

兴银中证 500 指数增强型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 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:2026 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年08月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年01月01日起至2026年06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	9
§ 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合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	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	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	55
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	55
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	55
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55

7.12 投资组合报告附注	56
§ 8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
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	57
§ 9 开放式基金份额变动	57
§ 10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	58
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	59
10.8 其他重大事件	60
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	60
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	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§ 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	45,531,435.29 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	20,229,390.15 份	25,302,045.14 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	张庄波	胡燕
	联系电话	86-21-20296383	0571-87659392
	电子邮箱	zhangzb@hffunds.cn	zsyhztgb@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

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
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.hffunds.cn
基金中期报告置备地点	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（2026 年 01 月 01 日-2026 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	4,658,350.36	6,448,394.94
本期利润	3,655,892.70	5,204,180.04
加权平均基金份额本期利润	0.1691	0.1768
本期加权平均净值利润率	12.80%	13.53%
本期基金份额净值增长率	14.13%	14.02%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	

期末可供分配利润	7,691,448.84	9,228,584.00
期末可供分配基金份额利润	0.3802	0.3647
期末基金资产净值	27,920,838.99	34,530,629.14
期末基金份额净值	1.3802	1.3647
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	38.02%	36.47%

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
过去三个月	11.65%	1.43%	17.61%	1.56%	-5.96%	-0.13%
过去六个月	14.13%	1.46%	19.93%	1.58%	-5.80%	-0.12%
过去一年	43.32%	1.26%	49.68%	1.35%	-6.36%	-0.09%
过去三年	48.25%	1.30%	48.15%	1.41%	0.10%	-0.11%
过去五年	27.89%	1.23%	31.61%	1.30%	-3.72%	-0.07%
自基金合同生 效起至今	38.02%	1.21%	40.35%	1.27%	-2.33%	-0.06%

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
过去三个月	11.59%	1.43%	17.61%	1.56%	-6.02%	-0.13%
过去六个月	14.02%	1.46%	19.93%	1.58%	-5.91%	-0.12%
过去一年	43.04%	1.26%	49.68%	1.35%	-6.64%	-0.09%
过去三年	47.34%	1.30%	48.15%	1.41%	-0.81%	-0.11%
过去五年	26.61%	1.23%	31.61%	1.30%	-5.00%	-0.07%
自基金合同生 效起至今	36.47%	1.21%	40.35%	1.27%	-3.88%	-0.06%

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-2026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-2026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。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，华福证券股份有限公司出资比例为 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 72 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	-	5 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团队主管、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

2026 年上半年，A 股市场呈现较为明显的结构性分化特征，人工智能算力、半导体、光通信及高端制造等科技成长方向阶段性表现较为突出，部分时段市场交投较为活跃，为宽基量化策略挖掘个股层面的超额收益提供了一定条件。与此同时，二季度以来，市场上涨更多集中于部分景气度较高的行业和强势个股，不同行业及个股之间的表现差异有所扩大，对量化策略适应行业轮动、风格切换及交易拥挤等市场变化的能力提出了更高要求。

报告期内，不同量化产品的业绩表现有所分化。部分偏重科技成长风格的产品取得了相对较好的阶段性表现；部分注重均衡配置的产品，在市场风格较为集中的阶段，超额收益出现一定波动；部分风格暴露相对较高的策略，在市场快速切换过程中面临一定的回撤压力。公开资料显示，截至 2026 年 6 月 30 日，万得全 A 等权指数上半年收益率为-1.37%，科技成长类指数同期表现相对较强，反映出报告期内市场风格分化较为明显。

在上述市场环境下，传统多因子策略所采用的分散化投资方式，以及部分偏逆向交易的高频策略特征，阶段性面临一定的超额收益获取压力。本基金模型的超额收益在二季度中后段也出现了一定回撤。经过对因子表现、策略特征及市场环境综合分析，我们认为，当前市场分化程度处于相对较高水平，后续市场风格存在逐步再平衡的可能，但其演变节奏和幅度仍具有不确定性。基于此，本基金继续坚持因子均衡和组合分散的多因子选股框架，同时结合市场情况，在对风险控制模型进行升级的同时避免引入主观风格判断，持续加强超额收益回撤管理。

2026 年上半年，在策略构建方面，本基金继续坚持风险控制与风格相对均衡的投资理念，基于 Barra 多因子模型，对市值、行业、估值、波动率及流动性等主要风险因子敞口进行持续监测和

约束，尽量避免组合收益过度依赖某一类市场风格。面对科技成长主线表现较强、行业间分化有所扩大的市场环境，本基金在保持对业绩比较基准有效跟踪的基础上，根据市场风险特征调整和完善风险控制模型约束，避免主观风格暴露，使超额收益更多来源于个股选择。在追求长期超额收益的过程中，本基金注重控制超额收益波动，努力改善组合的风险调整后收益表现，降低短期追逐市场风格可能带来的回撤风险。

在策略研发方面，我们持续跟踪境内外量化投资领域的发展趋势，依托现有的数据和计算基础设施，不断完善涵盖基本面因子、高频价量信号及另类数据的多维因子体系。通过机器学习等方法开展因子评估、动态加权和组合优化研究，持续检验不同因子在各类市场环境下的有效性和稳健性，努力拓展超额收益来源并提升模型的适应能力。

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 1.3802 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 14.13%，同期业绩比较基准收益率为 19.93%；截至报告期末兴银中证 500 指数增强 C 基金份额净值为 1.3647 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 14.02%，同期业绩比较基准收益率为 19.93%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，本基金将继续发挥量化模型在组合构建、风险管理和个股选择等方面的作用，重视回撤及超额收益波动管理，努力提升长期风险调整后收益表现。对于本基金及其业绩比较基准所覆盖的成长风格上市公司，我们将持续关注其基本面变化、估值水平和产业发展趋势，并根据模型信号及风险控制要求审慎开展投资运作。

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 2026 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：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	5,339,105.63	3,348,251.07
结算备付金		1,118,116.47	1,298,712.25
存出保证金		463,358.53	222,806.87
交易性金融资产	6.4.7.2	55,486,178.73	66,129,167.71
其中：股票投资		55,486,178.73	65,626,152.64
基金投资		-	-
债券投资		-	503,015.07
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		724,705.82	-
应收股利		-	-
应收申购款		51,729.17	192,477.26
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		63,183,194.35	71,191,415.16
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 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		265,204.21	55.66
应付赎回款		108,116.54	239,216.71
应付管理人报酬		40,811.17	48,224.92
应付托管费		10,202.81	12,056.23
应付销售服务费		5,712.57	7,160.19

应付投资顾问费		-	-
应交税费		2,291.33	2,625.36
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	299,387.59	235,710.91
负债合计		731,726.22	545,049.98
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	45,531,435.29	58,770,657.67
未分配利润	6.4.7.8	16,920,032.84	11,875,707.51
净资产合计		62,451,468.13	70,646,365.18
负债和净资产总计		63,183,194.35	71,191,415.16

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 45,531,435.29 份。其中兴银中证 500 指数增强 A 基金份额净值 1.3802 元，基金份额总额 20,229,390.15 份；兴银中证 500 指数增强 C 基金份额净值 1.3647 元，基金份额总额 25,302,045.14 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：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
一、营业总收入		9,289,014.58	6,514,723.85
1. 利息收入		1,804.05	3,505.67
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,804.05	3,505.67
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）		11,506,908.42	2,376,165.88
其中：股票投资收益	6.4.7.10	10,836,111.30	1,533,370.69
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	835.43	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	306,550.68	144,126.94
股利收益	6.4.7.15	363,411.01	692,662.41
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	-2,246,672.56	4,124,869.70

