披露的兴银中证 500 指数增强型证券投资基

金 2025 年中期报告中财务指标、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进行了复核，以上内容真实、准确和完整。

§ 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：兴银中证 500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	2,649,979.05	5,120,179.63
结算备付金		1,545,131.04	1,865,662.80
存出保证金		590,631.09	259,330.21
交易性金融资产	6.4.7.2	74,439,555.75	79,674,881.21
其中：股票投资		70,221,044.68	79,674,881.21
基金投资		-	-
债券投资		4,218,511.07	-
资产支持证 券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		346,563.59	94,771.54
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		79,571,860.52	87,014,825.39
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 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		-	3,220.69

应付赎回款		295,441.72	242,281.27
应付管理人报酬		50,574.97	57,986.91
应付托管费		12,643.74	14,496.73
应付销售服务费		7,533.47	9,457.76
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2,908.52	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	169,512.84	251,866.70
负债合计		538,615.26	579,310.06
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	82,527,644.11	96,896,319.96
未分配利润	6.4.7.8	-3,494,398.85	-10,460,804.63
净资产合计		79,033,245.26	86,435,515.33
负债和净资产总计		79,571,860.52	87,014,825.39

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 82,527,644.11 份。其中兴银中证 500 指数增强 A 基金份额净值 0.9630 元，基金份额总额 33,043,997.05 份；兴银中证 500 指数增强 C 基金份额净值 0.9541 元，基金份额总额 49,483,647.06 份。

6.2 利润表

会计主体：兴银中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
一、营业总收入		6,514,723.85	-5,027,975.61
1. 利息收入		3,505.67	13,957.99
其中：存款利息收入	6.4.7.9	3,505.67	13,616.89
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		-	341.10
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,376,165.88	-2,172,863.53
其中：股票投资收益	6.4.7.10	1,533,370.69	-2,802,072.19
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	6,005.84	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	144,126.94	-114,668.83

股利收益	6.4.7.15	692,662.41	743,877.49
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	4,124,869.70	-2,872,172.53
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	10,182.60	3,102.46
减：二、营业总支出		493,366.96	583,178.10
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	309,244.84	302,049.07
2. 托管费	6.4.10.2.2	77,311.26	75,512.27
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	48,262.08	48,388.23
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		-	-
7. 税金及附加		690.86	-
8. 其他费用	6.4.7.18	57,857.92	157,228.53
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,021,356.89	-5,611,153.71
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,021,356.89	-5,611,153.71
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		6,021,356.89	-5,611,153.71

6.3 净资产变动表

会计主体：兴银中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 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	96,896,319.96	-10,460,804.63	86,435,515.33
二、本期期初净资产	96,896,319.96	-10,460,804.63	86,435,515.33
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-14,368,675.85	6,966,405.78	-7,402,270.07
（一）、综合收益总额	-	6,021,356.89	6,021,356.89
（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）	-14,368,675.85	945,048.89	-13,423,626.96
其中：1. 基金申购款	14,945,799.98	-1,594,486.60	13,351,313.38
2. 基金赎回款	-29,314,475.83	2,539,535.49	-26,774,940.34

(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	82,527,644.11	-3,494,398.85	79,033,245.26
项 目	上年度可比期间 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	97,380,612.29	-14,390,561.73	82,990,050.56
二、本期期初净资产	97,380,612.29	-14,390,561.73	82,990,050.56
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-7,304,035.65	-4,245,096.88	-11,549,132.53
（一）、综合收益总额	-	-5,611,153.71	-5,611,153.71
（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）	-7,304,035.65	1,366,056.83	-5,937,978.82
其中：1. 基金申购款	7,594,470.59	-1,338,081.48	6,256,389.11
2. 基金赎回款	-14,898,506.24	2,704,138.31	-12,194,367.93
（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	90,076,576.64	-18,635,658.61	71,440,918.03

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：

易勇	刘钊	崔可
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

兴银中证 500 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监许可〔2020〕3444 号注册募集。《兴银中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2021 年 3 月 1 日生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集规模为 264,037,562.28 份基金份额。本基金的基金管理人为兴银基金管理有限责任公司，基金托管人为浙商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》相关规定以及《兴银中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》等法律文件约定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以标的指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、银行存款、债券（包括国债、中央银行票据、地方政府债、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债、企业债、公司债、超短期融资券、短期融资

券、中期票据、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券)、债券回购、股指期货、股票期权、资产支持证券、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本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)。本基金管理人根据相关法律法规可以参与融资及转融通证券出借业务。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。

基金的投资组合比例为:本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 80%,其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终,在扣除股指期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,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。本基金的业绩比较基准为:中证 500 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会(以下简称“基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求,真实、完整地反映了本基金 2025 年 6 月 30 日的财务状况、自 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[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[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《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》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《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[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《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 号文《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 号文《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》、财政部 税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以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。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

b) 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，暂不征收企业所得税。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

d) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

e) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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 2025 年 06 月 30 日
活期存款	2,649,979.05
等于：本金	2,649,946.32
加：应计利息	32.73
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	2,649,979.05

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	68,307,901.44	-	70,221,044.68	1,913,143.24
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	4,195,161.00	22,291.07	4,218,511.07
	银行间市场	-	-	-

	合计	4,195,161.00	22,291.07	4,218,511.07	1,059.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		72,503,062.44	22,291.07	74,439,555.75	1,914,202.24

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	4,480,853.33	-	-	-
一股指期货	4,480,853.33	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	4,480,853.33	-	-	-

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《证券投资基金股指期货投资会计核算业务细则（试行）》及《企业会计准则——金融工具列报》的相关规定，“权益衍生工具——股指期货投资”与“证券清算款——股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“权益衍生工具——股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2507	IC2507	1	1,173,480.00	35,000.00
IC2509	IC2509	2	2,310,320.00	99,386.67
IC2512	IC2512	1	1,131,120.00	-320.00
合计				134,066.67
减：可抵销期货暂收款				134,066.67
净额				0.00

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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

注：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

注：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

注：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 2025 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.07
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	31,654.85
其中：交易所市场	31,654.85
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	135,043.91
应付指数使用费	2,814.01
合计	169,512.84

6.4.7.7 实收基金

兴银中证 500 指数增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	32,013,057.22	32,013,057.22
本期申购	5,473,535.82	5,473,535.82
本期赎回（以“-”号填列）	-4,442,595.99	-4,442,595.99
本期末	33,043,997.05	33,043,997.05

兴银中证 500 指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	64,883,262.74	64,883,262.74
本期申购	9,472,264.16	9,472,264.16
本期赎回（以“-”号填列）	-24,871,879.84	-24,871,879.84
本期末	49,483,647.06	49,483,647.06

6.4.7.8 未分配利润

兴银中证 500 指数增强 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-2,278,030.49	-1,020,371.35	- 3,298,401.84
本期期初	-2,278,030.49	-1,020,371.35	- 3,298,401.84
本期利润	774,657.47	1,634,351.72	2,409,009.19
本期基金份额交易产生的变动数	-760.35	-333,606.90	-334,367.25
其中：基金申购款	-313,691.41	-405,144.39	-718,835.80
基金赎回款	312,931.06	71,537.49	384,468.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,504,133.37	280,373.47	- 1,223,759.90

