

兴全可转债混合型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：兴证全球基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 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。

基金托管人中国工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 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	12
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	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
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	46
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	47

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	47
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	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	47
§ 8 基金份额持有人信息.....	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 盈利投资者数量占比	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	50
§ 9 开放式基金份额变动.....	50
§ 10 重大事件揭示.....	50
10.1 基金份额持有人大会决议	50
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	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	51
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	51
10.8 其他重大事件	52
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	53
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	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	53
§ 12 备查文件目录.....	53
12.1 备查文件目录	53
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴全可转债混合型证券投资基金
基金简称	兴全可转债混合
基金主代码	340001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004 年 5 月 11 日
基金管理人	兴证全球基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,275,919,980.90 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在锁定投资组合下方风险的基础上，以有限的期权成本获取基金资产的长期稳定增值。
投资策略	基金的资产配置采用自上而下的程序，个券和个股选择采用自下而上的程序，并严格控制投资风险。在个券选择层面，积极参与发行条款优惠、期权价值较高、公司基本面优良的可转债的一级市场申购；选择对应的发债公司具有良好发展潜力或基础股票有着较高上涨预期的可转债进行投资，以有效规避市场风险，并充分分享股市上涨的收益；运用“兴全可转债评价体系”，选择定价失衡的个券进行投资，实现低风险的套利。在个股选择层面，以“相对投资价值”判断为核心，选择所处行业发展前景良好、价值被相对低估的股票进行投资。（详见本基金基金合同及招募说明书）
业绩比较基准	80%×中证可转换债券指数+15%×沪深 300 指数+5%×同业存款利率
风险收益特征	本基金的风险水平处于市场低端，收益水平处于市场中高端。

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		兴证全球基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨卫东	郭明
	联系电话	021-20398888	010-66105799
	电子邮箱	yangwd@xqfunds.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006780099, 021-38824536	95588
传真		021-20398988	010-66105798
注册地址		上海市黄浦区金陵东路 368 号	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市浦东新区芳甸路 1155 号 嘉里城办公楼 28-29 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		201204	100140

法定代表人	庄园芳	廖林
-------	-----	----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.xqfunds.com
基金中期报告置备地点	基金管理人、基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	兴证全球基金管理有限公司	上海市浦东新区锦康路 308 号陆家嘴世纪金融广场 6 号楼 13 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 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	273,281,492.19
本期利润	160,788,092.18
加权平均基金份额本期利润	0.0737
本期加权平均净值利润率	6.06%
本期基金份额净值增长率	6.35%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	111,092,139.74
期末可供分配基金份额利润	0.0488
期末基金资产净值	2,564,027,742.47
期末基金份额净值	1.1266
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	1,222.35%

注：1、上述财务指标采用的计算公式，详见中国证券监督管理委员会发布的《证券投资基金信息披露编报规则第 1 号<主要财务指标的计算及披露>》、《证券投资基金会计核算业务指引》等相关法规。

2、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。

3、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（例如：申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），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

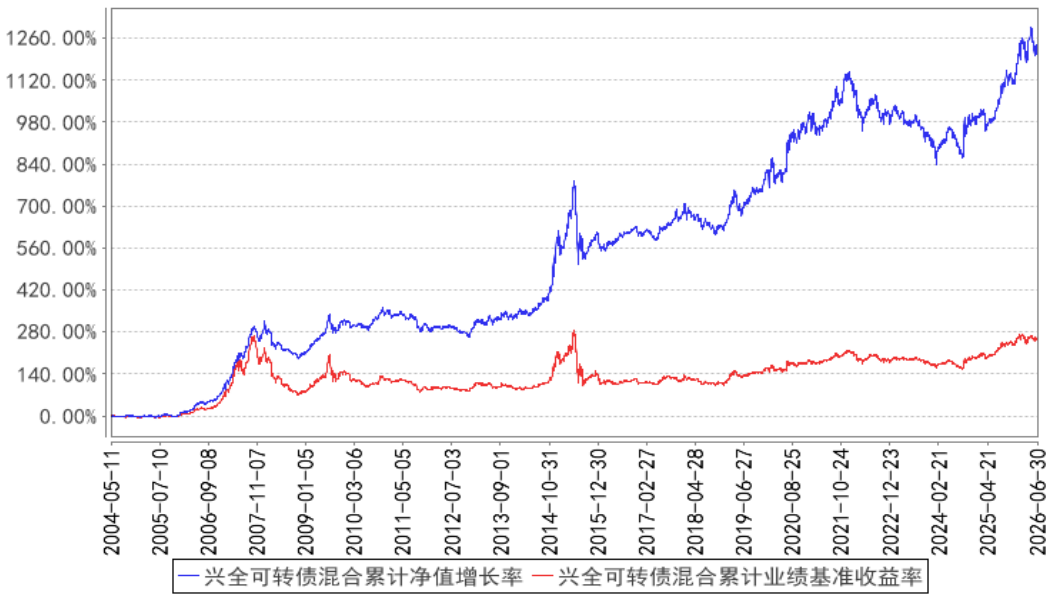
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3.13%	0.80%	4.75%	0.83%	-1.62%	-0.03%
过去六个月	6.35%	0.88%	3.22%	0.89%	3.13%	-0.01%
过去一年	19.17%	0.74%	14.93%	0.76%	4.24%	-0.02%
过去三年	22.57%	0.68%	24.18%	0.66%	-1.61%	0.02%
过去五年	21.27%	0.66%	24.53%	0.63%	-3.26%	0.03%
过去七年	64.85%	0.69%	52.43%	0.64%	12.42%	0.05%
过去十年	90.03%	0.65%	72.55%	0.64%	17.48%	0.01%
自基金合同生效起至今	1,222.35%	0.78%	258.18%	1.01%	964.17%	-0.23%