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	26, 974. 67	10, 182. 60
减：二、营业总支出		428, 941. 84	493, 366. 96
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	267, 463. 12	309, 244. 84
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	66, 865. 85	77, 311. 26
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	38, 256. 06	48, 262. 08
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		1, 312. 90	690. 86
8. 其他费用	6. 4. 7. 18	55, 043. 91	57, 857. 92
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		8, 860, 072. 74	6, 021, 356. 89
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		8, 860, 072. 74	6, 021, 356. 89
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		8, 860, 072. 74	6, 021, 356. 89

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：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 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	58, 770, 657. 67	11, 875, 707. 51	70, 646, 365. 18
二、本期期初净资产	58, 770, 657. 67	11, 875, 707. 51	70, 646, 365. 18
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-13, 239, 222. 38	5, 044, 325. 33	-8, 194, 897. 05
（一）、综合收益总额	-	8, 860, 072. 74	8, 860, 072. 74
（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）	-13, 239, 222. 38	-3, 815, 747. 41	-17, 054, 969. 79
其中：1. 基金申购款	21, 887, 460. 13	6, 967, 701. 95	28, 855, 162. 08
2. 基金赎回款	-35, 126, 682. 51	-10, 783, 449. 36	-45, 910, 131. 87
（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	45,531,435.29	16,920,032.84	62,451,468.13
项 目	上年度可比期间 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

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，同时亦按照中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号—年度报告和中期报告》、《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 2026 年 6 月 30 日的财务状况、自 2026 年 1 月 1 日至 2026 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》、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》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》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) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照3%的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，自2026年1月1日至2027年12月31日，免征增值税；对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。自2025年8月8日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在2025年8月8日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对本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，股票的股息、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。

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对本基金从上市公司、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。对本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。

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

d) 本基金卖出股票按 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) 对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本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 2026 年 06 月 30 日
活期存款	5,339,105.63
等于：本金	5,339,048.47
加：应计利息	57.16
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	5,339,105.63

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	53,389,129.06	—	55,486,178.73	2,097,049.67

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		53,389,129.06	-	55,486,178.73	2,097,049.67

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 2026 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	3,411,560.00	-	-	-
—股指期货	3,411,560.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,411,560.00	-	-	-

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
IC2607	IC2607	1	1,785,640.00	66,000.00
IC2609	IC2609	1	1,752,280.00	60,360.00
合计				126,360.00
减：可抵销期货暂收款				126,360.00
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 2026 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	16.92
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	84,326.76
其中：交易所市场	84,326.76
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	215,043.91
合计	299,387.59

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	24,413,932.92	24,413,932.92
本期申购	10,486,787.74	10,486,787.74
本期赎回（以“-”号填列）	-14,671,330.51	-14,671,330.51
本期末	20,229,390.15	20,229,390.15

兴银中证 500 指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	34,356,724.75	34,356,724.75
本期申购	11,400,672.39	11,400,672.39
本期赎回（以“-”号填列）	-20,455,352.00	-20,455,352.00

本期末	25,302,045.14	25,302,045.14
-----	---------------	---------------

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	4,378,682.00	730,507.98	5,109,189.98
本期期初	4,378,682.00	730,507.98	5,109,189.98
本期利润	4,658,350.36	-1,002,457.66	3,655,892.70
本期基金份额交易产生的变动数	-1,042,844.33	-30,789.51	-1,073,633.84
其中：基金申购款	3,140,115.13	216,571.26	3,356,686.39
基金赎回款	-4,182,959.46	-247,360.77	-4,430,320.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,994,188.03	-302,739.19	7,691,448.84

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	5,751,294.62	1,015,222.91	6,766,517.53
本期期初	5,751,294.62	1,015,222.91	6,766,517.53
本期利润	6,448,394.94	-1,244,214.90	5,204,180.04
本期基金份额交易产生的变动数	-2,595,030.38	-147,083.19	-2,742,113.57
其中：基金申购款	3,454,580.70	156,434.86	3,611,015.56
基金赎回款	-6,049,611.08	-303,518.05	-6,353,129.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,604,659.18	-376,075.18	9,228,584.00

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	1,157.46
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	568.26
其他	78.33
合计	1,804.05

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	342,461,281.21
减：卖出股票成本总额	331,277,464.22
减：交易费用	347,705.69
买卖股票差价收入	10,836,111.30

6.4.7.10.2 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益证券出借差价收入。

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	437.49
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	397.94
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	835.43

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	805,359.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	800,564.00
减：应计利息总额	4,397.06
减：交易费用	—
买卖债券差价收入	397.94

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股指期货投资收益	319,480.00
减：其他衍生工具收益应缴纳增值税	10,939.80
减：交易费用	1,989.52
合计	306,550.68

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	363,411.01
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	363,411.01

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-2,370,392.97
——股票投资	-2,370,592.97
——债券投资	200.00
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2. 衍生工具	126,000.00
——权证投资	—
——期货投资	126,000.00
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	2,279.59
合计	-2,246,672.56

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	26,963.73
转换费收入	10.94
合计	26,974.67

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 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	-
合计	55,043.91

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、关联关系

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

本报告期末不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
华福证券股份有限公司（以下简称“华福证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

“华福证券”)	
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 基金交易

注：本基金本报告期以及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.6 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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	267,463.12	309,244.84
其中：应支付销售机构的客户维护费	127,868.06	133,498.21
应支付基金管理人的净管理费	139,595.06	175,746.63

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	66,865.85	77,311.26

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 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	-	359.33	359.33
兴银基金	-	1.59	1.59
浙商银行	-	5,064.87	5,064.87
合计	-	5,425.79	5,425.79
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 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

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 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	2,649,624.28	—
报告期末持有的基金份额	—	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%

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 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	5,339,105.63	1,157.46	2,649,979.05	2,823.61

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（2026 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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购。

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 2026 年	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
---------------	--------	-----------	----------	----------	-----------	-----	----

06 月 30 日							
资产							
货币资金	5,339,105.63	-	-	-	-	-	5,339,105.63
结算备付金	1,118,116.47	-	-	-	-	-	1,118,116.47
存出保证金	463,358.53	-	-	-	-	-	463,358.53
交易性金融资产	-	-	-	-	-	55,486,178.73	55,486,178.73
应收清算款	-	-	-	-	-	724,705.82	724,705.82
应收申购款	-	-	-	-	-	51,729.17	51,729.17
资产总计	6,920,580.63	-	-	-	-	56,262,613.72	63,183,194.35
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	265,204.21	265,204.21
应付赎回款	-	-	-	-	-	108,116.54	108,116.54
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	40,811.17	40,811.17
应付托管费	-	-	-	-	-	10,202.81	10,202.81
应付销售服务费	-	-	-	-	-	5,712.57	5,712.57
应交税费	-	-	-	-	-	2,291.33	2,291.33
其他负债	-	-	-	-	-	299,387.59	299,387.59
负债总计	-	-	-	-	-	731,726.22	731,726.22
利率敏感度缺口	6,920,580.63	-	-	-	-	55,530,887.50	62,451,468.13
上年度末 2025 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	3,348,251.07	-	-	-	-	-	3,348,251.07
结算备付金	1,298,712.25	-	-	-	-	-	1,298,712.25
存出保证金	222,806.87	-	-	-	-	-	222,806.87
交易性金融资产	-	-	503,015.07	-	-	65,626,152.64	66,129,167.71
应收申购款	-	-	-	-	-	192,477.26	192,477.26
资产总计	4,869,770.19	-	503,015.07	-	-	65,818,629.90	71,191,415.16
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	55.66	55.66
应付赎回款	-	-	-	-	-	239,216.71	239,216.71
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	48,224.92	48,224.92
应付托管费	-	-	-	-	-	12,056.23	12,056.23
应付销售服务费	-	-	-	-	-	7,160.19	7,160.19
应交税费	-	-	-	-	-	2,625.36	2,625.36
其他负债	-	-	-	-	-	235,710.91	235,710.91
负债总计	-	-	-	-	-	545,049.98	545,049.98
利率敏感度缺口	4,869,770.19	-	503,015.07	-	-	65,273,579.92	70,646,365.18