兴银中证 500 指数增强 C

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	-5,106,367.66	-2,056,035.13	- 7,162,402.79
本期期初	-5,106,367.66	-2,056,035.13	- 7,162,402.79
本期利润	1,121,829.72	2,490,517.98	3,612,347.70
本期基金份额交易产生的变动数	1,302,820.08	-23,403.94	1,279,416.14
其中：基金申购款	-652,338.56	-223,312.24	-875,650.80
基金赎回款	1,955,158.64	199,908.30	2,155,066.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,681,717.86	411,078.91	- 2,270,638.95

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	2,823.61
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	625.65
其他	56.41
合计	3,505.67

注：其他为存出保证金利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	201,284,940.04
减：卖出股票成本总额	199,547,684.91
减：交易费用	203,884.44
买卖股票差价收入	1,533,370.69

6.4.7.10.2 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	4,967.84
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,038.00
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	6,005.84

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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	9,024,282.83
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	8,997,580.00
减：应计利息总额	25,664.83
减：交易费用	—
买卖债券差价收入	1,038.00

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益**6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
股指期货投资收益	152,753.33
减：其他衍生工具收益应缴纳增值税	5,757.09
减：交易费用	2,869.30
合计	144,126.94

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	692,662.41
其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	—
合计	692,662.41

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	3,960,191.55
——股票投资	3,959,132.55
——债券投资	1,059.00
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2. 衍生工具	167,586.67
——权证投资	—
——期货投资	167,586.67
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	2,908.52
合计	4,124,869.70

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	10,177.21

转换费收入	5.39
合计	10,182.60

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
审计费用	15,372.33
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
指数使用费	2,814.01
合计	57,857.92

6.4.7.19 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。 本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期末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。

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
兴银基金管理有限责任公司（以下简称“兴银基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
浙商银行股份有限公司（以下简称“浙商银行”）	基金托管人、基金销售机构
华福证券有限责任公司（以下简称“华福证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
国脉科技股份有限公司	基金管理人的股东
上海兴瀚资产管理有限公司（以下简称“兴瀚资管”）	基金管理人的全资子公司

注：本基金与关联方的所有交易均是在正常业务中按照一般商业条款订立。

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**

注：本基金本报告期及上年可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

注：本基金本报告期及上年可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年可比期间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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	309,244.84	302,049.07
其中：应支付销售机构的客户维护费	133,498.21	129,280.78
应支付基金管理人的净管理费	175,746.63	172,768.29

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.8% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至	上年度可比期间 2024 年 01 月
----	----------------------	---------------------

	2025 年 06 月 30 日	01 日至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	77,311.26	75,512.27

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴银中证 500 指数增强 A	兴银中证 500 指数增强 C	合计
华福证券	-	1,111.48	1,111.48
兴银基金	-	0.83	0.83
浙商银行	-	5,459.23	5,459.23
合计	-	6,571.54	6,571.54
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴银中证 500 指数增强 A	兴银中证 500 指数增强 C	合计
华福证券	-	1,560.63	1,560.63
兴银基金	-	0.36	0.36
浙商银行	-	2,492.83	2,492.83
合计	-	4,053.82	4,053.82

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.20%，销售服务费计提的计算公式如下：

$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间内与关联方未进行银行间同业市场债券（含回购）的交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期内无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情

况。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：基金本报告期内无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

兴银中证 500 指数增强 A

份额单位：份

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
报告期初持有的基金份额	2,649,624.28	2,649,624.28
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份 额	-	-
报告期末持有的基金份额	2,649,624.28	2,649,624.28
报告期末持有的基金份额占基 金总份额比例	3.21%	2.94%

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

6.4.10.6 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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 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
浙商银行股份有限公司	2,649,979.05	2,823.61	5,478,887.82	5,310.90

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无其他需要说明的关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2025 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

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了董事会（下设“合规及风险管理委员会”）、经营管理层（下设“风险控制委员会”）、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市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管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的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。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司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；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有除国债、政策性金融债、央行票据及地方政府债以外的需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

注：本基金本报告期末和上年度末未持有需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

注：本基金本报告期末和上年度末未持有需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

注：本基金于本报告期末和上年度末未持有按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有需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

注：本基金本报告期末和上年度末未持有需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

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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，保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券在证券交易所上市或可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

本基金所持大部分证券为依法上市的股票等资产，本报告期末本基金持有的资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持有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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金经营活动的现金流量与市场利率变化有一定的相关性，因此利率风险在一定程度上存在。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并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 2025 年 06 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年 以上	不计息	合计
资产							
货币资金	2,649,979.05	-	-	-	-	-	2,649,979.05
结算备付金	1,545,131.04	-	-	-	-	-	1,545,131.04
存出保证金	590,631.09	-	-	-	-	-	590,631.09
交易性金融资产	-	-	4,218,511.07	-	-	70,221,044.68	74,439,555.75

应收申购款	-	-	-	-	-	346,563.59	346,563.59
资产总计	4,785,741.18	-	4,218,511.07	-	-	70,567,608.27	79,571,860.52
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	295,441.72	295,441.72
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	50,574.97	50,574.97
应付托管费	-	-	-	-	-	12,643.74	12,643.74
应付销售服务费	-	-	-	-	-	7,533.47	7,533.47
应交税费	-	-	-	-	-	2,908.52	2,908.52
其他负债	-	-	-	-	-	169,512.84	169,512.84
负债总计	-	-	-	-	-	538,615.26	538,615.26
利率敏感度缺口	4,785,741.18	-	4,218,511.07	-	-	70,028,993.01	79,033,245.26
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	5,120,179.63	-	-	-	-	-	5,120,179.63
结算备付金	1,865,662.80	-	-	-	-	-	1,865,662.80
存出保证金	259,330.21	-	-	-	-	-	259,330.21
交易性金融资产	-	-	-	-	-	79,674,881.21	79,674,881.21
应收申购款	-	-	-	-	-	94,771.54	94,771.54
资产总计	7,245,172.64	-	-	-	-	79,769,652.75	87,014,825.39
负债							

应付清算款	-	-	-	-	-	3,220.69	3,220.69
应付赎回款	-	-	-	-	-	242,281.27	242,281.27
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	57,986.91	57,986.91
应付托管费	-	-	-	-	-	14,496.73	14,496.73
应付销售服务费	-	-	-	-	-	9,457.76	9,457.76
其他负债	-	-	-	-	-	251,866.70	251,866.70
负债总计	-	-	-	-	-	579,310.06	579,310.06
利率敏感度缺口	7,245,172.64	-	-	-	-	79,190,342.69	86,435,515.33

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除利率之外的其他市场变量保持不变； 该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券与可交换债券。		
	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
分析	相关风险变量的变动	本期末 2025 年 06 月 30 日	
		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	市场利率上升 25 个基点	-5,669.54	-
	市场利率下降 25 个基点	5,680.36	-

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场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证券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基

金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金为指数增强型股票基金，采取定量方法进行组合管理。

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 2025 年 06 月 30 日		上年度末 2024 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	70,221,044.68	88.85	79,674,881.21	92.18
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	4,218,511.07	5.34	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	74,439,555.75	94.19	79,674,881.21	92.18

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	以沪深 300 指数为基准衡量其他价格风险，且其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
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 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上涨 5%	4,149,012.42	4,685,810.34
	沪深 300 指数下跌 5%	-4,149,012.42	-4,685,810.34

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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

- 第一层次输入值：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：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；
- 第三层次输入值：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 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	70,221,044.68	79,674,881.21