注：本基金业绩比较基准为 80%×中证可转换债券指数+15%×沪深 300 指数+5%×同业存款利率，是根据基金合同中投资策略及资产配置比例等相关规定构建，能够较好地反映本基金的风险收益特征。本基金每个交易日对业绩比较基准依据合同约定的权重比例进行再平衡处理，并用每日连乘方式计算得到指数基准的时间序列。

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

兴全可转债混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、净值表现所取数据截至到 2026 年 06 月 30 日。
2、按照《兴全可转债混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金建仓期为 2004 年 05 月

11 日起共计六个月。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

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

兴证全球基金管理有限公司（成立时名为“兴业基金管理有限公司”，以下简称“公司”）经证监基字[2003]100 号文批准于 2003 年 9 月 30 日成立。2008 年 1 月，中国证监会批复（证监许可[2008]6 号），同意全球人寿保险国际公司（AEGON International B.V）受让公司股权并成为公司股东。2008 年 4 月 9 日，公司完成股权转让、变更注册资本等相关手续后，公司注册资本由 9800 万元变更为人民币 1.2 亿元，其中兴业证券股份有限公司的出资占注册资本的 51%，全球人寿保险国际公司的出资占注册资本的 49%。2008 年 7 月，经中国证监会批准（证监许可[2008]888 号），公司于 2008 年 8 月 25 日完成变更公司名称、注册资本等相关手续后，公司名称变更为“兴证全球基金管理有限公司”，注册资本增加为 1.5 亿元人民币，其中两股东出资比例不变。2016 年 12 月 28 日，因公司发展需要，公司名称变更为“兴全基金管理有限公司”。2020 年 3 月 18 日，公司名称变更为“兴证全球基金管理有限公司”。

截至 2026 年 6 月 30 日，公司旗下已管理兴全可转债混合型证券投资基金等共 89 只基金，包括股票型、混合型、债券型、货币型、指数型、FOF 等类型。

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		
虞淼	兴全可转债混合型证券投资基金基金经理、兴全兴益债券型证券投资基金基金经理、兴全有机增长	2019 年 1 月 16 日	-	16 年	硕士，历任兴业证券股份有限公司研究员，兴证全球基金管理有限公司研究员、专户投资经理、兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、兴全汇享一年持有期混合型证券投资基金基金经理。

	灵活配置 混合型证 券投资基 金基金经 理				
--	-----------------------------------	--	--	--	--

注：1、职务指截止报告期末的职务（报告期末仍在任的）或离任前的职务（报告期内离任的）。
2、任职日期指基金合同生效之日（基金成立时即担任基金经理）或公司作出聘任决定之日（基金成立后担任基金经理）；离任日期指公司作出解聘决定之日。
3、证券从业的涵义遵从行业的相关规定，包括资管相关行业从业经历。

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：本报告期末，本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划的投资经理的情况。

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循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全可转债混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，确保各投资组合之间得到公平对待，保护投资者的合法权益。公司风险管理部对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异进行统计，从不同的角度分析差异的来源、考察是否存在不公平的因素。

本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的公平交易制度，未发现违反公平交易原则的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，不存在本投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况，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

上半年经济呈现明显的分化格局。外需及出口相对较强而内需偏弱，生产韧性足而地产对内需仍有拖累。制造业 PMI 从 3 月份开始回升荣枯线以上，连续四个月处于扩张区间。上半年房地

产销售和投资额两位数下滑，社零总额增长 1.3%，明显低于 GDP 增速，内需相关的行业仍面临一定的压力。海外地缘事件的爆发，导致原油价格快速上涨，阶段性推升各经济体的通胀，同时欧美经济分化加剧，美国增长韧性延续、欧元区增速在二季度持续走弱。

上半年国内权益市场结构分化显著，沪深 300 指数上涨 7.5%，创业板指上涨 35.6%，而上证 50 指数则小幅下跌。与 AI 投资相关的通信、电子行业上半年表现较好，板块指数涨幅超过 70%，而消费类行业如商贸零售、农林牧渔、食品饮料行业则跌幅较大。一季度能源相关的行业表现相对较好，随着海外 ai 模型在编程等领域的快速增长，ai 相关的行业成为了二季度的主线，景气度也扩散到建材、化工新材料等相关行业，而市场则呈现出极致的分化，科技以外的多数行业持续下跌。上半年货币政策维持了宽松的基调，银行间利率利率小幅下行，10 年期国债收益率下行 12 个基点至 1.75%。

中证转债指数上半年上涨，转债市场整体冲高回落，高价和科技类转债在上半年表现突出。个券分化明显，部分有信用担忧的个券在上半年表现不佳。由于部分权重券的退出，以及债市走强，可转债估值整体维持在相对高位。

本基金在 2026 年上半年维持了相对较高的权益仓位，随着部分转债的退出，可转债仓位有所降低。回顾上半年的操作，科技行业的配置比例偏低，导致组合的收益率不突出，部分平衡型中低价转债的阶段调整，也对组合的收益有一定拖累。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，兴全可转债混合的基金份额净值为 1.1266 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.35%，同期业绩比较基准收益率为 3.22%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

能源价格在地缘事件的扰动下大幅波动，海外通胀短期有所回升，阶段性制约了美国货币政策宽松的节奏。国内经济仍处于结构分化的磨底阶段，部分行业仍然受到房地产市场的拖累，财政政策的力度和节奏，将影响内需复苏的进程。在“反内卷”政策和能源金属价格上涨的背景下，PPI 已经快速回升至正值区间，GDP 平减指数也在二季度转正，部分相关行业的盈利得到一定程度的修复。一些行业竞争格局的改善，以及出海提升市场份额的机会，是企业长期盈利改善的重要驱动因素。创新药及相关领域的进展，也体现出医药行业头部公司的全球竞争力。从产业发展的角度来看，AI 创新仍在持续并且在一些领域已经落地见效，一些硬件企业业绩增长强劲，AI 相关的行业仍然是重要的投资线索。

