
兴业中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金

(原兴业中证A500指数型证券投资基金转型)

2025年第2季度报告

2025年06月30日

基金管理人:兴业基金管理有限公司

基金托管人:中信证券股份有限公司

报告送出日期:2025年07月21日

§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。

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年07月17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。

本报告中，兴业中证A500指数型证券投资基金的报告期自2025年04月29日起至2025年05月22日止，兴业中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金报告期自2025年05月23日起至2025年06月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况(转型后)

基金简称	兴业中证A500ETF联接
基金主代码	023865
基金运作方式	契约型开放式
基金转型合同生效日	2025年05月23日
报告期末基金份额总额	132,105,169.79份
投资目标	通过主要投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	主要投资策略：1、目标ETF投资策略；2、股票投资策略；3、存托凭证投资策略；4、债券（除可转换债券和可交换债券）投资策略；5、资产支持证券的投资策略；6、可转换债券和可交换债券投资策略；7、股指期货投资策略；8、国债期货投资策略；9、参与融资与转融通证券出借业务策略。
业绩比较基准	中证A500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ETF联接基金，目标 ETF 为股票型基金，

	其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要通过投资于目标ETF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市场相似的风险收益特征。	
基金管理人	兴业基金管理有限公司	
基金托管人	中信证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	兴业中证A500ETF联接A	兴业中证A500ETF联接C
下属分级基金的交易代码	023865	023866
报告期末下属分级基金的份额总额	61,356,705.51份	70,748,464.28份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	兴业中证A500交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	563650
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025-03-25
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2025-04-03
基金管理人名称	兴业基金管理有限公司
基金托管人名称	中信证券股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

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。
投资策略	本基金采用完全复制法，即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。当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。主要投资策略包括：1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、存托凭证投资策略；4、债券投资策略；5、可转

	换债券、可交换债券投资策略；6、资产支持证券投资策略；7、衍生品投资策略；8、参与融资与转融通证券出借业务策略。
业绩比较基准	中证A500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。

2.1 基金基本情况(转型前)

基金简称	兴业中证A500指数	
基金主代码	023865	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025年04月29日	
报告期末基金份额总额	220,916,166.52份	
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。	
投资策略	主要投资策略有:1、大类资产配置；2、股票投资策略；3、存托凭证投资策略；4、债券（除可转换债券和可交换债券）投资策略；5、资产支持证券的投资策略；6、可转换债券和可交换债券投资策略；7、股指期货投资策略；8、国债期货投资策略；9、参与融资与转融通证券出借业务策略	
业绩比较基准	中证A500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，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。	
基金管理人	兴业基金管理有限公司	
基金托管人	中信证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	兴业中证A500指数A	兴业中证A500指数C
下属分级基金的交易代码	023865	023866
报告期末下属分级基金的份额总	51,734,211.93份	169,181,954.59份

额		
---	--	--

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标(转型后)

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2025年05月23日 - 2025年06月30日)	
	兴业中证A500ETF联接A	兴业中证A500ETF联接C
1.本期已实现收益	773,969.01	948,202.74
2.本期利润	1,481,959.95	2,506,424.22
3.加权平均基金份额本期利润	0.0278	0.0211
4.期末基金资产净值	62,983,311.03	72,598,433.23
5.期末基金份额净值	1.0265	1.0261

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、根据公告《关于兴业中证A500指数型证券投资基金变更为兴业中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金并修改基金合同及托管协议的公告》，自2025年5月23日起，兴业中证A500指数型证券投资基金正式变更为兴业中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金，《兴业中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》生效，原《兴业中证A500指数型证券投资基金基金合同》自同日失效。

3.1 主要财务指标(转型前)

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2025年04月29日 - 2025年05月22日)	
	兴业中证A500指数A	兴业中证A500指数C
1.本期已实现收益	26,967.93	84,069.45
2.本期利润	28,326.27	90,285.11
3.加权平均基金份额本期利润	0.0004	0.0002
4.期末基金资产净值	51,754,410.21	169,227,728.19
5.期末基金份额净值	1.0004	1.0003

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、根据公告《关于兴业中证A500指数型证券投资基金变更为兴业中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金并修改基金合同及托管协议的公告》，自2025年5月23日起，兴业中证A500指数型证券投资基金正式变更为兴业中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金，《兴业中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》生效，原《兴业中证A500指数型证券投资基金基金合同》自同日失效。

4、本基金合同于2025年4月29日生效。

3.2 基金净值表现(转型后)

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

兴业中证A500ETF联接A净值表现

阶段	净值增长率①	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
自基金合同生效起至今	2.61%	0.47%	0.93%	0.58%	1.68%	-0.11%

本基金的业绩比较基准为：中证 A500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%

兴业中证A500ETF联接C净值表现

阶段	净值增长率①	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
自基金合同生效起至今	2.58%	0.47%	0.93%	0.58%	1.65%	-0.11%