第二层次	4,218,511.07	—
第三层次	—	—
合计	74,439,555.75	79,674,881.21

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

无。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2025 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2024 年 12 月 31 日：无)。

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工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2025 年 6 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 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	70,221,044.68	88.25
	其中：股票	70,221,044.68	88.25
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	4,218,511.07	5.30
	其中：债券	4,218,511.07	5.30
	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	4,195,110.09	5.27
8	其他各项资产	937,194.68	1.18
9	合计	79,571,860.52	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	271,246.00	0.34
B	采矿业	2,763,841.00	3.50
C	制造业	38,133,616.28	48.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,289,197.00	2.90
E	建筑业	580,453.00	0.73
F	批发和零售业	1,695,193.40	2.14
G	交通运输、仓储和邮政业	1,298,960.00	1.64
H	住宿和餐饮业	357,561.00	0.45
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,981,721.95	6.30
J	金融业	6,365,824.30	8.05
K	房地产业	1,008,460.00	1.28
L	租赁和商务服务业	315,530.80	0.40
M	科学研究和技术服务业	651,555.28	0.82
N	水利、环境和公共设施管理业	334,704.00	0.42
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	228,816.00	0.29
R	文化、体育和娱乐业	1,208,666.00	1.53
S	综合	245,393.00	0.31
	合计	62,730,739.01	79.37

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	42,700.00	0.05
B	采矿业	129,189.00	0.16
C	制造业	5,679,091.22	7.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	171,002.00	0.22
E	建筑业	87,204.00	0.11
F	批发和零售业	88,693.00	0.11
G	交通运输、仓储和邮政业	231,623.00	0.29
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	736,058.65	0.93
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	89,825.00	0.11
M	科学研究和技术服务业	101,199.00	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	91,990.80	0.12
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	41,730.00	0.05
S	综合	-	-
	合计	7,490,305.67	9.48

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	300476	胜宏科技	5,000	671,900.00	0.85
2	601555	东吴证券	65,700	574,875.00	0.73
3	688122	西部超导	9,593	497,684.84	0.63
4	000783	长江证券	70,600	489,258.00	0.62
5	688213	思特威	4,049	413,888.78	0.52
6	000050	深天马 A	48,000	408,960.00	0.52
7	002472	双环传动	11,900	398,531.00	0.50
8	002926	华西证券	44,100	394,254.00	0.50
9	002500	山西证券	65,400	381,936.00	0.48
10	603228	景旺电子	9,100	380,744.00	0.48
11	002436	兴森科技	28,700	379,988.00	0.48
12	002281	光迅科技	7,700	379,764.00	0.48
13	600143	金发科技	35,600	367,036.00	0.46
14	603893	瑞芯微	2,300	349,278.00	0.44
15	000988	华工科技	7,400	347,874.00	0.44
16	300395	菲利华	6,800	347,480.00	0.44
17	603979	金诚信	7,400	343,656.00	0.43
18	002739	万达电影	29,700	339,471.00	0.43
19	603379	三美股份	6,900	332,028.00	0.42
20	600062	华润双鹤	17,500	326,550.00	0.41
21	002603	以岭药业	23,000	324,300.00	0.41
22	002414	高德红外	31,600	323,900.00	0.41
23	000060	中金岭南	66,921	306,498.18	0.39
24	600901	江苏金租	50,200	304,212.00	0.38
25	600497	驰宏锌锗	57,300	303,117.00	0.38
26	300699	光威复材	9,500	300,865.00	0.38
27	300223	北京君正	4,300	297,560.00	0.38

28	000733	振华科技	5,900	295,295.00	0.37
29	002138	顺络电子	10,300	289,636.00	0.37
30	300285	国瓷材料	16,500	286,275.00	0.36
31	600563	法拉电子	2,600	283,634.00	0.36
32	000959	首钢股份	81,500	277,100.00	0.35
33	300803	指南针	3,385	273,034.10	0.35
34	300073	当升科技	6,100	267,607.00	0.34
35	600271	航天信息	28,300	261,492.00	0.33
36	000021	深科技	13,900	260,486.00	0.33
37	601615	明阳智能	22,600	259,674.00	0.33
38	600968	海油发展	63,000	257,040.00	0.33
39	000997	新 大 陆	7,900	255,802.00	0.32
40	000825	太钢不锈	70,400	252,736.00	0.32
41	300763	锦浪科技	4,400	252,516.00	0.32
42	600498	烽火通信	12,000	252,360.00	0.32
43	600739	辽宁成大	22,700	249,700.00	0.32
44	600704	物产中大	47,000	247,690.00	0.31
45	600673	东阳光	21,100	245,393.00	0.31
46	601228	广州港	75,900	245,157.00	0.31
47	002958	青农商行	67,700	244,397.00	0.31
48	688387	信科移动	43,201	244,085.65	0.31
49	603606	东方电缆	4,700	243,037.00	0.31
50	601958	金钼股份	22,200	242,868.00	0.31
51	600637	XD 东方明	32,500	242,775.00	0.31
52	002439	启明星辰	15,100	241,449.00	0.31
53	000960	锡业股份	15,700	240,210.00	0.30
54	603596	伯特利	4,500	237,105.00	0.30
55	300142	沃森生物	21,500	236,500.00	0.30
56	000009	中国宝安	26,500	235,320.00	0.30
57	600909	华安证券	40,200	234,366.00	0.30
58	601717	中创智领	14,100	234,342.00	0.30
59	002624	完美世界	15,400	233,618.00	0.30
60	601608	中信重工	53,300	232,921.00	0.29
61	600995	南网储能	23,800	232,764.00	0.29
62	600056	中国医药	22,500	232,650.00	0.29
63	600299	安迪苏	24,000	231,600.00	0.29
64	002152	广电运通	17,200	231,168.00	0.29
65	300001	特锐德	9,600	230,112.00	0.29
66	300390	天华新能	12,000	228,840.00	0.29
67	003031	中瓷电子	4,300	228,803.00	0.29
68	601231	环旭电子	15,500	226,765.00	0.29
69	600096	云天化	10,300	226,291.00	0.29
70	688248	南网科技	7,168	225,505.28	0.29