从长期的角度看，在目前低利率的环境下，权益资产仍然具有较为明显的配置价值。在较为极致的结构分化行情下，权益市场的波动率也有所放大，部分热点领域的个股出现估值偏高的现

象，对结构性机会的把握和结构性风险的识别，将更为重要。

可转债资产分化显著，部分科技和中小盘个股活跃，整体估值仍处于中性偏高的位置，部分个券的定价反映了对权益市场较为乐观的预期，未来获取高收益可能仍将面临较大的挑战。

本基金将秉承“严控下行风险”的理念，灵活配置资产，挑选价值类型的个券，尽量追求“相对安全的收益”。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：1、估值委员会制定旗下基金的估值政策和流程，选取适当的估值方法、定期对估值政策和程序进行评价。采用的基金估值方法、政策和程序应经估值委员会审议，并报管理层批准后方可实施。2、估值方法确立后，由 IT 人员或 IT 人员协助估值系统开发商及时对系统中的参数或模型作相应的调整或对系统进行升级，以适应新的估值方法的需要。3、基金会计具体负责执行估值委员会确定的估值策略，并通过与托管行核对等方法确保估值准确无误；4、投资人员（包括基金经理）积极关注市场环境变化及证券发行机构有关影响证券价格的重大事件等可能对给估值造成影响的因素，并就可能带来的影响提出建议和意见；5、合规管理人员参与估值方案的制定，确保估值方案符合相关法律法规及基金合同的约定；负责基金估值业务的定期和临时信息披露。6、审计部对估值流程、估值结果等进行检查，确保估值委员会决议的有效执行。

上述参与估值流程人员均具备估值业务所需的专业胜任能力。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《兴全可转债混合型证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，本报告期内，本基金实施利润分配 1 次，共分配利润 311,398,809.47 元，符合本基金基金合同的相关规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未发生需披露的基金份额持有人数不满两百人或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，不存在任何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——兴证全球基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对兴证全球基金管理有限公司编制和披露的本基金 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核查，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：兴全可转债混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	331,171,915.12	305,157,461.45
结算备付金		2,558,419.83	1,404,455.39
存出保证金		419,088.30	256,480.43
交易性金融资产	6.4.7.2	2,227,019,881.77	2,246,138,043.22
其中：股票投资		650,165,245.49	737,588,027.93
基金投资		-	-
债券投资		1,576,854,636.28	1,508,550,015.29
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	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-

其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		12,827,939.96	12,490,266.24
应收股利		-	-
应收申购款		1,715,066.20	439,193.10
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		2,575,712,311.18	2,565,885,899.83
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 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		1,242,861.85	2,836,852.54
应付赎回款		6,723,960.94	4,066,206.15
应付管理人报酬		2,548,407.81	2,586,939.62
应付托管费		424,734.63	431,156.58
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		25,993.42	25,587.65
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	718,610.06	597,754.68
负债合计		11,684,568.71	10,544,497.22
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	2,275,919,980.90	2,137,416,215.16
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	288,107,761.57	417,925,187.45
净资产合计		2,564,027,742.47	2,555,341,402.61
负债和净资产总计		2,575,712,311.18	2,565,885,899.83

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.1266 元，基金份额总额 2,275,919,980.90 份。

6.2 利润表

会计主体：兴全可转债混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		179,329,603.29	61,860,931.94

1. 利息收入		613,015.47	795,339.88
其中：存款利息收入	6.4.7.13	601,803.90	759,723.47
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		11,211.57	35,616.41
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		291,057,642.31	34,068,109.23
其中：股票投资收益	6.4.7.14	182,252,483.23	-13,177,671.53
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	103,965,024.96	40,799,967.93
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收	6.4.7.17	-	-
益			
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	4,840,134.12	6,445,812.83
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-112,493,400.01	26,848,595.70
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	152,345.52	148,887.13
减：二、营业总支出		18,541,511.11	18,523,528.72
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	15,785,605.16	15,761,839.99
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,630,934.16	2,626,973.32
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		18,481.41	19,360.85
8. 其他费用	6.4.7.23	106,490.38	115,354.56

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		160,788,092.18	43,337,403.22
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		160,788,092.18	43,337,403.22
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		160,788,092.18	43,337,403.22

6.3 净资产变动表

会计主体：兴全可转债混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,137,416,215.16	-	417,925,187.45	2,555,341,402.61
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,137,416,215.16	-	417,925,187.45	2,555,341,402.61
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	138,503,765.74	-	-129,817,425.88	8,686,339.86
（一）、综合收益总额	-	-	160,788,092.18	160,788,092.18
（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）	138,503,765.74	-	20,793,291.41	159,297,057.15
其中：1. 基金申购款	433,690,162.52	-	85,195,457.69	518,885,620.21
2. 基金赎回款	-295,186,396.78	-	-64,402,166.28	-359,588,563.06
（三）、本期向基	-	-	-	-311,398,809.47

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）			311,398,809.47	
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	2,275,919,980.90	-	288,107,761.57	2,564,027,742.47
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,573,662,641.78	-	189,263,388.12	2,762,926,029.90
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,573,662,641.78	-	189,263,388.12	2,762,926,029.90
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	- 146,808,801.26	-	-27,007,290.74	-173,816,092.00
（一）、综合收益总额	-	-	43,337,403.22	43,337,403.22
（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）	- 146,808,801.26	-	-11,535,747.75	-158,344,549.01
其中：1. 基金申购款	129,222,577.85	-	7,932,709.16	137,155,287.01
2. 基金赎回款	- 276,031,379.11	-	-19,468,456.91	-295,499,836.02
（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	-	-	-58,808,946.21	-58,808,946.21

产减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	2,426,853,840.52	-	162,256,097.38	2,589,109,937.90