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。		
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	上年度末

	2026 年 06 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
市场利率上升 25 个基点	-	-700.15
市场利率下降 25 个基点	-	701.50

注：于 6 月 30 日，本基金未持有对利率敏感的金融资产与金融负债。因此，市场利率的变动对本基金资产的净值无重大影响。

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 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 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	55,486,178.73	88.85	65,626,152.64	92.89
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	503,015.07	0.71
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	55,486,178.73	88.85	66,129,167.71	93.61

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 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上涨 5%	3,678,002.03	3,976,297.04

	沪深 300 指数下跌 5%	-3,678,002.03	-3,976,297.04
--	----------------	---------------	---------------

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 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	55,486,178.73	65,626,152.64
第二层次	-	503,015.07
第三层次	-	-
合计	55,486,178.73	66,129,167.71

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 2026 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(2025 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 2026 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	55,486,178.73	87.82
	其中：股票	55,486,178.73	87.82
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	6,457,222.10	10.22
8	其他各项资产	1,239,793.52	1.96
9	合计	63,183,194.35	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	96,304.00	0.15
B	采矿业	1,536,204.40	2.46
C	制造业	38,338,705.05	61.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	900,959.00	1.44
E	建筑业	417,795.00	0.67
F	批发和零售业	897,894.00	1.44
G	交通运输、仓储和邮政业	351,677.00	0.56
H	住宿和餐饮业	46,774.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,501,066.84	5.61
J	金融业	2,273,521.00	3.64
K	房地产业	237,368.00	0.38
L	租赁和商务服务业	349,740.80	0.56
M	科学研究和技术服务业	416,656.00	0.67
N	水利、环境和公共设施管理业	267,949.00	0.43
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	140,088.00	0.22
R	文化、体育和娱乐业	75,128.00	0.12
S	综合	—	—
	合计	49,847,830.09	79.82

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	23,641.00	0.04
B	采矿业	71,848.00	0.12
C	制造业	4,402,794.06	7.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	95,540.00	0.15
E	建筑业	48,071.00	0.08
F	批发和零售业	99,109.00	0.16
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	549,385.58	0.88
J	金融业	36,185.00	0.06
K	房地产业	23,856.00	0.04
L	租赁和商务服务业	47,871.00	0.08
M	科学研究和技术服务业	143,548.00	0.23
N	水利、环境和公共设施管理业	72,723.00	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	-	-
S	综合	23,777.00	0.04
	合计	5,638,348.64	9.03

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	300604	长川科技	2,000	682,840.00	1.09
2	001309	德明利	700	660,030.00	1.06
3	688347	华虹宏力	1,800	605,340.00	0.97
4	688120	华海清科	1,842	593,455.56	0.95
5	300857	协创数据	1,740	591,426.00	0.95
6	002008	大族激光	3,800	570,418.00	0.91
7	688498	源杰科技	300	565,800.00	0.91
8	002281	光迅科技	2,200	565,268.00	0.91
9	300136	信维通信	4,500	536,625.00	0.86
10	300223	北京君正	2,000	497,800.00	0.80

11	688361	中科飞测	1,086	466,980.00	0.75
12	300475	香农芯创	1,500	450,000.00	0.72
13	002436	兴森科技	8,700	443,265.00	0.71
14	300054	鼎龙股份	3,900	413,283.00	0.66
15	002851	麦格米特	2,300	384,514.00	0.62
16	688777	中控技术	3,174	372,945.00	0.60
17	300285	国瓷材料	3,500	361,130.00	0.58
18	600105	永鼎股份	5,100	344,148.00	0.55
19	300666	江丰电子	900	331,740.00	0.53
20	300346	南大光电	3,500	324,275.00	0.52
21	688019	安集科技	946	321,129.16	0.51
22	688200	华峰测控	600	315,060.00	0.50
23	300757	罗博特科	500	309,500.00	0.50
24	600498	烽火通信	4,200	309,120.00	0.49
25	688037	芯源微	700	307,335.00	0.49
26	600143	金发科技	19,400	299,730.00	0.48
27	002138	顺络电子	4,100	299,710.00	0.48
28	000021	深科技	4,600	295,642.00	0.47
29	688002	睿创微纳	1,893	292,828.17	0.47
30	601611	中国核建	25,400	283,210.00	0.45
31	300390	天华新能	3,000	280,530.00	0.45
32	300548	长芯博创	1,000	278,000.00	0.45
33	688469	芯联集成	25,814	273,886.54	0.44
34	601869	长飞光纤	500	272,950.00	0.44
35	300115	长盈精密	9,700	271,018.00	0.43
36	002409	雅克科技	1,200	269,400.00	0.43
37	600988	赤峰黄金	10,200	268,464.00	0.43
38	002738	中矿资源	4,500	265,455.00	0.43
39	000959	首钢股份	72,700	255,177.00	0.41
40	300567	精测电子	800	254,080.00	0.41
41	300058	蓝色光标	18,380	252,908.80	0.40
42	002273	水晶光电	7,100	251,908.00	0.40
43	300037	新宙邦	2,700	250,695.00	0.40
44	002130	沃尔核材	13,200	250,272.00	0.40
45	002185	华天科技	11,100	247,641.00	0.40
46	002429	兆驰股份	23,700	246,243.00	0.39
47	688313	仕佳光子	1,262	233,028.30	0.37
48	600879	航天电子	10,700	227,803.00	0.36
49	300395	菲利华	1,700	227,341.00	0.36
50	002850	科达利	1,200	227,160.00	0.36
51	300620	光库科技	600	226,920.00	0.36
52	688099	晶晨股份	2,168	223,087.20	0.36
53	600885	宏发股份	6,380	220,046.20	0.35

54	301526	国际复材	4,700	219,349.00	0.35
55	002126	银轮股份	4,400	219,120.00	0.35
56	000960	锡业股份	5,100	217,719.00	0.35
57	600392	盛和资源	7,200	214,344.00	0.34
58	002841	视源股份	6,200	214,086.00	0.34
59	001389	广合科技	900	213,525.00	0.34
60	000831	中国稀土	3,800	210,862.00	0.34
61	603659	璞泰来	7,100	205,403.00	0.33
62	300373	扬杰科技	1,300	204,399.00	0.33
63	002812	恩捷股份	3,000	200,730.00	0.32
64	300339	润和软件	5,200	200,252.00	0.32
65	301358	湖南裕能	2,600	197,262.00	0.32
66	601233	桐昆股份	9,100	197,015.00	0.32
67	601179	中国西电	13,200	196,944.00	0.32
68	688702	盛科通信	500	194,995.00	0.31
69	603308	应流股份	3,200	193,280.00	0.31
70	002195	岩山科技	29,200	190,968.00	0.31
71	002517	恺英网络	11,600	188,500.00	0.30
72	600497	驰宏锌锗	15,500	187,705.00	0.30
73	300458	全志科技	4,680	184,672.80	0.30
74	688172	燕东微	2,200	184,052.00	0.29
75	002261	拓维信息	6,500	182,065.00	0.29
76	300024	机器人	9,300	179,769.00	0.29
77	605358	立昂微	2,300	178,480.00	0.29
78	002465	海格通信	13,800	176,226.00	0.28
79	002340	格林美	26,200	173,182.00	0.28
80	300454	深信服	1,800	173,160.00	0.28
81	603179	新泉股份	3,480	172,782.00	0.28
82	603156	养元饮品	3,500	171,745.00	0.28
83	300017	网宿科技	12,900	167,829.00	0.27
84	000783	长江证券	17,200	167,700.00	0.27
85	688017	绿的谐波	400	167,144.00	0.27
86	603379	三美股份	2,200	166,958.00	0.27
87	605589	圣泉集团	2,600	165,282.00	0.26
88	000060	中金岭南	21,721	164,427.97	0.26
89	688578	艾力斯	1,500	163,800.00	0.26
90	002432	九安医疗	2,300	162,564.00	0.26
91	600352	浙江龙盛	13,400	162,274.00	0.26
92	003031	中瓷电子	900	162,270.00	0.26
93	002203	海亮股份	7,100	162,235.00	0.26
94	002821	凯莱英	1,000	162,000.00	0.26
95	000878	云南铜业	10,200	161,976.00	0.26
96	688220	翱捷科技	1,300	161,616.00	0.26

