

兴全创业板综指增强型发起式证券投资基金

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：恒丰银行股份有限公司

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。

基金托管人恒丰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 03 月 31 日（基金合同生效日）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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	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	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
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	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	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）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	51
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	51

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	51
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	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 投资组合报告附注	52
§ 8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
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	53
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	54
§ 9 开放式基金份额变动	54
§ 10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
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	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	55
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	55
10.8 其他重大事件	56
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	56
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	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	57
§ 12 备查文件目录	57
12.1 备查文件目录	57
12.2 存放地点	57
12.3 查阅方式	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴全创业板综指增强型发起式证券投资基金	
基金简称	兴全创业板综指增强发起式	
基金主代码	026814	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026 年 3 月 31 日	
基金管理人	兴证全球基金管理有限公司	
基金托管人	恒丰银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	38,326,696.28 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	兴全创业板综指增强发起式 A	兴全创业板综指增强发起式 C
下属分级基金的交 易代码	026814	026815
报告期末下属分级 基金的份额总额	25,242,259.68 份	13,084,436.60 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对创业板综合指数进行有效跟踪的基础上，对基金投资组合进行相对增强，力争实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用指数复制结合相对增强的投资策略，即通过指数复制的方法拟合、跟踪创业板综合指数，并在严格控制与业绩比较基准偏离风险的前提下进行相对增强的组合管理，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。本基金力争日均跟踪误差的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。 本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。 具体投资策略可以细分为股票投资策略、存托凭证的投资策略、港股投资策略、债券投资策略、可转换债券及可交换债券投资策略、参与股指期货交易策略、参与国债期货交易策略、参与股票期权交易策略、资产支持证券投资策略、融资、转融通证券出借业务投资策略。
业绩比较基准	创业板综合指数收益率×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，预期收益和预期风险高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。 本基金可投资于港股通标的股票，需面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

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	恒丰银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨卫东	梁明
	联系电话	021-20398888	021-63890689
	电子邮箱	yangwd@xqfunds.com	liangming@hfbank.com.cn
客户服务电话		4006780099, 021-38824536	95395
传真		021-20398988	021-63890708
注册地址		上海市黄浦区金陵东路 368 号	济南市历下区泺源大街 8 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	上海市黄浦区开平路 88 号瀛通 绿地大厦 16 楼
邮政编码		201204	200023
法定代表人		庄园芳	辛树人

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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	2026 年 3 月 31 日（基金合同生效日）-2026 年 6 月 30 日	
	兴全创业板综指增强发起式 A	兴全创业板综指增强发起式 C
本期已实现收益	4,522,952.61	3,319,169.82
本期利润	5,813,466.47	5,383,213.01
加权平均基金份 额本期利润	0.2052	0.2253
本期加权平均净 值利润率	18.42%	20.46%
本期基金份额净 值增长率	19.47%	19.41%
3.1.2 期末数	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	

据和指标		
期末可供分配利润	4,237,964.15	2,188,590.20
期末可供分配基金份额利润	0.1679	0.1673
期末基金资产净值	30,156,434.17	15,623,731.16
期末基金份额净值	1.1947	1.1941
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	19.47%	19.41%

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。

4、本基金合同于 2026 年 03 月 31 日生效，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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

兴全创业板综指增强发起式 A

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	19.47%	1.73%	23.45%	1.85%	-3.98%	-0.12%
自基金合同生效起至今	19.47%	1.71%	20.70%	1.87%	-1.23%	-0.16%

兴全创业板综指增强发起式 C

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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

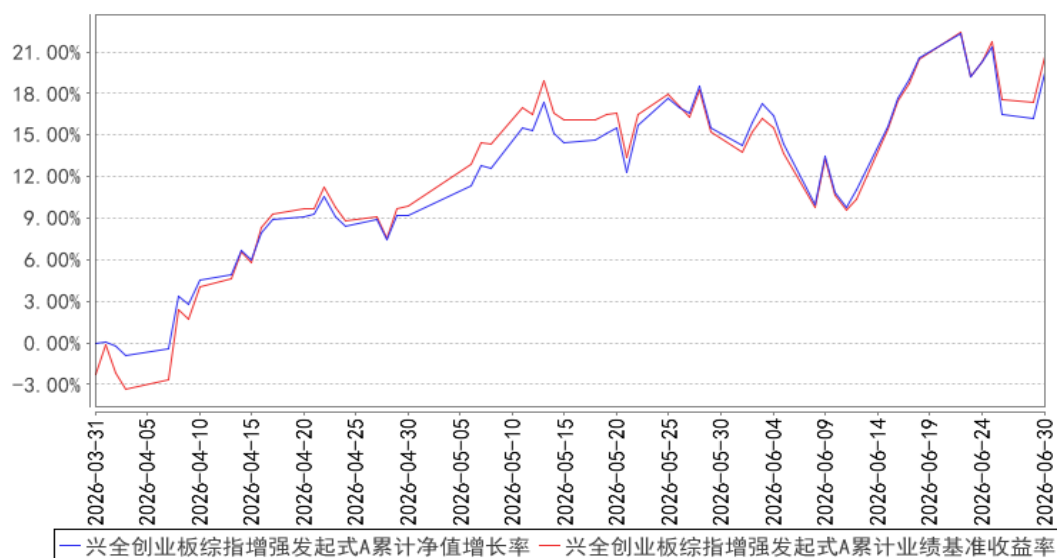
过去三个月	19.41%	1.72%	23.45%	1.85%	-4.04%	-0.13%
自基金合同生效 起至今	19.41%	1.71%	20.70%	1.87%	-1.29%	-0.16%