本基金的业绩比较基准为：中证 A500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%

3.2.2 自基金转型以来基金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



- 1、根据公告《关于兴业中证 A500 指数型证券投资基金变更为兴业中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金并修改基金合同及托管协议的公告》，自 2025 年 5 月 23 日起，兴业中证 A500 指数型证券投资基金正式变更为兴业中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金，《兴业中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》生效，原《兴业中证 A500 指数型证券投资基金基金合同》自同日失效。
- 2、本基金基金合同于 2025 年 5 月 23 日生效，截至报告期末本基金基金合同生效未满一年。
- 3、根据本基金基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截止本报告期末本基金仍处于建仓期。



- 1、根据公告《关于兴业中证 A500 指数型证券投资基金变更为兴业中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金并修改基金合同及托管协议的公告》，自 2025 年 5 月 23 日起，兴业中证 A500 指数型证券投资基金正式变更为兴业中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金，《兴业中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》生效，原《兴业中证 A500 指数型证券投资基金基金合同》自同日失效。
- 2、本基金基金合同于 2025 年 5 月 23 日生效，截至报告期末本基金基金合同生效未满一年。
- 3、根据本基金基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截止本报告期末本基金仍处于建仓期。

3.2 基金净值表现(转型前)

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

兴业中证A500指数A净值表现

阶段	净值增长率①	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
自基金合同生效起至今 (2025年4月29日-2025年5月22日)	0.04%	0.00%	3.29%	0.62%	-3.25%	-0.62%

本基金的业绩比较基准为：中证 A500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%

兴业中证A500指数C净值表现

阶段	净值增长率①	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
自基金合同生效起至今 (2025年4月29日-2025年5月22日)	0.03%	0.00%	3.29%	0.62%	-3.26%	-0.62%

本基金的业绩比较基准为：中证 A500 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



- 1、

本基金合同于 2025 年 4 月 29 日生效。
- 2、

根据本基金基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。



- 1、本基金合同于 2025 年 4 月 29 日生效。
- 2、根据本基金基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

转型后

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
楼华锋	基金经理	2025-05-23	-	15年	中国籍，上海交通大学通信与信息系统专业硕士学历，具有证券投资基金从业资格。曾就职于东方证券研究所担任金工分析师、光大证券信用业务部担任高级经理、方正证券研究所担任金融工程高级分析师；曾任银河基金管理有限公司量化与指数工作室负责人。2021

					年6月加入兴业基金管理有 限公司，现任基金经理。
徐成城	基金经理	2025- 06-16	-	21年	中国籍，硕士学位，具有证 券投资基金从业资格。曾就 职于闽发证券有限责任公 司、国泰基金管理有限公司，历任交易员、基金经理 助理、基金经理。2023年11 月加入兴业基金管理有限 公司，现任权益投资部总经 理助理、基金经理。

- 1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离职日期”为根据
公司决定确定的解聘日期，除首任基金经理外，“任职日期”和“离任日期”分别指根
据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；
- 2、证券从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监
督管理办法》的相关规定。

转型前

姓名	职务	任本基金的基 金经理期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
楼华锋	基金经理	2025- 04-29	2025- 05-22	15年	中国籍，上海交通大学通信 与信息系统专业硕士学历， 具有证券投资基金从业资格。 曾就职于东方证券研究所担任金工分析师、光大证 券信用业务部担任高级经 理、方正证券研究所担任金 融工程高级分析师；曾任银 河基金管理有限公司量化 与指数工作室负责人。2021 年6月加入兴业基金管理有 限公司，现任基金经理。

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

2、证券从业的含义遵从《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。

4.2 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》及其配套法律法规、基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内，本基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2025年二季度，市场在四月初剧烈调整后呈现反弹态势，中证全指录得涨幅2.64%，市场风格分化，小盘指数较为占优。沪深300、中证500、中证1000、中证2000的涨跌幅分别为1.25%、0.98%、2.08%、7.62%，代表微盘股的中证2000指数表现最为突出。上证180、中证A500、科创综指等新指数的涨幅分别为2.04%、0.84%、3.27%，科创板指数表现最为亮眼。

分行业来看，二季度表现最好的申万一级行业分别是国防军工、银行和通信，分别录得15.01%、10.84%、10.69%的涨幅，表现最差的分别是钢铁、家用电器和食品饮料行业。

中证A500指数从沪深两市选取市值较大、流动性较好的500只证券作为指数样本，以反映各行业最具代表性上市公司证券的整体表现。在四月初外部贸易冲击的影响下，股指迎来了近9%的回调，但随后的20个交易日内指数逐步反弹，之后维持震荡格局。当前指数PE估值回升到了66.5%分位，业绩的修复尚需时日，从PB维度看，当前中证A500指数估值位于22.9%分位数，仍处在有吸引力的位置上。在新国九条的推动下，头部企业在分红上更加积极，中证A500指数也有望表现出更多的分红吸引力，截至2025年二季度末，指数近12个月股息率2.96%，在无风险收益率下行的背景下，中证A500指数的股息率超过10年国债收益率将持续维持。