97	300496	中科创达	2,600	160,654.00	0.26
98	688213	思特威	1,500	160,605.00	0.26
99	002271	东方雨虹	13,500	160,245.00	0.26
100	002966	苏州银行	23,000	160,080.00	0.26
101	600298	安琪酵母	4,400	159,280.00	0.26
102	603256	宏和科技	600	159,198.00	0.25
103	301536	星辰科技	1,200	154,452.00	0.25
104	300073	当升科技	3,200	153,728.00	0.25
105	002756	永兴材料	2,700	152,928.00	0.24
106	300432	富临精工	7,600	152,684.00	0.24
107	688122	西部超导	2,400	150,744.00	0.24
108	600141	兴发集团	3,200	150,304.00	0.24
109	603920	世运电路	3,100	148,924.00	0.24
110	300919	中伟新材	3,400	148,750.00	0.24
111	300570	太辰光	600	148,026.00	0.24
112	300953	震裕科技	1,100	147,070.00	0.24
113	601108	财通证券	17,000	147,050.00	0.24
114	300207	欣旺达	7,600	144,324.00	0.23
115	300001	特锐德	3,800	143,754.00	0.23
116	002797	第一创业	21,800	143,226.00	0.23
117	688387	信科移动	7,119	141,240.96	0.23
118	688234	天岳先进	800	138,808.00	0.22
119	603650	彤程新材	1,400	137,172.00	0.22
120	002064	华峰化学	14,400	136,656.00	0.22
121	688385	复旦微电	1,900	135,451.00	0.22
122	603806	福斯特	8,000	134,320.00	0.22
123	002155	湖南黄金	5,620	134,149.40	0.21
124	600563	法拉电子	700	133,560.00	0.21
125	601666	平煤股份	18,600	132,990.00	0.21
126	601699	潞安环能	9,100	129,948.00	0.21
127	600100	同方股份	18,900	129,465.00	0.21
128	601665	齐鲁银行	22,300	128,671.00	0.21
129	002266	浙富控股	25,100	127,006.00	0.20
130	603596	伯特利	5,100	126,684.00	0.20
131	600536	中国软件	4,500	126,540.00	0.20
132	600595	中孚实业	22,500	126,450.00	0.20
133	603225	新凤鸣	6,400	125,760.00	0.20
134	002402	和而泰	4,800	123,984.00	0.20
135	600909	华安证券	10,900	121,099.00	0.19
136	600985	淮北矿业	8,600	120,830.00	0.19
137	300012	华测检测	8,700	120,582.00	0.19
138	600109	国金证券	13,700	120,286.00	0.19
139	000683	博源化工	20,700	119,232.00	0.19

140	000039	中集集团	14,700	119,217.00	0.19
141	000050	深天马 A	12,000	118,920.00	0.19
142	688266	泽璟制药	1,017	118,643.22	0.19
143	002414	高德红外	8,900	118,014.00	0.19
144	000034	神州数码	4,240	117,660.00	0.19
145	688331	荣昌生物	900	117,234.00	0.19
146	300623	捷捷微电	2,600	116,974.00	0.19
147	002487	大金重工	2,000	115,940.00	0.19
148	603728	鸣志电器	1,900	115,748.00	0.19
149	002444	巨星科技	3,700	115,070.00	0.18
150	300474	景嘉微	1,900	114,912.00	0.18
151	600060	海信视像	4,100	114,267.00	0.18
152	688728	格科微	5,429	114,226.16	0.18
153	000733	振华科技	2,000	113,280.00	0.18
154	000661	长春高新	1,700	113,220.00	0.18
155	300751	迈为股份	400	112,984.00	0.18
156	688629	华丰科技	600	112,506.00	0.18
157	603979	金诚信	1,900	112,157.00	0.18
158	000921	海信家电	4,100	112,012.00	0.18
159	300748	金力永磁	3,600	111,060.00	0.18
160	600699	均胜电子	5,100	110,211.00	0.18
161	301377	鼎泰高科	200	110,180.00	0.18
162	600021	上海电力	7,300	110,011.00	0.18
163	002603	以岭药业	7,300	109,500.00	0.18
164	600316	洪都航空	3,900	108,966.00	0.17
165	601615	明阳智能	9,400	108,758.00	0.17
166	002078	太阳纸业	8,700	108,663.00	0.17
167	300763	锦浪科技	1,200	108,420.00	0.17
168	301200	大族数控	300	108,195.00	0.17
169	301611	珂玛科技	600	108,042.00	0.17
170	603606	东方电缆	2,600	107,926.00	0.17
171	603087	甘李药业	1,900	107,844.00	0.17
172	300142	沃森生物	8,300	107,817.00	0.17
173	002025	航天电器	1,400	106,708.00	0.17
174	600486	扬农化工	2,100	106,470.00	0.17
175	300724	捷佳伟创	1,500	105,900.00	0.17
176	000951	中国重汽	5,400	105,354.00	0.17
177	601555	东吴证券	13,300	105,336.00	0.17
178	002152	广电运通	11,200	105,056.00	0.17
179	000728	国元证券	13,800	103,362.00	0.17
180	600282	南钢股份	22,300	102,357.00	0.16
181	688235	百济神州	400	101,844.00	0.16
182	688166	博瑞医药	2,900	101,529.00	0.16

183	688027	国盾量子	200	100,802.00	0.16
184	600380	健康元	10,500	98,910.00	0.16
185	300676	华大基因	2,800	98,168.00	0.16
186	600602	云赛智联	6,100	98,088.00	0.16
187	601399	国机重装	28,000	98,000.00	0.16
188	000739	普洛药业	5,800	96,628.00	0.15
189	688187	时代电气	1,400	96,124.00	0.15
190	300679	电连技术	1,600	95,984.00	0.15
191	000786	北新建材	5,300	95,877.00	0.15
192	001203	大中矿业	3,200	95,840.00	0.15
193	688180	君实生物	2,824	95,507.68	0.15
194	600535	天士力	7,200	95,256.00	0.15
195	300677	英科医疗	2,400	94,008.00	0.15
196	300383	光环新网	7,500	93,300.00	0.15
197	300759	康龙化成	3,200	92,576.00	0.15
198	603290	斯达半导	600	91,764.00	0.15
199	300718	长盛轴承	1,500	91,455.00	0.15
200	601155	新城控股	8,900	91,314.00	0.15
201	688065	凯赛生物	1,900	90,915.00	0.15
202	600177	雅戈尔	12,000	90,360.00	0.14
203	601608	中信重工	18,800	89,676.00	0.14
204	688018	乐鑫科技	700	89,544.00	0.14
205	000559	万向钱潮	6,900	89,217.00	0.14
206	600642	申能股份	10,200	89,046.00	0.14
207	600350	山东高速	8,000	89,040.00	0.14
208	002601	龙佰集团	5,400	88,992.00	0.14
209	000027	深圳能源	14,300	88,660.00	0.14
210	000623	吉林敖东	5,000	88,650.00	0.14
211	603345	安井食品	1,100	88,209.00	0.14
212	002624	完美世界	7,100	88,182.00	0.14
213	600637	东方明珠	10,500	87,255.00	0.14
214	000703	恒逸石化	6,400	86,848.00	0.14
215	300972	万辰集团	500	86,705.00	0.14
216	002085	万丰奥威	7,800	86,502.00	0.14
217	300699	光威复材	3,000	85,950.00	0.14
218	600801	华新建材	5,400	84,240.00	0.13
219	001286	陕西能源	8,300	84,162.00	0.13
220	002065	东华软件	11,700	83,538.00	0.13
221	600499	科达制造	6,000	82,800.00	0.13
222	002044	美年健康	16,400	82,492.00	0.13
223	300957	贝泰妮	2,600	81,926.00	0.13
224	601958	金钼股份	2,900	81,519.00	0.13
225	000629	钒钛股份	24,400	81,496.00	0.13