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：

庄园芳
基金管理人负责人

詹鸿飞

主管会计工作负责人

詹鸿飞

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

兴全可转债混合型证券投资基金(原名兴业可转债混合型证券投资基金)(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2004]27号《关于同意兴业可转债混合型证券投资基金设立的批复》的核准,由兴证全球基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法规和《兴业可转债混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)向社会公开募集,基金合同于2004年5月11日正式生效,首次设立募集规模为3,282,404,810.93份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为兴证全球基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。本基金于2011年1月1日起更名为兴全可转债混合型证券投资基金。

本基金投资范围是具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市的可转换公司债券、股票、存托凭证、国债,以及法律法规允许基金投资的其他金融工具。资产配置比例为:可转债30%-95%(其中可转债在除国债之外已投资资产中比例不低于50%),股票不高于30%,现金和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、应收申购款等。如果法律法规对该比例要求有变更的,以变更后的比例为准,本基金的投资范围会做相应调整。

本基金的业绩比较基准为:80%×中证可转换债券指数+15%×沪深300指数+5%×同业存款利率。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 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

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日上海证券交易所发布的《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所发布的《关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2021]33 号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2024]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[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》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令 第 826 号《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》、财税[2026]12 号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)2027 年 12 月 31 日前，公开募集证券投资基金管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，可以选择适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对公募证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入以及金融同业往来利息收入免征增值税。

(2)对证券投资基金取得的自 2025 年 8 月 8 日之后(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；取得的在 2025 年 8 月 8 日之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 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。

(3)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。

(4)对证券投资基金取得的股票股息红利所得，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。其中，对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股，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。

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	331,171,915.12
等于：本金	331,140,951.35
加：应计利息	30,963.77
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	331,171,915.12

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		566,685,178.40	-	650,165,245.49	83,480,067.09
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,450,570,333.82	7,358,293.25	1,444,524,965.05	- 13,403,662.02
	银行间市场	131,406,600.00	1,198,671.23	132,329,671.23	-275,600.00
	合计	1,581,976,933.82	8,556,964.48	1,576,854,636.28	- 13,679,262.02
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,148,662,112.22	8,556,964.48	2,227,019,881.77	69,800,805.07

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

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末无期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

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：本基金本报告期末无买入返售金融资产。

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通过买断式逆回购交易取得债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内未发生债权投资减值准备。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内未发生其他债权投资减值准备。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末无其他权益工具。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末无其他权益工具。

6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	11,853.40
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	610,976.21

其中：交易所市场	610,976.21
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	95,780.45
合计	718,610.06

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,137,416,215.16	2,137,416,215.16
本期申购	433,690,162.52	433,690,162.52
本期赎回（以“-”号填列）	-295,186,396.78	-295,186,396.78
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,275,919,980.90	2,275,919,980.90

注：申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	148,028,035.66	269,897,151.79	417,925,187.45
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	148,028,035.66	269,897,151.79	417,925,187.45
本期利润	273,281,492.19	-112,493,400.01	160,788,092.18
本期基金份额交易产生的变动数	1,181,421.36	19,611,870.05	20,793,291.41
其中：基金申购款	28,918,789.58	56,276,668.11	85,195,457.69
基金赎回款	-27,737,368.22	-36,664,798.06	-64,402,166.28
本期已分配利润	-311,398,809.47	-	-311,398,809.47
本期末	111,092,139.74	177,015,621.83	288,107,761.57

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	595,515.44
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	5,322.69
其他	965.77
合计	601,803.90

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	182,252,483.23
股票投资收益——赎回差价收入	—
股票投资收益——申购差价收入	—
股票投资收益——证券出借差价收入	—
合计	182,252,483.23

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,584,987,565.81
减：卖出股票成本总额	1,400,477,266.20
减：交易费用	2,257,816.38
买卖股票差价收入	182,252,483.23

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	10,502,127.68
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	93,462,897.28
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	103,965,024.96

6.4.7.15.2 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1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,355,168,941.02
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,252,628,462.89
减：应计利息总额	8,978,360.55
减：交易费用	99,220.30
买卖债券差价收入	93,462,897.28

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	4,840,134.12
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	4,840,134.12

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-112,493,400.01
股票投资	-9,988,598.76
债券投资	-102,504,801.25
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-112,493,400.01

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	147,908.85
基金转换费收入	4,436.67
合计	152,345.52

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	1,109.93
账户维护费用	18,000.00
其他	600.00
合计	106,490.38

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要在财务报表附注中说明的重大或有事项。

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

本报告期内与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
兴证全球基金管理有限公司（“兴证全球基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
兴业证券股份有限公司（“兴业证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
-------	---------------------------------------	--

	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
兴业证券	2,016,648,929.08	70.21	1,214,033,168.31	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
兴业证券	1,753,375,332.23	70.25	959,864,849.24	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)
兴业证券	300,000,000.00	100.00	300,000,000.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
兴业证券	899,229.47	70.21	326,546.30	53.45
关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			

	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 （%）
兴业证券	541,345.70	100.00	194,228.86	100.00

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用兴业证券证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还从兴业证券获得证券研究服务。

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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	15,785,605.16	15,761,839.99
其中：应支付销售机构的客户维 护费	5,151,758.98	5,037,246.72
应支付基金管理人的净管理费	10,633,846.18	10,724,593.27

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。
计算方法如下：每日应支付的基金管理费=前一日基金资产净值×1.20%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,630,934.16	2,626,973.32

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。
计算方法如下：每日应支付的基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 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：本基金本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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：本基金本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

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

注：本基金的基金管理人本报告期内及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

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：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基金。

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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	331,171,915.12	595,515.44	469,385,555.79	755,781.74

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，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均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益 登记 日	除息日		每 10 份基金 份额分 红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配合 计	备 注
		场 内	场 外					
1	2026 年 4 月 21 日	-	2026 年 4 月 21 日	1.4860	86,038,124.08	225,360,685.39	311,398,809.47	-
合计	-	-	-	1.4860	86,038,124.08	225,360,685.39	311,398,809.47	-