71	600021	上海电力	25,600	225,024.00	0.28
72	002244	滨江集团	23,000	224,250.00	0.28
73	600685	中船防务	8,200	222,958.00	0.28
74	300573	兴齐眼药	4,300	222,697.00	0.28
75	300212	易华录	10,200	221,952.00	0.28
76	002738	中矿资源	6,900	221,904.00	0.28
77	300002	神州泰岳	18,800	221,840.00	0.28
78	300012	华测检测	18,900	220,941.00	0.28
79	600863	内蒙华电	53,600	220,296.00	0.28
80	002299	圣农发展	15,400	220,066.00	0.28
81	600398	海澜之家	31,600	219,936.00	0.28
82	603737	三棵树	5,940	218,889.00	0.28
83	601179	中国西电	35,600	218,584.00	0.28
84	601128	常熟银行	29,560	217,857.20	0.28
85	300251	光线传媒	10,700	216,889.00	0.27
86	601019	山东出版	22,900	216,863.00	0.27
87	600258	首旅酒店	15,300	216,189.00	0.27
88	600663	陆家嘴	24,400	216,184.00	0.27
89	601156	东航物流	16,500	215,985.00	0.27
90	601665	齐鲁银行	34,100	215,512.00	0.27
91	002429	兆驰股份	49,000	214,620.00	0.27
92	603658	安图生物	5,700	213,750.00	0.27
93	601611	中国核建	23,200	213,208.00	0.27
94	603160	汇顶科技	3,000	213,090.00	0.27
95	300601	康泰生物	14,000	212,660.00	0.27
96	600867	通化东宝	25,900	212,380.00	0.27
97	000937	冀中能源	36,800	211,600.00	0.27
98	688561	奇安信	6,185	210,166.30	0.27
99	600956	新天绿能	27,200	209,984.00	0.27
100	300888	稳健医疗	5,100	209,610.00	0.27
101	002831	裕同科技	8,800	206,096.00	0.26
102	600578	京能电力	45,700	205,193.00	0.26
103	600885	宏发股份	9,180	204,805.80	0.26
104	300024	机器人	11,900	204,442.00	0.26
105	600536	中国软件	4,300	201,111.00	0.25
106	603345	安井食品	2,500	201,050.00	0.25
107	601139	深圳燃气	31,600	200,976.00	0.25
108	600977	中国电影	18,700	200,464.00	0.25
109	600295	鄂尔多斯	23,000	200,330.00	0.25
110	600763	通策医疗	4,800	198,144.00	0.25
111	688301	奕瑞科技	2,197	192,479.17	0.24
112	688363	华熙生物	3,694	189,686.90	0.24
113	600988	赤峰黄金	7,200	179,136.00	0.23

114	002080	中材科技	9,100	177,450.00	0.22
115	002653	海思科	4,200	177,324.00	0.22
116	002558	巨人网络	7,400	174,270.00	0.22
117	300070	碧水源	38,000	171,000.00	0.22
118	601155	新城控股	12,500	171,000.00	0.22
119	002939	长城证券	20,100	168,438.00	0.21
120	300677	英科医疗	7,000	165,760.00	0.21
121	002294	信立泰	3,500	165,655.00	0.21
122	600435	北方导航	10,600	165,254.00	0.21
123	000987	越秀资本	23,900	163,954.00	0.21
124	002203	海亮股份	15,700	162,024.00	0.21
125	002130	沃尔核材	6,800	161,976.00	0.20
126	600928	西安银行	41,100	161,112.00	0.20
127	002120	韵达股份	24,000	160,800.00	0.20
128	002966	苏州银行	18,300	160,674.00	0.20
129	600325	华发股份	32,800	159,736.00	0.20
130	000563	陕国投 A	44,600	159,222.00	0.20
131	603927	中科软	8,200	158,588.00	0.20
132	605589	圣泉集团	5,700	158,175.00	0.20
133	600348	华阳股份	23,700	157,842.00	0.20
134	301308	江波龙	1,800	157,482.00	0.20
135	001696	宗申动力	7,000	157,150.00	0.20
136	002432	九安医疗	4,300	156,649.00	0.20
137	600808	马钢股份	45,300	156,285.00	0.20
138	002841	视源股份	4,500	155,700.00	0.20
139	603728	鸣志电器	2,700	155,169.00	0.20
140	688017	绿的谐波	1,237	154,488.93	0.20
141	600109	国金证券	17,600	154,352.00	0.20
142	000034	神州数码	4,100	154,324.00	0.20
143	601921	浙版传媒	19,100	153,946.00	0.19
144	603816	顾家家居	6,000	153,120.00	0.19
145	601001	晋控煤业	12,500	152,750.00	0.19
146	002065	东华软件	15,900	152,640.00	0.19
147	601216	君正集团	27,600	152,352.00	0.19
148	600352	XD 浙江龙	14,800	150,368.00	0.19
149	300383	光环新网	10,500	150,150.00	0.19
150	603786	科博达	2,700	149,607.00	0.19
151	601061	中信金属	18,900	149,499.00	0.19
152	600517	国网英大	29,300	149,430.00	0.19
153	600655	豫园股份	26,900	149,295.00	0.19
154	300054	鼎龙股份	5,200	149,136.00	0.19
155	002202	金风科技	14,500	148,625.00	0.19
156	600598	XD 北大荒	10,300	148,526.00	0.19

157	000739	普洛药业	10,600	148,400.00	0.19
158	600529	山东药玻	6,700	148,338.00	0.19
159	003022	联泓新科	9,300	147,219.00	0.19
160	601456	国联民生	14,200	146,970.00	0.19
161	600699	均胜电子	8,400	146,496.00	0.19
162	688425	铁建重工	35,854	146,284.32	0.19
163	300627	华测导航	4,160	145,600.00	0.18
164	601666	平煤股份	19,600	145,236.00	0.18
165	600546	山煤国际	16,600	144,918.00	0.18
166	603659	璞泰来	7,700	144,606.00	0.18
167	603298	杭叉集团	6,900	144,555.00	0.18
168	300529	健帆生物	6,700	144,519.00	0.18
169	301165	锐捷网络	2,340	143,816.40	0.18
170	002008	大族激光	5,900	143,783.00	0.18
171	000400	许继电气	6,600	143,682.00	0.18
172	000032	深桑达 A	7,100	143,633.00	0.18
173	000728	国元证券	18,200	143,598.00	0.18
174	002673	西部证券	18,100	142,628.00	0.18
175	600959	江苏有线	41,300	142,072.00	0.18
176	600754	锦江酒店	6,300	141,372.00	0.18
177	600582	天地科技	23,600	141,364.00	0.18
178	300454	深信服	1,500	141,270.00	0.18
179	002517	恺英网络	7,300	140,963.00	0.18
180	300058	蓝色光标	21,480	140,908.80	0.18
181	688676	XD 金盘科	4,200	140,490.00	0.18
182	002353	杰瑞股份	4,000	140,000.00	0.18
183	603486	科沃斯	2,400	139,752.00	0.18
184	600707	彩虹股份	21,600	139,536.00	0.18
185	300450	先导智能	5,600	139,160.00	0.18
186	300458	全志科技	3,500	138,915.00	0.18
187	601918	新集能源	21,500	138,890.00	0.18
188	000598	兴蓉环境	19,200	138,432.00	0.18
189	688072	拓荆科技	900	138,339.00	0.18
190	000027	深圳能源	21,600	137,808.00	0.17
191	688120	华海清科	816	137,659.20	0.17
192	688520	神州细胞	2,300	137,655.00	0.17
193	300339	润和软件	2,700	137,241.00	0.17
194	600118	中国卫星	4,800	137,136.00	0.17
195	002064	华峰化学	20,700	136,827.00	0.17
196	002340	格林美	21,400	135,890.00	0.17
197	300373	扬杰科技	2,600	134,940.00	0.17
198	601965	中国汽研	7,600	134,900.00	0.17
199	000062	深圳华强	5,000	134,300.00	0.17