226	601991	大唐发电	11,500	81,420.00	0.13
227	300002	神州泰岳	10,400	81,224.00	0.13
228	002430	杭氧股份	2,600	80,496.00	0.13
229	688772	珠海冠宇	4,100	80,483.00	0.13
230	000400	许继电气	3,700	80,290.00	0.13
231	000155	川能动力	6,700	80,266.00	0.13
232	000415	渤海租赁	19,700	80,179.00	0.13
233	002583	海能达	10,400	79,976.00	0.13
234	002223	鱼跃医疗	3,100	79,546.00	0.13
235	600521	华海药业	5,500	79,200.00	0.13
236	601198	东兴证券	5,800	78,822.00	0.13
237	601997	贵阳银行	15,300	78,489.00	0.13
238	601717	中创智领	5,600	77,896.00	0.12
239	603766	隆鑫通用	6,500	77,545.00	0.12
240	601990	南京证券	11,800	77,526.00	0.12
241	603129	春风动力	300	76,740.00	0.12
242	601001	晋控煤业	4,400	76,516.00	0.12
243	300487	蓝晓科技	1,300	76,505.00	0.12
244	600312	平高电气	4,300	75,938.00	0.12
245	000887	中鼎股份	4,200	75,138.00	0.12
246	000729	燕京啤酒	7,400	74,962.00	0.12
247	600332	白云山	3,700	74,148.00	0.12
248	600765	中航重机	5,700	73,644.00	0.12
249	000830	鲁西化工	6,000	72,000.00	0.12
250	600339	中油工程	23,200	71,224.00	0.11
251	002410	广联达	8,700	70,992.00	0.11
252	601139	深圳燃气	12,500	70,750.00	0.11
253	600390	五矿资本	15,500	70,680.00	0.11
254	688052	纳芯微	244	70,347.64	0.11
255	002683	广东宏大	2,400	70,296.00	0.11
256	000062	深圳华强	2,200	70,004.00	0.11
257	600737	中粮糖业	5,600	69,048.00	0.11
258	002926	华西证券	8,400	68,628.00	0.11
259	688615	合合信息	600	67,860.00	0.11
260	601162	天风证券	20,100	67,737.00	0.11
261	688295	中复神鹰	1,102	66,715.08	0.11
262	603568	伟明环保	4,300	66,134.00	0.11
263	600398	海澜之家	12,600	65,898.00	0.11
264	000987	越秀资本	8,300	64,906.00	0.10
265	000528	柳工	8,500	64,175.00	0.10
266	688322	奥比中光	490	63,969.50	0.10
267	603341	龙旗科技	1,500	63,735.00	0.10
268	601099	太平洋	18,700	63,019.00	0.10

269	000932	华菱钢铁	18,100	62,807.00	0.10
270	600435	北方导航	5,600	62,720.00	0.10
271	600998	九州通	13,300	62,377.00	0.10
272	688248	南网科技	900	62,262.00	0.10
273	000738	航发控制	3,400	62,186.00	0.10
274	688301	奕瑞科技	500	62,000.00	0.10
275	603486	科沃斯	1,200	60,900.00	0.10
276	002500	山西证券	11,700	60,372.00	0.10
277	002262	恩华药业	3,200	60,000.00	0.10
278	603885	吉祥航空	5,800	59,682.00	0.10
279	000997	新大陆	3,600	58,680.00	0.09
280	000009	中国宝安	9,400	58,562.00	0.09
281	688336	三生国健	1,100	58,410.00	0.09
282	600820	隧道股份	11,200	58,352.00	0.09
283	603816	顾家家居	2,600	58,136.00	0.09
284	603688	石英股份	700	57,827.00	0.09
285	600763	通策医疗	1,700	57,596.00	0.09
286	600583	海油工程	11,400	57,342.00	0.09
287	600562	国睿科技	2,700	57,294.00	0.09
288	600685	中船防务	2,200	55,968.00	0.09
289	600329	达仁堂	1,500	55,830.00	0.09
290	600256	广汇能源	11,300	55,822.00	0.09
291	600546	山煤国际	5,100	55,743.00	0.09
292	601156	东航物流	3,400	54,808.00	0.09
293	601128	常熟银行	9,400	54,708.00	0.09
294	601865	福莱特	5,200	54,652.00	0.09
295	003022	联泓新科	2,100	54,390.00	0.09
296	000723	美锦能源	16,200	54,270.00	0.09
297	601577	长沙银行	6,100	53,131.00	0.09
298	300100	双林股份	1,900	52,782.00	0.08
299	002568	百润股份	3,100	52,452.00	0.08
300	002244	滨江集团	6,900	52,440.00	0.08
301	003021	兆威机电	600	52,410.00	0.08
302	600906	财达证券	7,000	52,220.00	0.08
303	002120	韵达股份	8,200	52,152.00	0.08
304	600967	内蒙一机	4,800	52,080.00	0.08
305	000598	兴蓉环境	8,100	52,002.00	0.08
306	002299	圣农发展	3,400	51,544.00	0.08
307	600970	中材国际	7,200	51,336.00	0.08
308	600095	湘财股份	6,800	51,204.00	0.08
309	300144	宋城演艺	8,800	51,128.00	0.08
310	000883	湖北能源	11,800	50,976.00	0.08
311	688608	恒玄科技	300	50,157.00	0.08

312	000800	一汽解放	8,400	49,980.00	0.08
313	601118	海南橡胶	10,100	49,692.00	0.08
314	600131	国网信通	3,400	49,640.00	0.08
315	000088	盐田港	12,000	49,080.00	0.08
316	600126	杭钢股份	8,000	49,040.00	0.08
317	688778	厦钨新能	900	48,960.00	0.08
318	301606	绿联科技	800	48,816.00	0.08
319	688192	迪哲医药	1,200	47,916.00	0.08
320	688169	石头科技	500	47,485.00	0.08
321	603000	人民网	3,200	47,328.00	0.08
322	002252	上海莱士	10,900	47,306.00	0.08
323	600655	豫园股份	11,500	47,265.00	0.08
324	600754	锦江酒店	2,600	46,774.00	0.07
325	000825	太钢不锈	13,700	46,717.00	0.07
326	600598	北大荒	4,300	46,612.00	0.07
327	688709	成都华微	1,219	46,431.71	0.07
328	002423	中粮资本	5,600	46,088.00	0.07
329	600663	陆家嘴	7,300	45,844.00	0.07
330	600582	天地科技	10,300	45,835.00	0.07
331	603899	晨光股份	2,200	45,386.00	0.07
332	000423	东阿阿胶	1,000	45,360.00	0.07
333	600848	上海临港	6,000	44,940.00	0.07
334	300888	稳健医疗	1,600	44,784.00	0.07
335	600566	济川药业	2,000	44,380.00	0.07
336	603233	大参林	2,900	43,587.00	0.07
337	600062	华润双鹤	2,700	43,308.00	0.07
338	688561	奇安信	1,800	43,164.00	0.07
339	003035	南网能源	7,400	43,068.00	0.07
340	600968	海油发展	12,800	42,624.00	0.07
341	688425	铁建重工	10,494	42,185.88	0.07
342	688375	国博电子	400	41,720.00	0.07
343	000539	粤电力 A	6,100	41,541.00	0.07
344	002153	石基信息	5,700	41,211.00	0.07
345	688343	云天励飞	500	40,830.00	0.07
346	600098	广州发展	6,900	40,779.00	0.07
347	688708	佳驰科技	800	40,640.00	0.07
348	603119	浙江荣泰	600	39,804.00	0.06
349	601298	青岛港	4,900	39,445.00	0.06
350	603833	欧派家居	1,300	39,143.00	0.06
351	002831	裕同科技	1,086	38,618.16	0.06
352	600292	电投水电	3,200	38,528.00	0.06
353	002265	建设工业	2,200	38,280.00	0.06
354	600032	浙江新能	5,400	38,070.00	0.06