6.4.12 期末（2026 年 6 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001220	世盟股份	2026年1月27日	6个月	新股流通受限	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	2026年5月15日	6个月	新股流通受限	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
001248	华润新能源	2026年6月24日	1个月内（含）	新股流通受限	10.11	10.11	25,231	255,085.41	255,085.41	-
001248	华润新能源	2026年6月24日	6个月	新股流通受限	10.11	10.11	58,873	595,206.03	595,206.03	-
001257	盛龙股份	2026年3月24日	6个月	新股流通受限	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312	福恩股份	2026年4月14日	6个月	新股流通受限	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
00136	天	202	6个月	新	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-

5	海 电 子	6 年 5 月 11 日		股 流 通 受 限						
001393	维 通 利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
001399	惠 科 股 份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	-
300750	宁 德 时 代	2026 年 4 月 24 日	6 个月	询 价 转 让 流 通 受 限	410.34	373.17	24,600	10,094,364.00	9,179,982.00	-
301513	尚 水 智 能	2026 年 4 月 10 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春 光 集 团	2026 年 4 月 28 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理 奇 智 能	2026 年 4 月 22 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
30166	大	202	6 个月	新	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-

6	普微	6 年 4 月 8 日		股 流 通 受 限						
30166 9	高特电 子	202 6 年 6 月 2 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
30168 0	固德电 材	202 6 年 2 月 27 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
30168 2	宏明电 子	202 6 年 3 月 18 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	-
30168 3	慧谷新 材	202 6 年 3 月 24 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
30168 7	新广益	202 5 年 12 月 24 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
30169 6	三瑞智 能	202 6 年 3 月 31 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
60111 2	振石股	202 6 年 1 月	6 个月	新 股 流	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-

	份	21 日		通 受 限						
603293	埃泰克	2026年4月9日	6个月	新股流通受限	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603352	至信股份	2026年1月8日	6个月	新股流通受限	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603407	长裕集团	2026年4月29日	6个月	新股流通受限	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德利	2026年5月15日	6个月	新股流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026年3月31日	6个月	新股流通受限	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688635	长进光子	2026年5月20日	6个月	新股流通受限	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688712	北芯生命	2026年1月28日	6个月	新股流通受限	17.52	35.92	234	4,099.68	8,405.28	-

				限						
688781	视涯科技	2026年3月18日	6个月	新股流通受限	22.68	47.61	1,300	29,484.00	61,893.00	-
688785	恒运昌	2026年1月20日	6个月	新股流通受限	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688797	臻宝科技	2026年6月16日	6个月	新股流通受限	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688808	联讯仪器	2026年4月16日	6个月	新股流通受限	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
688811	有研新材	2026年4月1日	6个月	新股流通受限	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813	泰金新能	2026年3月24日	6个月	新股流通受限	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易思维	2026年2月4日	6个月	新股流通受限	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
68881	电	202	6个月	新	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-

8	科 蓝 天	6 年 2 月 3 日		股 流 通 受 限						
68882 0	盛 合 晶 微	202 6 年 4 月 13 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	19.68	141.49	2,391	47,054.88	338,302.59	-

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

注：本基金本报告期末未持有因债券正回购交易而作为抵押的银行间市场债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因债券正回购交易而作为抵押的交易所市场债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有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

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。本基金管理人制定了政策和程序以识别及分析相关风险，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以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、风险管理部和审计部及合规管理部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

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；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：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的信用债。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有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：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	614,623,144.16	642,234,986.64
AAA 以下	804,357,161.30	731,810,012.21
未评级	25,544,659.59	—
合计	1,444,524,965.05	1,374,044,998.85

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有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：本基金于本报告期末及上年度末均未持有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所持金融工具变现的难易程度。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。

本基金所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易。因此，除在附注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。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金为契约型开放式基金，投资者可在合同规定的交易日进行基金申购与赎回业务，本基金管理人针对基金特定的运作方式，建立了相应的流动性风险监控与预警机制。本基金管理人每

日预测基金的流动性需求，通过独立的风险管理部门设置流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，并按照基金类型建立并定期开展专项的流动性压力测试工作，对流动性风险进行预警。本基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款及强制赎回费条款，同时控制每日确认的净赎回申请不超过本基金投资组合 7 个工作日可变现资产的可变现价值，减少赎回业务对本基金的流动性冲击，从而控制流动性风险。此外，本基金通过预留一定的现金头寸，并且可在需要时通过卖出回购金融资产方式借入短期资金，以缓解流动性风险。

本基金所持的证券在证券交易所上市或可于银行间同业市场交易。截止本报告期末，单一投资者持有基金份额比例未超过基金总份额 50%。本报告期末，除完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合以外，本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的 30%，本基金投资未违背法律法规对流通受限资产的相关比例要求。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为货币资金、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 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	331,171,915.12	-	-	-	-	-	331,171,915.12
结算备付金	2,558,419.83	-	-	-	-	-	2,558,419.83
存出保证金	419,088.30	-	-	-	-	-	419,088.30
交易性金融资产	53,145,379.51	-	381,673,669.74	978,826,782.65	163,208,804.38	650,165,245.49	2,227,019,881.77
应收申购款	74,131.58	-	-	-	-	1,640,934.62	1,715,066.20
应收清算款	-	-	-	-	-	12,827,939.96	12,827,939.96
资产总计	387,368,934.73	-	381,673,669.74	978,826,782.65	163,208,804.38	664,634,125.07	2,575,712,317.57