200	300146	汤臣倍健	11,900	133,756.00	0.17
201	688278	特宝生物	1,854	133,691.94	0.17
202	600380	健康元	12,100	133,463.00	0.17
203	000403	派林生物	7,360	133,436.80	0.17
204	002078	太阳纸业	9,900	133,254.00	0.17
205	688183	生益电子	2,600	133,120.00	0.17
206	600583	海油工程	24,300	132,678.00	0.17
207	600483	福能股份	13,700	132,068.00	0.17
208	002461	珠江啤酒	11,600	130,964.00	0.17
209	300017	网宿科技	12,200	130,784.00	0.17
210	000623	吉林敖东	7,700	130,515.00	0.17
211	300604	长川科技	2,900	130,239.00	0.16
212	002056	横店东磁	9,200	130,180.00	0.16
213	603129	春风动力	600	129,900.00	0.16
214	601598	中国外运	26,300	129,659.00	0.16
215	600007	中国国贸	6,300	129,654.00	0.16
216	001286	陕西能源	14,900	129,630.00	0.16
217	601568	北元集团	31,200	129,480.00	0.16
218	601158	重庆水务	27,900	129,456.00	0.16
219	002266	浙富控股	42,000	129,360.00	0.16
220	600764	中国海防	3,800	129,200.00	0.16
221	300857	协创数据	1,500	129,090.00	0.16
222	002195	岩山科技	22,900	128,927.00	0.16
223	002155	湖南黄金	7,220	128,877.00	0.16
224	600535	天士力	8,200	128,330.00	0.16
225	600390	五矿资本	22,000	128,260.00	0.16
226	600970	中材国际	14,900	127,842.00	0.16
227	000636	风华高科	9,300	127,782.00	0.16
228	300136	信维通信	5,700	127,680.00	0.16
229	688002	睿创微纳	1,830	127,587.60	0.16
230	002444	巨星科技	5,000	127,550.00	0.16
231	600060	海信视像	5,500	126,610.00	0.16
232	600177	雅戈尔	17,300	126,290.00	0.16
233	300115	长盈精密	5,900	126,260.00	0.16
234	600008	首创环保	41,800	126,236.00	0.16
235	600528	中铁工业	17,100	126,198.00	0.16
236	000513	丽珠集团	3,500	126,140.00	0.16
237	600906	财达证券	18,400	125,488.00	0.16
238	000528	柳 工	13,000	124,930.00	0.16
239	002223	鱼跃医疗	3,500	124,600.00	0.16
240	600378	昊华科技	4,600	124,522.00	0.16
241	600499	科达制造	12,700	124,460.00	0.16
242	300207	欣旺达	6,200	124,372.00	0.16

243	001389	广合科技	2,100	123,417.00	0.16
244	000878	云南铜业	9,700	123,384.00	0.16
245	000887	中鼎股份	7,000	123,130.00	0.16
246	600298	安琪酵母	3,500	123,095.00	0.16
247	300735	光弘科技	4,900	122,990.00	0.16
248	002532	天山铝业	14,800	122,988.00	0.16
249	600873	XD 梅花生	11,500	122,935.00	0.16
250	601118	海南橡胶	26,000	122,720.00	0.16
251	600487	亨通光电	8,000	122,400.00	0.15
252	603087	甘李药业	2,200	120,516.00	0.15
253	002156	通富微电	4,700	120,414.00	0.15
254	002670	国盛金控	8,000	120,400.00	0.15
255	002851	麦格米特	2,400	120,336.00	0.15
256	300496	中科创达	2,100	120,162.00	0.15
257	600862	中航高科	4,600	119,968.00	0.15
258	600171	上海贝岭	3,500	119,875.00	0.15
259	601991	大唐发电	37,800	119,826.00	0.15
260	603225	新凤鸣	11,200	119,280.00	0.15
261	002945	华林证券	8,300	119,271.00	0.15
262	002185	华天科技	11,800	119,180.00	0.15
263	002507	涪陵榨菜	9,300	118,947.00	0.15
264	000039	中集集团	15,100	118,686.00	0.15
265	603565	中谷物流	12,400	118,420.00	0.15
266	601990	南京证券	14,600	117,968.00	0.15
267	002318	久立特材	5,000	116,950.00	0.15
268	600859	王府井	8,400	116,676.00	0.15
269	000415	渤海租赁	35,000	116,550.00	0.15
270	600339	中油工程	35,600	116,412.00	0.15
271	688361	中科飞测	1,379	116,098.01	0.15
272	600004	白云机场	12,700	115,570.00	0.15
273	002410	广联达	8,600	115,326.00	0.15
274	002085	万丰奥威	7,200	114,408.00	0.14
275	002756	永兴材料	3,600	114,300.00	0.14
276	002797	第一创业	16,100	113,988.00	0.14
277	603290	斯达半导	1,400	113,778.00	0.14
278	000932	华菱钢铁	25,800	113,520.00	0.14
279	300623	捷捷微电	3,800	113,240.00	0.14
280	601168	西部矿业	6,800	113,084.00	0.14
281	688469	芯联集成	23,644	112,781.88	0.14
282	300037	新宙邦	3,200	112,640.00	0.14
283	600038	中直股份	2,900	112,549.00	0.14
284	688772	珠海冠宇	7,833	111,933.57	0.14
285	688153	唯捷创芯	3,600	111,636.00	0.14

286	688568	中科星图	3,100	111,631.00	0.14
287	000933	神火股份	6,700	111,488.00	0.14
288	600141	兴发集团	5,400	110,862.00	0.14
289	300346	南大光电	3,500	110,740.00	0.14
290	002385	大北农	27,400	110,696.00	0.14
291	002430	杭氧股份	5,700	110,694.00	0.14
292	000429	粤高速 A	8,300	110,639.00	0.14
293	601000	唐山港	27,200	110,432.00	0.14
294	603707	健友股份	9,900	110,385.00	0.14
295	300558	贝达药业	1,900	110,105.00	0.14
296	002773	康弘药业	3,800	110,086.00	0.14
297	600282	南钢股份	26,200	110,040.00	0.14
298	600155	华创云信	15,800	109,968.00	0.14
299	600839	四川长虹	11,300	109,836.00	0.14
300	688052	纳芯微	629	109,754.21	0.14
301	603341	龙旗科技	2,700	109,701.00	0.14
302	600392	盛和资源	8,300	109,311.00	0.14
303	601099	太平洋	27,800	109,254.00	0.14
304	300567	精测电子	1,800	109,098.00	0.14
305	300679	电连技术	2,400	108,912.00	0.14
306	000559	万向钱潮	14,200	108,630.00	0.14
307	300724	捷佳伟创	2,000	108,600.00	0.14
308	688188	柏楚电子	818	107,697.88	0.14
309	688582	芯动联科	1,600	107,520.00	0.14
310	000426	兴业银锡	6,800	107,440.00	0.14
311	601577	长沙银行	10,800	107,352.00	0.14
312	600361	创新新材	26,900	107,331.00	0.14
313	000951	中国重汽	6,100	107,238.00	0.14
314	603858	步长制药	6,600	107,184.00	0.14
315	601233	桐昆股份	10,100	107,060.00	0.14
316	002595	豪迈科技	1,800	106,596.00	0.13
317	600765	中航重机	6,300	106,344.00	0.13
318	688521	芯原股份	1,100	106,150.00	0.13
319	603650	彤程新材	3,300	106,095.00	0.13
320	301358	湖南裕能	3,400	106,046.00	0.13
321	603233	大参林	6,500	105,950.00	0.13
322	002821	凯莱英	1,200	105,900.00	0.13
323	300919	中伟股份	3,200	105,216.00	0.13
324	601997	贵阳银行	16,800	104,832.00	0.13
325	600486	扬农化工	1,800	104,400.00	0.13
326	688608	恒玄科技	300	104,394.00	0.13
327	688385	复旦微电	2,100	103,467.00	0.13
328	000729	燕京啤酒	8,000	103,440.00	0.13