355	603658	安图生物	1,300	37,726.00	0.06
356	300140	节能环保	7,300	36,281.00	0.06
357	603049	中策橡胶	800	35,848.00	0.06
358	603444	吉比特	100	35,842.00	0.06
359	603175	超颖电子	400	35,636.00	0.06
360	688475	萤石网络	1,300	35,555.00	0.06
361	001696	宗申动力	1,700	35,377.00	0.06
362	600171	上海贝岭	1,100	35,134.00	0.06
363	002673	西部证券	5,400	35,046.00	0.06
364	600927	永安期货	2,800	34,860.00	0.06
365	000519	中兵红箭	1,600	33,712.00	0.05
366	002461	珠江啤酒	4,200	31,794.00	0.05
367	688819	天能股份	1,400	31,080.00	0.05
368	000983	山西焦煤	5,300	30,740.00	0.05
369	000750	国海证券	8,200	30,176.00	0.05
370	603092	德力佳	500	26,985.00	0.04
371	002318	久立特材	1,100	26,290.00	0.04
372	300627	华测导航	900	25,560.00	0.04
373	001386	马可波罗	1,800	25,488.00	0.04
374	688676	金盘科技	300	25,392.00	0.04
375	002407	多氟多	500	25,115.00	0.04
376	002056	横店东磁	800	24,384.00	0.04
377	601016	节能风电	6,200	24,056.00	0.04
378	002739	儒意电影	2,500	24,000.00	0.04
379	601216	君正集团	5,300	23,638.00	0.04
380	000032	深桑达 A	900	22,455.00	0.04
381	600863	华能蒙电	4,700	22,090.00	0.04
382	600862	中航高科	1,200	21,636.00	0.03
383	300003	乐普医疗	1,800	21,330.00	0.03
384	002335	科华数据	500	21,225.00	0.03
385	600704	物产中大	4,300	20,296.00	0.03
386	603699	纽威股份	400	20,120.00	0.03
387	300558	贝达药业	300	19,521.00	0.03
388	600873	梅花生物	2,600	19,110.00	0.03
389	601799	星宇股份	200	18,124.00	0.03
390	603605	珀莱雅	300	17,976.00	0.03
391	600153	建发股份	2,100	16,653.00	0.03
392	688297	中无人机	400	16,620.00	0.03
393	603077	和邦生物	6,800	15,776.00	0.03
394	688538	和辉光电	6,000	15,600.00	0.02
395	600901	江苏金租	2,700	15,525.00	0.02
396	600166	福田汽车	5,300	15,423.00	0.02
397	002939	长城证券	1,800	15,012.00	0.02

398	002007	华兰生物	1,100	13,409.00	0.02
399	688582	芯动联科	200	13,000.00	0.02
400	600578	京能电力	2,000	12,900.00	0.02
401	688568	中科星图	300	12,441.00	0.02
402	688114	华大智造	200	10,216.00	0.02
403	603298	杭叉集团	400	9,544.00	0.02
404	000591	太阳能	2,000	9,200.00	0.01
405	601000	唐山港	1,800	7,470.00	0.01
406	600008	首创环保	1,100	2,992.00	0.00
407	600208	衢州发展	1,000	2,830.00	0.00
408	600170	上海建工	1,100	2,442.00	0.00
409	600483	福能股份	200	2,038.00	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	603928	兴业股份	2,500	37,000.00	0.06
2	300773	拉卡拉	2,400	36,720.00	0.06
3	688378	奥来德	550	34,100.00	0.05
4	301165	锐捷网络	400	32,180.00	0.05
5	002422	科伦药业	800	30,816.00	0.05
6	300932	三友联众	2,900	30,740.00	0.05
7	605123	派克新材	300	29,103.00	0.05
8	688678	福立旺	1,200	29,004.00	0.05
9	300568	星源材质	1,500	28,080.00	0.04
10	002237	恒邦股份	1,900	27,911.00	0.04
11	002979	雷赛智能	500	27,890.00	0.04
12	688620	安凯微	1,721	27,880.20	0.04
13	300006	莱美药业	5,400	27,702.00	0.04
14	688369	致远互联	1,300	27,313.00	0.04
15	002396	星网锐捷	1,420	27,221.40	0.04
16	301210	金杨精密	900	27,000.00	0.04
17	300842	帝科股份	300	26,751.00	0.04
18	300007	汉威科技	700	26,740.00	0.04
19	688556	高测股份	2,000	26,560.00	0.04
20	688683	莱尔科技	700	26,544.00	0.04
21	300617	安靠智电	500	26,495.00	0.04
22	688388	嘉元科技	600	26,400.00	0.04
23	688513	苑东生物	600	26,376.00	0.04
24	688595	芯海科技	600	26,316.00	0.04
25	002922	伊戈尔	800	26,240.00	0.04

26	000100	TCL 科技	4,500	26,190.00	0.04
27	603901	永创智能	2,400	26,088.00	0.04
28	002768	国恩股份	500	26,030.00	0.04
29	603992	松霖科技	800	25,920.00	0.04
30	000026	飞亚达	1,200	25,848.00	0.04
31	300772	运达股份	2,100	25,830.00	0.04
32	603638	艾迪精密	1,100	25,795.00	0.04
33	603333	福华尚纬	3,200	25,792.00	0.04
34	688176	亚虹医药	2,600	25,792.00	0.04
35	002843	泰嘉股份	1,200	25,764.00	0.04
36	688299	长阳科技	1,540	25,733.40	0.04
37	688226	威腾电气	600	25,698.00	0.04
38	300602	飞荣达	500	25,600.00	0.04
39	301510	固高科技	800	25,544.00	0.04
40	603969	银龙股份	3,500	25,445.00	0.04
41	688609	九联科技	2,311	25,444.11	0.04
42	603118	共进股份	2,100	25,431.00	0.04
43	300404	博济医药	2,900	25,404.00	0.04
44	300867	圣元环保	1,400	25,368.00	0.04
45	688269	凯立新材	800	25,368.00	0.04
46	300493	润欣科技	1,700	25,347.00	0.04
47	300016	北陆药业	3,300	25,311.00	0.04
48	000045	深纺织 A	2,400	25,296.00	0.04
49	300457	赢合科技	1,200	25,296.00	0.04
50	603139	康惠股份	600	25,266.00	0.04
51	688030	山石网科	1,600	25,264.00	0.04
52	300955	嘉亨家化	700	25,263.00	0.04
53	300951	博硕科技	500	25,250.00	0.04
54	688327	云从科技	2,023	25,206.58	0.04
55	603819	神力股份	2,200	25,190.00	0.04
56	002643	万润股份	1,200	25,140.00	0.04
57	300552	万集科技	1,100	25,135.00	0.04
58	002706	良信股份	2,300	25,093.00	0.04
59	002283	天润工业	2,600	25,090.00	0.04
60	001308	康冠科技	1,200	25,032.00	0.04
61	300862	蓝盾光电	1,200	25,008.00	0.04
62	300445	康斯特	1,200	24,984.00	0.04
63	301368	丰立智能	600	24,978.00	0.04
64	601677	明泰铝业	1,500	24,900.00	0.04
65	301487	盟固利	1,300	24,895.00	0.04
66	605287	德才股份	600	24,894.00	0.04
67	003038	鑫铂股份	2,200	24,882.00	0.04
68	300789	唐源电气	1,400	24,878.00	0.04