	34		74	65	38	0.07	1.18
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	6,723,960.94	6,723,960.94
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,548,407.81	2,548,407.81
应付托管费	-	-	-	-	-	424,734.63	424,734.63
应付清算款	-	-	-	-	-	1,242,861.85	1,242,861.85
应交税费	-	-	-	-	-	25,993.42	25,993.42
其他负债	-	-	-	-	-	718,610.06	718,610.06
负债总计	-	-	-	-	-	11,684,568.71	11,684,568.71
利率敏感度缺口	387,368,934.34	-	381,673,669.74	978,826,782.65	163,208,804.38	652,949,551.36	2,564,027,742.47
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	305,157,461.45	-	-	-	-	-	305,157,461.45
结算备付金	1,404,455.39	-	-	-	-	-	1,404,455.39
存出保证金	256,480.43	-	-	-	-	-	256,480.43
交易性金融资产	-	134,505,016.44	269,830,005.83	1,063,857,428.86	40,357,564.16	737,588,027.93	2,246,138,043.22
应收申购款	24,879.95	-	-	-	-	414,313.15	439,193.10
应收清算款	-	-	-	-	-	12,490,266.24	12,490,266.24
资产总计	306,843,277.22	134,505,016.44	269,830,005.83	1,063,857,428.86	40,357,564.16	750,492,607.32	2,565,885,899.83
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,066,206.15	4,066,206.15
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,586,939.62	2,586,939.62
应付托管费	-	-	-	-	-	431,156.58	431,156.58
应付清算款	-	-	-	-	-	2,836,852.54	2,836,852.54
应交税费	-	-	-	-	-	25,587.65	25,587.65
其他负债	-	-	-	-	-	597,754.68	597,754.68
负债总计	-	-	-	-	-	10,544,497.22	10,544,497.22
利率敏感度缺口	306,843,277.22	134,505,016.44	269,830,005.83	1,063,857,428.86	40,357,564.16	739,948,110.10	2,555,341,402.61

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他影响债券公允价值的变量保持不变，仅利率发生变动；		
	假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化（即平移收益率曲线）		
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 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 1%	856,961.41	203,565.90
	市场利率上升 1%	-845,905.76	-202,931.88

注：上表反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对净资产产生的影响。

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

本基金承受的其他价格风险，主要是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。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，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其他价格风险，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，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

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 6 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	650,165,245.49	25.36	737,588,027.93	28.86
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	1,576,854,636.28	61.50	1,508,550,015.29	59.04

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	2,227,019,881.77	86.86	2,246,138,043.22	87.90

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假设单个证券的公允价值和市场组合的公允价值依照资本-资产定价模型（CAPM）描述的规律进行变动		
	使用本基金业绩比较基准所对应的市场组合进行分析		
	在业绩基准变化 10%时，对单个证券相应的公允价值变化进行加总得到基金净值的变化		
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 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 10%	238,401,245.24	255,839,792.26
	业绩比较基准下降 10%	-238,401,245.24	-255,839,792.26

注：本基金管理人运用 CAPM 模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对净资产产生的影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	2,056,941,570.24	2,093,030,119.60
第二层次	158,724,622.26	139,750,338.54
第三层次	11,353,689.27	13,357,585.08
合计	2,227,019,881.77	2,246,138,043.22

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(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

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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	650,165,245.49	25.24
	其中：股票	650,165,245.49	25.24
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	1,576,854,636.28	61.22
	其中：债券	1,576,854,636.28	61.22
	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	333,730,334.95	12.96
8	其他各项资产	14,962,094.46	0.58
9	合计	2,575,712,311.18	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	20,471,784.82	0.80
C	制造业	500,388,777.69	19.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	22,346,154.92	0.87
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	13,810,165.20	0.54
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,714,213.16	0.34
J	金融业	65,026,017.00	2.54
K	房地产业	7,251,929.26	0.28
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	12,154,619.98	0.47
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	650,165,245.49	25.36

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
1	002475	立讯精密	833,016	58,644,326.40	2.29
2	300750	宁德时代	80,100	30,992,037.00	1.21
3	300037	新宙邦	294,900	27,381,465.00	1.07
4	600030	中信证券	918,000	26,374,140.00	1.03
5	001301	尚太科技	266,400	24,911,064.00	0.97
6	300308	中际旭创	19,600	24,892,000.00	0.97
7	002415	海康威视	703,500	24,059,700.00	0.94
8	688002	睿创微纳	147,745	22,854,674.05	0.89
9	600900	长江电力	812,084	21,495,863.48	0.84
10	600031	三一重工	1,242,500	21,470,400.00	0.84
11	688981	中芯国际	121,888	19,358,252.16	0.75
12	002049	紫光国微	216,500	19,214,375.00	0.75
13	601108	财通证券	2,131,100	18,434,015.00	0.72
14	688003	天准科技	135,069	17,194,283.70	0.67
15	300763	锦浪科技	187,900	16,976,765.00	0.66
16	600301	华锡有色	270,500	16,587,060.00	0.65
17	300274	阳光电源	101,400	16,124,628.00	0.63
18	000657	中钨高新	167,400	16,023,528.00	0.62
19	002273	水晶光电	439,000	15,575,720.00	0.61
20	603233	大参林	918,840	13,810,165.20	0.54
21	002317	众生药业	542,300	13,324,311.00	0.52
22	601609	金田股份	1,212,100	13,090,680.00	0.51
23	603115	海星股份	102,700	12,577,669.00	0.49
24	603306	华懋科技	117,600	12,193,944.00	0.48
25	601318	中国平安	255,300	12,188,022.00	0.48
26	603259	药明康德	97,600	12,152,176.00	0.47
27	600482	中国动力	369,000	12,103,200.00	0.47
28	002028	思源电气	54,300	9,393,900.00	0.37
29	002810	山东赫达	363,600	8,980,920.00	0.35
30	688377	迪威尔	376,984	8,889,282.72	0.35
31	688213	思特威	81,388	8,714,213.16	0.34
32	688147	微导纳米	51,621	8,356,407.48	0.33
33	601211	国泰海通	441,200	8,029,840.00	0.31
34	002126	银轮股份	153,200	7,629,360.00	0.30
35	002244	滨江集团	954,200	7,251,920.00	0.28
36	300666	江丰电子	19,400	7,150,840.00	0.28
37	688488	艾迪药业	548,019	7,042,044.15	0.27
38	301216	万凯新材	270,550	6,219,944.50	0.24
39	300568	星源材质	289,500	5,419,440.00	0.21