329	600329	达仁堂	3,100	103,416.00	0.13
330	600131	国网信通	5,800	102,660.00	0.13
331	605358	立昂微	4,400	102,520.00	0.13
332	002153	石基信息	11,800	102,188.00	0.13
333	002850	科达利	900	101,853.00	0.13
334	600801	华新水泥	8,600	101,824.00	0.13
335	002262	恩华药业	4,900	101,822.00	0.13
336	300957	贝泰妮	2,300	101,706.00	0.13
337	603868	飞科电器	2,800	100,436.00	0.13
338	000921	海信家电	3,900	100,230.00	0.13
339	603338	浙江鼎力	2,100	99,540.00	0.13
340	603179	新泉股份	2,100	98,637.00	0.12
341	603688	石英股份	2,800	98,616.00	0.12
342	688728	格科微	6,400	98,560.00	0.12
343	600312	平高电气	6,397	98,449.83	0.12
344	002683	广东宏大	2,900	98,426.00	0.12
345	688249	晶合集成	4,800	97,296.00	0.12
346	600820	隧道股份	15,700	95,770.00	0.12
347	600521	华海药业	5,100	95,013.00	0.12
348	300474	景嘉微	1,300	94,900.00	0.12
349	600580	卧龙电驱	4,800	94,896.00	0.12
350	688235	百济神州	400	93,456.00	0.12
351	600985	淮北矿业	8,200	92,988.00	0.12
352	688475	萤石网络	2,900	91,408.00	0.12
353	688578	艾力斯	974	90,620.96	0.11
354	000423	东阿阿胶	1,700	88,910.00	0.11
355	301498	乖宝宠物	800	87,496.00	0.11
356	603885	吉祥航空	6,400	86,208.00	0.11
357	688617	惠泰医疗	290	86,130.00	0.11
358	300487	蓝晓科技	1,700	85,510.00	0.11
359	002568	百润股份	3,300	84,513.00	0.11
360	688114	华大智造	1,300	84,279.00	0.11
361	600895	张江高科	3,200	82,240.00	0.10
362	600511	国药股份	2,800	81,648.00	0.10
363	600737	中粮糖业	8,000	75,600.00	0.10
364	603939	益丰药房	3,000	73,410.00	0.09
365	601162	天风证券	13,700	67,541.00	0.09
366	300676	华大基因	1,300	64,701.00	0.08
367	002261	拓维信息	2,000	61,900.00	0.08
368	002608	江苏国信	8,300	60,839.00	0.08
369	600153	建发股份	5,600	58,072.00	0.07
370	688777	中控技术	1,229	55,194.39	0.07
371	688027	国盾量子	200	55,002.00	0.07

372	000723	美锦能源	12,000	51,840.00	0.07
373	000066	中国长城	3,300	48,840.00	0.06
374	002465	海格通信	3,100	43,214.00	0.05
375	000831	中国稀土	1,100	39,732.00	0.05
376	603568	伟明环保	1,800	34,344.00	0.04
377	600132	重庆啤酒	600	33,060.00	0.04
378	000830	鲁西化工	3,000	30,900.00	0.04
379	301267	华夏眼科	1,600	30,672.00	0.04
380	002508	老板电器	1,600	30,416.00	0.04
381	300144	宋城演艺	3,300	28,215.00	0.04
382	601928	凤凰传媒	2,400	26,808.00	0.03
383	601108	财通证券	3,300	26,103.00	0.03
384	600848	上海临港	2,800	25,396.00	0.03
385	600879	航天电子	2,300	24,081.00	0.03
386	601858	中国科传	1,000	19,450.00	0.02
387	603000	人民网	900	18,189.00	0.02
388	002563	森马服饰	3,400	17,884.00	0.02
389	688180	君实生物	500	16,990.00	0.02
390	688295	中复神鹰	800	16,640.00	0.02
391	300765	新诺威	300	15,507.00	0.02
392	300595	欧普康视	1,000	15,270.00	0.02
393	688065	凯赛生物	300	14,130.00	0.02
394	603589	口子窖	400	13,920.00	0.02
395	000537	中绿电	1,500	12,540.00	0.02
396	688297	中无人机	227	12,121.80	0.02
397	688778	厦钨新能	200	11,184.00	0.01
398	688099	晶晨股份	139	9,870.39	0.01
399	600098	广州发展	1,300	8,125.00	0.01
400	300140	节能环境	1,300	8,021.00	0.01
401	002007	华兰生物	500	7,835.00	0.01
402	603826	坤彩科技	400	7,828.00	0.01
403	688100	威胜信息	200	7,410.00	0.01
404	601098	中南传媒	500	6,560.00	0.01
405	000703	恒逸石化	1,100	6,468.00	0.01
406	002372	伟星新材	600	6,216.00	0.01
407	001213	中铁特货	1,500	6,090.00	0.01
408	003035	南网能源	1,200	5,508.00	0.01
409	002025	航天电器	100	5,141.00	0.01
410	000738	航发控制	98	2,033.50	0.00
411	600998	九州通	10	51.40	0.00

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

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	占基金资产净值比例 (%)
1	688636	智明达	4,700	158,813.00	0.20
2	002706	良信股份	16,600	147,906.00	0.19
3	688708	佳驰科技	2,500	138,225.00	0.17
4	603766	隆鑫通用	10,050	128,238.00	0.16
5	688499	利元亨	1,500	62,415.00	0.08
6	301080	百普赛斯	800	57,224.00	0.07
7	300772	运达股份	4,400	56,672.00	0.07
8	002384	东山精密	1,500	56,655.00	0.07
9	002268	电科网安	3,000	54,870.00	0.07
10	002925	盈趣科技	3,000	53,940.00	0.07
11	300171	东富龙	4,000	53,160.00	0.07
12	688201	信安世纪	4,100	53,095.00	0.07
13	603328	依顿电子	5,400	52,974.00	0.07
14	600416	湘电股份	3,900	52,416.00	0.07
15	600728	佳都科技	9,600	52,320.00	0.07
16	002170	芭田股份	5,100	52,275.00	0.07
17	601208	东材科技	5,500	52,140.00	0.07
18	601126	四方股份	3,200	52,064.00	0.07
19	300696	爱乐达	2,300	51,934.00	0.07
20	300088	长信科技	8,700	51,852.00	0.07
21	600115	中国东航	12,800	51,584.00	0.07
22	603386	骏亚科技	4,000	50,600.00	0.06
23	601002	晋亿实业	10,200	50,286.00	0.06
24	300041	回天新材	5,300	49,926.00	0.06
25	603203	快克智能	2,000	49,740.00	0.06
26	300138	晨光生物	4,100	49,692.00	0.06
27	002258	利尔化学	4,500	49,680.00	0.06
28	600731	湖南海利	6,800	49,572.00	0.06
29	300019	硅宝科技	2,500	49,350.00	0.06
30	301236	软通动力	900	49,176.00	0.06
31	600273	嘉化能源	5,800	49,068.00	0.06
32	300988	津荣天宇	2,300	49,059.00	0.06
33	688208	道通科技	1,600	48,960.00	0.06
34	601728	中国电信	6,300	48,825.00	0.06
35	002615	哈尔斯	5,800	48,778.00	0.06
36	000823	超声电子	4,100	48,585.00	0.06
37	600888	新疆众和	7,100	48,422.00	0.06
38	300303	聚飞光电	7,600	48,184.00	0.06
39	601678	滨化股份	11,600	48,024.00	0.06
40	600458	时代新材	3,500	48,020.00	0.06