69	002296	辉煌科技	2,800	24,864.00	0.04
70	300438	鹏辉能源	300	24,855.00	0.04
71	688225	亚信安全	2,000	24,840.00	0.04
72	688557	兰剑智能	800	24,824.00	0.04
73	600973	宝胜股份	3,500	24,815.00	0.04
74	603933	睿能科技	1,100	24,805.00	0.04
75	002449	国星光电	3,200	24,800.00	0.04
76	300884	狄耐克	2,500	24,800.00	0.04
77	300166	东方国信	1,400	24,794.00	0.04
78	300823	建科智能	1,700	24,786.00	0.04
79	002832	比音勒芬	1,200	24,768.00	0.04
80	603707	健友股份	3,500	24,745.00	0.04
81	001314	亿道信息	400	24,720.00	0.04
82	600513	联环药业	1,700	24,718.00	0.04
83	600433	冠豪高新	7,700	24,717.00	0.04
84	002810	山东赫达	1,000	24,700.00	0.04
85	603381	永臻股份	1,600	24,656.00	0.04
86	603683	晶华新材	800	24,656.00	0.04
87	603273	天元智能	1,900	24,605.00	0.04
88	002923	润都股份	2,600	24,596.00	0.04
89	300569	天能重工	5,100	24,582.00	0.04
90	301179	泽宇智能	1,200	24,552.00	0.04
91	001266	宏英智能	500	24,550.00	0.04
92	002635	安洁科技	1,200	24,540.00	0.04
93	000338	潍柴动力	900	24,525.00	0.04
94	600081	东风科技	2,700	24,516.00	0.04
95	001283	豪鹏科技	500	24,510.00	0.04
96	603276	恒兴新材	1,600	24,496.00	0.04
97	002599	盛通股份	4,800	24,480.00	0.04
98	300206	理邦仪器	2,000	24,460.00	0.04
99	002531	天顺风能	2,900	24,447.00	0.04
100	300450	先导智能	600	24,432.00	0.04
101	601168	西部矿业	900	24,426.00	0.04
102	300590	移为通信	1,700	24,395.00	0.04
103	300025	华星创业	5,800	24,360.00	0.04
104	000807	云铝股份	1,100	24,354.00	0.04
105	002045	国光电器	3,100	24,335.00	0.04
106	300933	中辰股份	4,000	24,320.00	0.04
107	600963	岳阳林纸	8,000	24,320.00	0.04
108	603630	拉芳家化	1,900	24,282.00	0.04
109	300365	恒华科技	5,300	24,274.00	0.04
110	002988	豪美新材	1,100	24,266.00	0.04
111	300738	奥飞数据	1,200	24,264.00	0.04

112	002541	鸿路钢构	1,400	24,248.00	0.04
113	002034	旺能环境	1,600	24,240.00	0.04
114	002952	亚世光电	1,100	24,233.00	0.04
115	600419	天润乳业	3,200	24,224.00	0.04
116	603719	良品铺子	2,800	24,220.00	0.04
117	301246	宏源药业	900	24,210.00	0.04
118	688156	路德科技	800	24,200.00	0.04
119	600425	青松建化	7,400	24,198.00	0.04
120	300504	天邑股份	1,500	24,195.00	0.04
121	600662	外服控股	6,000	24,180.00	0.04
122	300286	安科瑞	1,000	24,150.00	0.04
123	002324	普利特	2,000	24,140.00	0.04
124	301048	金鹰重工	2,800	24,108.00	0.04
125	301193	家联科技	1,300	24,102.00	0.04
126	600333	长春燃气	4,800	24,096.00	0.04
127	601279	英利汽车	7,900	24,095.00	0.04
128	000790	华神科技	6,900	24,081.00	0.04
129	300232	洲明科技	4,200	24,066.00	0.04
130	600746	江苏索普	4,600	24,058.00	0.04
131	601918	新集能源	2,800	24,052.00	0.04
132	002660	茂硕电源	3,700	24,050.00	0.04
133	002439	启明星辰	1,900	24,035.00	0.04
134	300613	富瀚微	300	24,024.00	0.04
135	300034	钢研高纳	1,400	23,996.00	0.04
136	301378	通达海	1,000	23,980.00	0.04
137	002646	天佑德酒	3,800	23,978.00	0.04
138	300047	天源迪科	2,700	23,976.00	0.04
139	300732	设研院	4,300	23,951.00	0.04
140	002877	智能自控	3,400	23,936.00	0.04
141	300466	赛摩智能	3,400	23,936.00	0.04
142	002562	兄弟科技	5,500	23,925.00	0.04
143	600308	华泰股份	8,000	23,920.00	0.04
144	002408	齐翔腾达	5,100	23,919.00	0.04
145	601968	宝钢包装	6,100	23,912.00	0.04
146	300633	开立医疗	1,300	23,907.00	0.04
147	688468	科美诊断	4,200	23,898.00	0.04
148	300447	全信股份	1,600	23,888.00	0.04
149	300512	中亚股份	3,500	23,870.00	0.04
150	002090	金智科技	2,700	23,868.00	0.04
151	300797	钢研纳克	1,800	23,868.00	0.04
152	002391	长青股份	4,900	23,863.00	0.04
153	000565	渝三峡 A	4,200	23,856.00	0.04
154	600716	凤凰股份	7,100	23,856.00	0.04

155	001366	播恩集团	2,200	23,848.00	0.04
156	300490	华自科技	1,800	23,814.00	0.04
157	603183	建研院	6,700	23,785.00	0.04
158	600805	悦达投资	5,900	23,777.00	0.04
159	688528	秦川物联	2,600	23,764.00	0.04
160	002204	大连重工	4,500	23,760.00	0.04
161	002302	西部建设	5,500	23,760.00	0.04
162	300407	凯发电气	2,200	23,760.00	0.04
163	300682	朗新科技	2,400	23,760.00	0.04
164	600262	北方股份	1,200	23,748.00	0.04
165	002863	今飞凯达	5,600	23,744.00	0.04
166	688128	中国电研	1,000	23,740.00	0.04
167	600528	中铁工业	3,600	23,724.00	0.04
168	000990	诚志股份	2,900	23,722.00	0.04
169	000822	山东海化	5,900	23,718.00	0.04
170	300691	联合光电	1,500	23,715.00	0.04
171	000544	中原环保	3,400	23,698.00	0.04
172	601061	中信金属	2,200	23,694.00	0.04
173	002010	传化智联	5,300	23,691.00	0.04
174	001212	中旗新材	500	23,690.00	0.04
175	002544	普天科技	1,300	23,686.00	0.04
176	300887	谱尼测试	3,400	23,664.00	0.04
177	688285	高铁电气	3,300	23,661.00	0.04
178	002331	皖通科技	3,200	23,648.00	0.04
179	300511	雪榕生物	4,700	23,641.00	0.04
180	002578	闽发铝业	7,500	23,625.00	0.04
181	300793	佳禾智能	2,100	23,625.00	0.04
182	300575	中旗股份	4,800	23,616.00	0.04
183	300424	航新科技	1,500	23,610.00	0.04
184	002532	天山铝业	2,200	23,606.00	0.04
185	000877	天山股份	6,500	23,595.00	0.04
186	600501	航天晨光	1,500	23,595.00	0.04
187	002702	海欣食品	5,300	23,585.00	0.04
188	600320	振华重工	5,700	23,541.00	0.04
189	000553	安道麦 A	4,400	23,540.00	0.04
190	603817	海峡环保	4,600	23,506.00	0.04
191	605196	华通线缆	900	23,490.00	0.04
192	002757	南兴股份	1,300	23,465.00	0.04
193	301500	飞南资源	900	23,445.00	0.04
194	002998	优彩资源	3,600	23,436.00	0.04
195	600966	博汇纸业	4,900	23,422.00	0.04
196	002795	永和智控	3,500	23,415.00	0.04
197	301062	上海艾录	4,100	23,411.00	0.04