40	301611	珂玛科技	28,400	5,113,988.00	0.20
41	300408	三环集团	30,500	5,090,450.00	0.20
42	001203	大中矿业	128,500	3,848,575.00	0.15
43	001248	华润新能源	84,104	850,291.44	0.03
44	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.02
45	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.01
46	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.01
47	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.01
48	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.00
49	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.00
50	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.00
51	688781	视涯科技	1,300	61,893.00	0.00
52	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
53	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
54	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
55	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
56	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
57	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
58	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
59	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
60	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
61	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
62	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
63	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
64	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
65	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
66	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
67	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
68	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
69	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
70	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
71	688712	北芯生命	234	8,405.28	0.00
72	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
73	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
74	000811	冰轮环境	57	3,204.54	0.00
75	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
76	001396	誉帆科技	69	2,443.98	0.00
77	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
78	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
79	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
80	600048	保利发展	2	9.26	0.00

注：上表中股票名称以报告期末名称为准。

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	688002	睿创微纳	45,096,090.34	1.76
2	002126	银轮股份	42,293,842.95	1.66
3	600030	中信证券	38,946,465.00	1.52
4	688676	金盘科技	38,574,631.72	1.51
5	001203	大中矿业	36,147,539.00	1.41
6	002810	山东赫达	34,520,256.71	1.35
7	688516	奥特维	32,798,476.31	1.28
8	300763	锦浪科技	28,495,452.00	1.12
9	300567	精测电子	25,014,013.00	0.98
10	002415	海康威视	24,038,036.00	0.94
11	600522	中天科技	23,620,532.00	0.92
12	603638	艾迪精密	23,597,807.00	0.92
13	688377	迪威尔	23,574,848.00	0.92
14	300274	阳光电源	23,468,116.00	0.92
15	600482	中国动力	23,091,521.00	0.90
16	300776	帝尔激光	22,832,736.40	0.89
17	001301	尚太科技	22,591,402.00	0.88
18	688213	思特威	22,482,925.89	0.88
19	601231	环旭电子	22,040,791.64	0.86
20	000683	博源化工	21,700,483.00	0.85

注：“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 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	688516	奥特维	46,339,675.78	1.81
2	601601	中国太保	40,355,001.23	1.58
3	600522	中天科技	40,229,465.00	1.57
4	001203	大中矿业	39,487,731.00	1.55
5	002126	银轮股份	38,998,538.00	1.53
6	688676	金盘科技	34,709,128.18	1.36
7	000811	冰轮环境	32,481,617.10	1.27
8	600176	中国巨石	30,024,068.18	1.17
9	300054	鼎龙股份	29,627,363.00	1.16
10	600301	华锡有色	29,364,972.00	1.15
11	601231	环旭电子	28,858,757.40	1.13
12	002027	分众传媒	28,386,101.00	1.11

13	002810	山东赫达	28,245,734.56	1.11
14	300567	精测电子	27,970,672.18	1.09
15	605117	德业股份	27,839,248.40	1.09
16	300776	帝尔激光	27,820,910.00	1.09
17	603773	沃格光电	26,677,259.69	1.04
18	600075	新疆天业	26,226,998.92	1.03
19	688525	佰维存储	25,790,941.93	1.01
20	601899	紫金矿业	25,337,827.93	0.99

注：“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 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	1,323,043,082.52
卖出股票收入（成交）总额	1,584,987,565.81

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	132,329,671.23	5.16
	其中：政策性金融债	132,329,671.23	5.16
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,444,524,965.05	56.34
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,576,854,636.28	61.50

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	113052	兴业转债	1,153,450	132,747,842.79	5.18
2	220203	22 国开 03	1,300,000	132,329,671.23	5.16
3	113042	上银转债	774,260	89,447,500.16	3.49
4	113053	隆 22 转债	595,190	70,881,601.07	2.76
5	127067	恒逸转 2	381,159	55,098,152.07	2.15

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。

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。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

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

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.11.2 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，故此项不适用。

7.11.3 报告期末基金持有的全部公开募集不动产投资信托基金情况

注：本基金本报告期末未持有公开募集不动产投资信托基金。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行、上海银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司具有在报告编制日前一年内受到监管部门处罚的情况；本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

前十名证券的发行主体中，未见其他发行主体有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是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	419,088.30
2	应收清算款	12,827,939.96
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,715,066.20