41	300789	唐源电气	1,800	47,934.00	0.06
42	605060	联德股份	2,300	47,909.00	0.06
43	600219	南山铝业	12,500	47,875.00	0.06
44	300232	洲明科技	6,600	47,784.00	0.06
45	601877	正泰电器	2,100	47,607.00	0.06
46	300358	楚天科技	6,100	47,580.00	0.06
47	601107	四川成渝	7,900	47,558.00	0.06
48	300739	明阳电路	3,200	47,488.00	0.06
49	300389	艾比森	4,100	47,478.00	0.06
50	300369	绿盟科技	6,100	47,397.00	0.06
51	601330	绿色动力	6,200	47,368.00	0.06
52	301180	万祥科技	3,200	47,136.00	0.06
53	000928	中钢国际	7,500	47,100.00	0.06
54	688207	格灵深瞳	3,100	46,810.00	0.06
55	688119	中钢洛耐	11,194	46,790.92	0.06
56	301200	大族数控	1,100	46,717.00	0.06
57	600063	皖维高新	10,200	46,716.00	0.06
58	300780	德恩精工	2,900	46,661.00	0.06
59	300850	新强联	1,300	46,566.00	0.06
60	688653	康希通信	3,800	46,550.00	0.06
61	600963	岳阳林纸	10,500	46,515.00	0.06
62	601326	秦港股份	14,400	46,512.00	0.06
63	002824	和胜股份	2,700	46,440.00	0.06
64	688371	菲沃泰	2,800	46,368.00	0.06
65	000725	京东方 A	11,600	46,284.00	0.06
66	688258	卓易信息	955	46,250.65	0.06
67	603883	老百姓	2,200	46,222.00	0.06
68	600195	中牧股份	6,300	46,179.00	0.06
69	002249	大洋电机	7,000	46,060.00	0.06
70	002030	达安基因	7,600	45,980.00	0.06
71	000970	中科三环	3,900	45,903.00	0.06
72	688015	交控科技	2,200	45,848.00	0.06
73	600961	株冶集团	4,100	45,838.00	0.06
74	603500	祥和实业	5,000	45,800.00	0.06
75	300889	爱克股份	3,400	45,764.00	0.06
76	300226	上海钢联	2,000	45,680.00	0.06
77	300206	理邦仪器	3,800	45,676.00	0.06
78	300565	科信技术	3,600	45,648.00	0.06
79	603456	九洲药业	3,000	45,630.00	0.06
80	300241	瑞丰光电	8,000	45,600.00	0.06
81	300866	安克创新	400	45,440.00	0.06
82	601857	中国石油	5,300	45,315.00	0.06
83	300134	大富科技	3,700	45,251.00	0.06

84	300628	亿联网络	1,300	45,188.00	0.06
85	300286	安科瑞	2,000	45,140.00	0.06
86	002320	海峡股份	6,900	45,126.00	0.06
87	600037	歌华有线	5,900	45,076.00	0.06
88	002698	博实股份	2,900	45,066.00	0.06
89	000100	TCL 科技	10,400	45,032.00	0.06
90	600941	中国移动	400	45,020.00	0.06
91	300126	锐奇股份	6,200	45,012.00	0.06
92	603181	皇马科技	3,500	45,010.00	0.06
93	003016	欣贺股份	6,000	45,000.00	0.06
94	002950	奥美医疗	5,200	44,720.00	0.06
95	688661	和林微纳	1,123	44,661.71	0.06
96	601200	上海环境	5,620	44,622.80	0.06
97	002057	中钢天源	4,800	44,592.00	0.06
98	300018	中元股份	5,600	44,520.00	0.06
99	002587	奥拓电子	6,900	44,505.00	0.06
100	002368	太极股份	1,900	44,498.00	0.06
101	688009	中国通号	8,634	44,378.76	0.06
102	603700	宁水集团	3,700	44,326.00	0.06
103	002979	雷赛智能	1,000	44,280.00	0.06
104	603191	望变电气	3,500	44,170.00	0.06
105	605168	三人行	1,500	44,145.00	0.06
106	603530	神马电力	1,700	44,064.00	0.06
107	002967	广电计量	2,500	43,975.00	0.06
108	600025	华能水电	4,600	43,930.00	0.06
109	300539	横河精密	3,200	43,808.00	0.06
110	600268	国电南自	5,600	43,792.00	0.06
111	603566	普莱柯	3,200	43,552.00	0.06
112	001203	大中矿业	4,600	43,470.00	0.06
113	301029	怡合达	1,900	43,434.00	0.05
114	688314	康拓医疗	1,400	43,232.00	0.05
115	600388	龙净环保	3,600	43,200.00	0.05
116	603311	金海高科	3,900	43,134.00	0.05
117	688512	慧智微	3,951	43,105.41	0.05
118	000338	潍柴动力	2,800	43,064.00	0.05
119	300653	正海生物	2,100	43,050.00	0.05
120	300684	中石科技	1,800	42,984.00	0.05
121	688186	广大特材	1,500	42,915.00	0.05
122	603171	税友股份	1,000	42,910.00	0.05
123	300247	融捷健康	11,000	42,900.00	0.05
124	002399	海普瑞	3,600	42,876.00	0.05
125	600011	华能国际	6,000	42,840.00	0.05
126	002817	黄山胶囊	5,800	42,804.00	0.05

127	002893	京能热力	4,000	42,760.00	0.05
128	300498	温氏股份	2,500	42,700.00	0.05
129	601116	三江购物	3,900	42,471.00	0.05
130	688085	三友医疗	2,200	42,306.00	0.05
131	600066	宇通客车	1,700	42,262.00	0.05
132	301397	溯联股份	1,200	42,216.00	0.05
133	603499	翔港科技	2,560	42,214.40	0.05
134	605183	确成股份	2,400	42,000.00	0.05
135	002293	罗莱生活	4,800	41,952.00	0.05
136	688786	悦安新材	1,800	41,940.00	0.05
137	603103	横店影视	2,600	41,730.00	0.05
138	600055	万东医疗	2,400	41,472.00	0.05
139	600163	中闽能源	8,100	41,472.00	0.05
140	301162	国能日新	800	41,344.00	0.05
141	002180	纳思达	1,800	41,292.00	0.05
142	605259	绿田机械	2,100	41,181.00	0.05
143	603231	索宝蛋白	2,500	40,950.00	0.05
144	601298	青岛港	4,700	40,843.00	0.05
145	300452	山河药辅	3,300	40,491.00	0.05
146	601225	陕西煤业	2,100	40,404.00	0.05
147	603355	莱克电气	1,800	40,356.00	0.05
148	600406	国电南瑞	1,800	40,338.00	0.05
149	002941	新疆交建	3,600	40,104.00	0.05
150	002637	赞宇科技	4,000	39,920.00	0.05
151	003020	立方制药	1,700	37,944.00	0.05
152	688550	瑞联新材	862	37,074.62	0.05
153	002392	北京利尔	5,900	36,816.00	0.05
154	603444	吉比特	100	30,195.00	0.04
155	301232	飞沃科技	700	21,511.00	0.03
156	002745	木林森	1,600	12,608.00	0.02
157	603916	苏博特	40	362.40	0.00

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	002384	东山精密	1,319,433.00	1.53
2	000783	长江证券	946,504.00	1.10
3	301236	软通动力	844,426.00	0.98
4	002500	山西证券	832,489.00	0.96
5	002368	太极股份	808,847.00	0.94