198	603876	鼎胜新材	900	23,409.00	0.04
199	603132	金徽股份	1,500	23,370.00	0.04
200	601728	中国电信	4,500	23,355.00	0.04
201	000852	石化机械	4,700	23,312.00	0.04
202	002054	德美化工	3,500	23,275.00	0.04
203	002591	恒大高新	3,800	23,256.00	0.04
204	600590	泰豪科技	2,300	23,230.00	0.04
205	300890	翔丰华	700	23,219.00	0.04
206	002752	昇兴股份	4,200	23,184.00	0.04
207	000090	天健集团	7,700	23,177.00	0.04
208	300422	博世科	5,500	23,155.00	0.04
209	002135	东南网架	3,400	23,086.00	0.04
210	603507	振江股份	700	23,023.00	0.04
211	001360	南矿集团	1,300	22,997.00	0.04
212	605189	富春染织	1,900	22,895.00	0.04
213	301096	百诚医药	400	22,876.00	0.04
214	300560	中富通	1,200	22,860.00	0.04
215	300031	宝通科技	800	22,856.00	0.04
216	000949	新乡化纤	3,600	22,824.00	0.04
217	002947	恒铭达	300	22,815.00	0.04
218	002545	东方铁塔	1,400	22,708.00	0.04
219	688090	瑞松科技	211	22,460.95	0.04
220	301568	思泰克	200	22,320.00	0.04
221	001218	丽臣实业	1,000	22,060.00	0.04
222	301265	华新科技	800	22,040.00	0.04
223	300619	金银河	700	21,777.00	0.03
224	603228	景旺电子	300	21,723.00	0.03
225	002838	道恩股份	700	21,434.00	0.03
226	605300	佳禾食品	2,100	20,475.00	0.03
227	301042	安联锐视	300	20,010.00	0.03
228	000935	四川双马	200	5,218.00	0.01
229	600918	中泰证券	700	3,724.00	0.01
230	601211	国泰海通	200	3,640.00	0.01
231	601995	中金公司	100	3,615.00	0.01
232	601628	中国人寿	100	3,535.00	0.01
233	601066	中信建投	100	2,907.00	0.00
234	600030	中信证券	100	2,873.00	0.00
235	001236	弘业期货	400	2,780.00	0.00
236	000166	申万宏源	600	2,640.00	0.00
237	000776	广发证券	100	2,340.00	0.00
238	600155	华创云信	400	2,208.00	0.00
239	600999	招商证券	100	2,110.00	0.00
240	002961	瑞达期货	100	1,958.00	0.00

241	600643	爱建集团	500	1,855.00	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	601168	西部矿业	1,391,430.00	1.97
2	688777	中控技术	1,364,257.61	1.93
3	300604	长川科技	1,331,032.00	1.88
4	600988	赤峰黄金	1,252,338.00	1.77
5	600497	驰宏锌锗	1,111,624.00	1.57
6	300373	扬杰科技	1,091,300.00	1.54
7	002008	大族激光	1,061,994.00	1.50
8	300115	长盈精密	1,055,243.00	1.49
9	002271	东方雨虹	1,015,629.00	1.44
10	600487	亨通光电	1,014,018.00	1.44
11	002409	雅克科技	1,011,194.00	1.43
12	603920	世运电路	996,784.00	1.41
13	600392	盛和资源	995,020.00	1.41
14	000783	长江证券	953,405.00	1.35
15	300058	蓝色光标	950,796.00	1.35
16	300474	景嘉微	939,004.00	1.33
17	600316	洪都航空	925,295.00	1.31
18	002851	麦格米特	918,959.00	1.30
19	300339	润和软件	918,033.00	1.30
20	000021	深科技	910,103.00	1.29

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	600487	亨通光电	2,012,775.00	2.85
2	601168	西部矿业	1,625,054.00	2.30
3	300285	国瓷材料	1,408,245.00	1.99
4	300373	扬杰科技	1,373,239.00	1.94
5	600497	驰宏锌锗	1,349,625.00	1.91
6	601231	环旭电子	1,211,113.00	1.71
7	002414	高德红外	1,176,033.00	1.66
8	002138	顺络电子	1,163,821.00	1.65
9	688777	中控技术	1,163,753.62	1.65

10	002558	巨人网络	1,149,398.00	1.63
11	300604	长川科技	1,144,460.00	1.62
12	300115	长盈精密	1,123,982.00	1.59
13	300450	先导智能	1,100,571.00	1.56
14	600879	航天电子	1,091,744.00	1.55
15	603228	景旺电子	1,052,440.00	1.49
16	002851	麦格米特	1,032,654.00	1.46
17	002532	天山铝业	1,029,312.00	1.46
18	600988	赤峰黄金	1,019,021.00	1.44
19	603920	世运电路	1,006,652.00	1.42
20	002436	兴森科技	1,004,841.00	1.42

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	323,508,083.28
卖出股票收入（成交）总额	342,461,281.21

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：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

注：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

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	463,358.53
2	应收清算款	724,705.82
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	51,729.17
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,239,793.52

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	1,030	19,640.18	—	—	20,229,390.15	100%
兴银中证 500 指数增强 C	6,581	3,844.71	2,251,440.92	8.90%	23,050,604.22	91.10%
合计	7,611	5,982.32	2,251,440.92	4.94%	43,279,994.37	95.06%

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	—	—
	兴银中证 500 指数增强 C	21,723.87	0.09%
	合计	21,723.87	0.05%

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	24,413,932.92	34,356,724.75
本报告期基金总申购份额	10,486,787.74	11,400,672.39
减：本报告期基金总赎回份额	14,671,330.51	20,455,352.00
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	20,229,390.15	25,302,045.14

§ 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) 2026 年 5 月 15 日，张庄波担任基金管理人督察长，吴真子不再担任基金管理人督察长。

(2) 报告期内，基金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、公募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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：报告期内，本基金托管人在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：报告期内，本基金托管人相关从业人员在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	
招商证券	2	338,611,351.97	50.84%	66,335.08	49.60%	—
民生证券	2	327,358,012.52	49.16%	67,395.46	50.40%	—
东方财富证券	2	—	—	—	—	—
华福证券	2	—	—	—	—	—
广发证券	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 基金租用或者通过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
招商证券	1,101,225.94	100.00%	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
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	兴银中证 500 指数增强型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	证监会规定报刊和网站	2026-01-22
2	兴银中证 500 指数增强型证券投资基金 2025 年年度报告	证监会规定报刊和网站	2026-03-31
3	兴银中证 500 指数增强型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	证监会规定报刊和网站	2026-04-22
4	兴银基金管理有限责任公司关于督察长变更的公告	证监会规定报刊和网站	2026-05-16

§ 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
二〇二六年八月三十一日