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,962,094.46

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113052	兴业转债	132,747,842.79	5.18
2	113042	上银转债	89,447,500.16	3.49
3	113053	隆 22 转债	70,881,601.07	2.76
4	127067	恒逸转 2	55,098,152.07	2.15
5	113062	常银转债	54,746,110.56	2.14
6	113043	财通转债	54,189,696.17	2.11
7	110073	国投转债	53,145,379.51	2.07
8	118034	晶能转债	50,807,485.39	1.98
9	118031	天 23 转债	45,166,469.32	1.76
10	127045	牧原转债	43,772,355.60	1.71
11	127110	广核转债	41,138,296.96	1.60
12	123259	锦浪转 02	39,317,495.75	1.53
13	113691	和邦转债	38,601,528.67	1.51
14	127050	麒麟转债	32,072,839.42	1.25
15	113058	友发转债	22,878,193.06	0.89
16	127049	希望转 2	22,624,930.88	0.88
17	118024	冠宇转债	21,153,557.58	0.83
18	127089	晶澳转债	21,034,255.57	0.82
19	113677	华懋转债	20,752,144.77	0.81
20	127030	盛虹转债	20,196,776.35	0.79
21	118059	顾中转债	19,654,961.24	0.77
22	118050	航宇转债	18,637,041.96	0.73
23	113059	福莱转债	18,603,039.34	0.73
24	113666	爱玛转债	17,646,901.00	0.69
25	123247	万凯转债	17,372,605.29	0.68
26	123252	银邦转债	16,454,569.62	0.64
27	113056	重银转债	16,126,566.19	0.63
28	110086	精工转债	15,385,519.87	0.60
29	123176	精测转 2	15,108,251.97	0.59
30	127103	东南转债	14,673,036.31	0.57
31	123172	漱玉转债	14,490,601.97	0.57
32	123119	康泰转 2	14,489,063.43	0.57
33	113667	春 23 转债	14,419,099.13	0.56
34	123150	九强转债	14,274,755.46	0.56
35	113605	大参转债	13,150,730.64	0.51
36	110087	天业转债	12,880,697.52	0.50

37	127082	亚科转债	12,585,501.03	0.49
38	110093	神马转债	12,399,925.34	0.48
39	110075	南航转债	12,391,153.14	0.48
40	110099	福能转债	12,329,263.28	0.48
41	113051	节能转债	11,011,785.79	0.43
42	118042	奥维转债	10,300,774.82	0.40
43	111000	起帆转债	9,635,666.98	0.38
44	127108	太能转债	9,565,939.03	0.37
45	113046	金田转债	8,856,613.92	0.35
46	118030	睿创转债	8,590,534.92	0.34
47	113673	岱美转债	8,503,442.29	0.33
48	113048	晶科转债	8,128,321.55	0.32
49	128142	新乳转债	7,929,187.20	0.31
50	123091	长海转债	7,484,250.14	0.29
51	113615	金诚转债	6,922,316.47	0.27
52	127062	垒知转债	6,840,146.58	0.27
53	123165	回天转债	5,281,559.59	0.21
54	123149	通裕转债	5,069,105.67	0.20
55	127095	广泰转债	4,419,676.74	0.17
56	118058	微导转债	4,375,425.04	0.17
57	123258	胜蓝转 02	4,184,696.85	0.16
58	113694	清源转债	4,067,452.98	0.16
59	127040	国泰转债	3,591,644.00	0.14
60	118053	正帆转债	3,411,093.38	0.13
61	118035	国力转债	3,217,111.51	0.13
62	127046	百润转债	2,538,999.37	0.10
63	113699	金 25 转债	1,787,610.15	0.07

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	300750	宁德时代	9,179,982.00	0.36	询价转让流通受限

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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

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（%）
102,115	22,287.81	60,826,316.86	2.67	2,215,093,664.04	97.33

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比（%）	94.95

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	3,632,771.60	0.1596

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2004 年 5 月 11 日）	3,282,404,810.93
基金份额总额	
本报告期期初基金份额总额	2,137,416,215.16
本报告期基金总申购份额	433,690,162.52
减：本报告期基金总赎回份额	295,186,396.78
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,275,919,980.90

注：总申购份额含红利再投资、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 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）本报告期内，基金管理人重大人事变动： 2026 年 3 月 19 日，基金管理人的财务负责人由陈锦泉先生变更为马亚静女士。
（2）本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、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及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：本报告期内，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：本报告期内，本基金管理人的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：本报告期内托管人无重大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：本报告期内托管人相关从业人员无重大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 (%)	
兴业证券	3	2,016,648,929.08	70.21	899,229.47	70.21	—
中金公司	1	461,558,604.32	16.07	205,810.73	16.07	—
光大证券	1	394,183,928.61	13.72	175,766.67	13.72	—
国泰海通证券	1	—	—	—	—	—
申万宏源证券	1	—	—	—	—	—

注：1. 报告期内无租用证券公司交易单元变更；

2. 上表列示交易单元数量为截至本报告期末本基金租用数量，成交金额及佣金为本报告期间

数；

3. 根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力、客户服务质量的基础上，选择基金专用交易席位。

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	
	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(%)
兴业证券	1,753,375,332.23	70.25	300,000,000.00	100.00	-	-
中金公司	333,253,951.84	13.35	-	-	-	-
光大证券	409,293,691.06	16.40	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-

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	关于旗下公募基金产品直销渠道认（申）购费优惠活动的公告	上海证券报、指定互联网网站	2026 年 1 月 26 日
2	关于兴全可转债混合型证券投资基金暂停接受大额申购（含定投）、大额转换转入申请的公告	上海证券报、指定互联网网站	2026 年 3 月 4 日
3	兴证全球基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、指定互联网网站	2026 年 3 月 20 日
4	兴证全球基金管理公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	上海证券报、指定互联网网站	2026 年 3 月 30 日
5	兴全可转债混合型证券投资基金分红公告	上海证券报、指定互联网网站	2026 年 4 月 17 日
6	关于兴全可转债混合型证券投资基金恢复接受大额申购（含定投）、大额转换转入申请的公告	上海证券报、指定互联网网站	2026 年 4 月 29 日
7	关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	上海证券报、指定互联网网站	2026 年 6 月 5 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，故不涉及本项特有风险。							

注：1、“申购金额”包含份额申购、转换转入、分红再投资等导致投资者持有份额增加的情形。
2、“赎回份额”包含份额赎回、转换转出等导致投资者持有份额减少的情形。

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、中国证监会准予基金募集注册的文件；
- 2、《兴全可转债混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《兴全可转债混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、关于申请募集基金之法律意见；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站（<http://www.xqfunds.com>）查阅，或在营业时间内至基金管理人、基金托管人住所免费查阅。

基金管理人客户服务中心电话：400-678-0099，021-38824536

兴证全球基金管理有限公司

2026 年 8 月 31 日