6	002926	华西证券	801,385.00	0.93
7	600901	江苏金租	734,549.00	0.85
8	603893	瑞芯微	714,096.00	0.83
9	601456	国联民生	704,239.00	0.81
10	300002	神州泰岳	691,572.00	0.80
11	300476	胜宏科技	668,500.00	0.77
12	002138	顺络电子	666,476.00	0.77
13	002281	光迅科技	663,416.00	0.77
14	000987	越秀资本	640,605.00	0.74
15	002266	浙富控股	639,129.00	0.74
16	601608	中信重工	603,158.00	0.70
17	300866	安克创新	601,188.00	0.70
18	300001	特锐德	596,241.00	0.69
19	601555	东吴证券	589,582.00	0.68
20	300496	中科创达	585,274.00	0.68

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	002384	东山精密	1,341,136.00	1.55
2	300476	胜宏科技	1,155,563.00	1.34
3	301236	软通动力	989,417.00	1.14
4	002368	太极股份	980,849.00	1.13
5	002500	山西证券	950,382.00	1.10
6	600901	江苏金租	901,654.00	1.04
7	000050	深天马 A	866,850.00	1.00
8	601555	东吴证券	851,884.00	0.99
9	600418	江淮汽车	841,711.00	0.97
10	000559	万向钱潮	836,819.00	0.97
11	000728	国元证券	829,534.00	0.96
12	000563	陕国投 A	775,454.00	0.90
13	300866	安克创新	734,606.00	0.85
14	600879	航天电子	720,258.00	0.83
15	603129	春风动力	718,204.00	0.83
16	600517	国网英大	698,536.00	0.81
17	002281	光迅科技	690,116.00	0.80
18	688002	睿创微纳	668,137.34	0.77
19	601608	中信重工	662,796.00	0.77
20	002261	拓维信息	656,160.00	0.76

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	186,134,715.83
卖出股票收入（成交）总额	201,284,940.04

7.5 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	4,218,511.07	5.34
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)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,218,511.07	5.34

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

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	019766	25 国债 01	42,000	4,218,511.07	5.34

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

注：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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

运用衍生品捕捉利率变动的波段交易机会，并通过期现套利、跨期套利和跨品种套利等择机增厚收益，同时灵活调整组合敞口，控制回撤。

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，无相关投资政策。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

报告期内，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

无。

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	590,631.09
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	346,563.59
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	937,194.68

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限的情况。

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

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中未存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告中因四舍五入原因，投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 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

份额级别	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
兴银中证 500 指数增强 A	1,295	25,516.60	2,649,624.28	8.02%	30,394,372.77	91.98%
兴银中证 500 指数增强 C	11,875	4,167.04	—	0.00%	49,483,647.06	100%
合计	13,170	6,266.34	2,649,624.28	3.21%	79,878,019.83	96.79%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	兴银中证 500 指数增强 A	9.52	0.00%
	兴银中证 500 指数增强 C	41,793.43	0.08%
	合计	41,802.95	0.05%

注：份额占比为四舍五入后的结果。

8.3 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	份额级别	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	兴银中证 500 指数增强 A	0
	兴银中证 500 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	兴银中证 500 指数增强 A	0
	兴银中证 500 指数增强 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	兴银中证 500 指数增强 A	兴银中证 500 指数增强 C
本报告期期初基金份额总额	32,013,057.22	64,883,262.74
本报告期基金总申购份额	5,473,535.82	9,472,264.16
减：本报告期基金总赎回份额	4,442,595.99	24,871,879.84
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	33,043,997.05	49,483,647.06

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

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）2025 年 1 月 17 日，易勇担任基金管理人总经理。
- （2）2025 年 1 月 24 日，郑翊鸣不再担任基金管理人财务总监。
- （3）2025 年 3 月 28 日，总经理易勇代为履行公司董事长职务，吴若曼不再担任基金管理人董事长。
- （4）2025 年 8 月 29 日，黄德良担任基金管理人董事长，总经理易勇先生不再代为履行董事长职务。
- （5）报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

无。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），报告期内无改聘情况。

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

注：报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人及其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	
民生证券	2	207,825,771.02	53.64%	42,789.68	54.61%	-
招商证券	2	140,717,032.25	36.32%	27,562.68	35.18%	-
广发证券	2	38,876,852.60	10.03%	8,004.66	10.22%	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	2	-	-	-	-	-

注：注 1：基金租用证券公司交易单元的选择标准是：

（一）财务状况良好，经审计的最近一年年报中资产、经营情况需满足下列条件之一：

- 1、总资产 100 亿元以上；
- 2、净资产 20 亿元以上；
- 3、营业收入 10 亿元以上；
- 4、净资本 20 亿元以上。

（二）经营行为规范、合规风控能力较强，近三年内无重大违法违规记录。

（三）研究团队具备丰富的产业研究经验与资源，能够为基金业务提供较高质量的研究服务。

（四）交易系统完善，交易链路安全、稳健、性能高，可为多种类型机构提供交易服务，能及时响应交易系统需求。

选择程序是：研究与创新投资部对拟选择参与证券交易的证券公司开展尽职调查，对其财务状况、经营行为、合规风控、研究服务、交易服务等进行评估，并出具证券公司参与证券交易准入评估报告，经研究与创新部负责人、交易部、合规与风险管理部审核，督察长、总经理审批后，交由交易部办理协议签署等事宜。

注 2：本报告期内本基金租用证券公司交易单元变更情况如下： 无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金 额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例	成交金 额	占当期 权证成 交总额 的比例	成交金 额	占当期 基金成 交总额 的比例
民生证券	16,193,991.00	72.97%	-	-	-	-	-	-
招商证券	5,997,368.00	27.03%	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	兴银基金管理有限责任公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报	2025-01-18
2	2024 年 4 季度报告	指定网站	2025-01-22
3	兴银基金管理有限责任公司旗下基金 2024 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报	2025-01-22
4	兴银基金管理有限责任公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报	2025-01-25
5	关于兴银基金管理有限责任公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告、兴银基金管理有限责任公司兴银中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同	证券时报、指定网站	2025-03-20
6	兴银中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）（2025 年第 1 号）、兴银中证 500 指数增强型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	指定网站、中数平台	2025-03-24
7	兴银基金管理有限责任公司关于董事长变更的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报	2025-03-29
8	2024 年年度报告	指定网站	2025-03-31

9	兴银基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年年度报告提示性公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报	2025-03-31
10	2025 年第 1 季度报告	指定网站	2025-04-22
11	兴银基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、指定网站	2025-04-22
12	关于旗下部分基金在蚂蚁基金开通基金转换业务的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、指定网站	2025-05-08
13	关于警惕不法分子冒用兴银基金及其工作人员名义进行非法活动的重要提示	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、指定网站	2025-05-30

§ 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

注：本基金本报告期内单一投资者持有基金份额比例未出现超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予兴银聚瑞债券型证券投资基金变更注册为兴银中证 500 指数增强型证券投资基金的文件
2. 《兴银中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》
3. 《兴银中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》
4. 《兴银中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照
6. 报告期内在指定信息披露媒体上公开披露的各项公告
7. 中国证监会规定的其他备查文件

12.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处。

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。投资者对本报告书如有疑问，可拨打客服电话（40000-96326）咨询本基金管理人。

兴银基金管理有限责任公司

二〇二五年八月三十日