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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2025年5月22日，兴业中证A500指数A基金份额净值为1.0004元；自2025年4月29日至2025年5月22日本基金份额净值增长率为0.04%，同期业绩比较基准收益率为3.29%。

截至2025年5月22日，兴业中证A500指数C基金份额净值为1.0003元；自2025年4月29日至2025年5月22日本基金份额净值增长率为0.03%，同期业绩比较基准收益率为3.29%。

截至2025年6月30日，兴业中证A500ETF联接A基金份额净值为1.0265元；自2025年5月23日至2025年6月30日本基金份额净值增长率为2.61%，同期业绩比较基准收益率为0.93%。

截至2025年6月30日，兴业中证A500ETF联接C基金份额净值为1.0261元；自2025年5月23日至2025年6月30日本基金份额净值增长率为2.58%，同期业绩比较基准收益率为0.93%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

§5 投资组合报告(转型后)

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	4,200.00	0.00
	其中：股票	4,200.00	0.00
2	基金投资	125,711,485.56	90.62
3	固定收益投资	2,608,034.36	1.88
	其中：债券	2,608,034.36	1.88
	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	8,523,236.39	6.14

	计		
8	其他资产	1,877,461.34	1.35
9	合计	138,724,417.65	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	4,200.00	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息 技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施 管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他 服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,200.00	0.00

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净
---	------	------	-------	---------	--------

号					值比例（%）
1	603077	和邦生物	2,400	4,200.00	0.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	2,608,034.36	1.92
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	2,608,034.36	1.92

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	019773	25国债08	26,000	2,608,034.36	1.92

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	类型	运作方式	管理人	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
----	------	----	------	-----	---------	--------------

1	兴业中证A500交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式	兴业基金管理有限公司	125,711,485.56	92.72
---	------------------------	-----	--------	------------	----------------	-------

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资国债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。

5.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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。

5.12.2 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。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	1,875,662.54
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	1,798.80
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,877,461.34

5.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票无流通受限。

§5 投资组合报告（转型前）

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	54,074.00	0.01
	其中：股票	54,074.00	0.01
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	460,462,642.20	99.98
8	其他资产	21,224.95	0.00
9	合计	460,537,941.15	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	54,074.00	0.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息 技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施 管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他 服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	54,074.00	0.02

5.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.3 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

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

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	300750	宁德时代	200	54,074.00	0.02
---	--------	------	-----	-----------	------

5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金投资国债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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	21,224.95
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	21,224.95

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票无流通受限。

5.11.5.2 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无流通受限。

§6 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

	兴业中证A500ETF联接 A	兴业中证A500ETF联接 C
基金合同生效日(2025年05月23日)基金份额总额	51,734,211.93	169,181,954.59
基金合同生效日起至报告期期末	35,496,156.29	837,229.83

基金总申购份额		
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	25,873,662.71	99,270,720.14
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	61,356,705.51	70,748,464.28

总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§6 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

	兴业中证A500指数A	兴业中证A500指数C
基金合同生效日的基金份额总额	77,795,105.52	382,484,387.05
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,707.67	23,758.41
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	26,062,601.26	213,326,190.87
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	51,734,211.93	169,181,954.59

总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况(转型后)

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	20250613-20250630	-	34,662,771.12	-	34,662,771.12	26.24%
产品特有风险							
本基金本报告期出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。如果该类投资者集中赎回，可能会对本基金造成流动性压力；同时，该等集中赎回将可能产生（1）份额净值尾差风险；（2）基金净值波动的风险；（3）因引发基金本身的巨额赎回而导致中小投资者无法及时赎回的风险；（4）因基金资产净值低于5000万元从而影响投资目标实现或造成基金终止等风险。管理人将在基金运作中保持合适的流动性水平，并对申购赎回进行合理的应对，加强防范流动性风险，保护持有人利益。							

注：上述份额占比为四舍五入，保留两位小数后的结果。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

为了更好地满足投资者的投资需求，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》等法律法规的规定和《基金合同》的约定：“基金管理人在履行适当程序后有权决定将本基金转换为本基金管理人管理的跟踪同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF）的联接基金，并相应修改《基金合同》，届时依照《信息披露办法》的有关规定公告。”本公司经与本基金的基金托管人中信证券股份有限公司协商一致后，决定自2025年5月23日起，将兴业中证A500指数型证券投资基金变更为兴业中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金，并据此修订《兴业中证A500指数型证券投资基金基金合同》。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- （一）中国证监会准予兴业中证A500指数型证券投资基金募集注册的文件
- （二）《兴业中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》
- （三）《兴业中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》
- （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

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的住所

9.3 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

2025年07月21日