注：1、本基金业绩比较基准为创业板综合指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%，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。

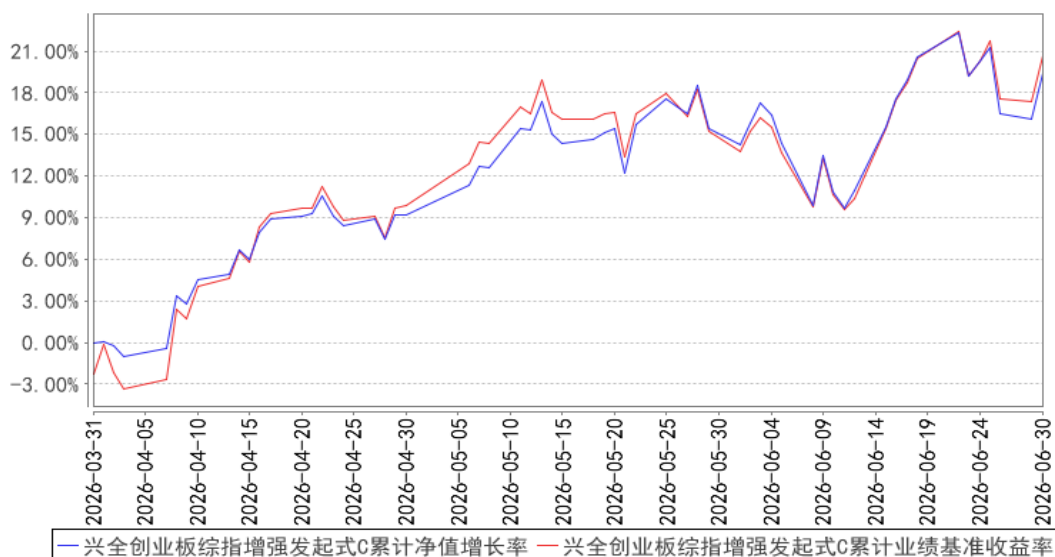
2、本基金成立于 2026 年 03 月 31 日，截至 2026 年 06 月 30 日，本基金成立不满一年。

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

兴全创业板综指增强发起式A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



兴全创业板综指增强发起式C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《兴全创业板综指增强型发起式证券投资基金基金合同》的规定，本基金建仓期为 2026 年 03 月 31 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、本基金成立于 2026 年 03 月 31 日，截至 2026 年 06 月 30 日，本基金成立不满一年。

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		
黄志远	兴全汇吉一年持有期混合型证券投资基金基金经理、兴全创业板综指增强型发起式证券投资基金基金经理、兴全价值量化选股股票型发起式证券投资基金基金经理、兴全沪深 300 质量交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、兴全国证价值 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理	2026 年 3 月 31 日	—	8 年	硕士。历任兴证全球基金管理有限公司研究部研究员、固定收益部研究员、基金经理助理。现任兴证全球基金管理有限公司基金经理。

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、《兴全创业板综指增强型发起式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，美伊冲突和全球 AI 周期成为影响资产定价的两条主线，前者通过通胀压力的传导改变美元流动性预期，后者通过 AI 基建催生结构性的行业景气趋势。受此影响，资产定价呈现 K 型分化，AI 周期映射的科技板块景气度持续上修，带动科创类个股和指数表现亮眼；另一方面，传统经济动能走弱，叠加美元流动性拐头，价值、红利类资产整体表现欠佳。均衡配置阶段性失效，存量资金向科技板块集中，市场交易拥挤度上升。本期内，创业板表现较强，创业板综指累计上涨 24.15%。产品成立以来，优先选择均衡模型以应对，首要目标是跟上指数，在此基础上，力争实现持续稳定的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，兴全创业板综指增强发起式 A 的基金份额净值为 1.1947 元，本报告期基金份额净值增长率为 19.47%，同期业绩比较基准收益率为 20.70%；兴全创业板综指增强发起式 C 的基金份额净值为 1.1941 元，本报告期基金份额净值增长率为 19.41%，同期业绩比较基准收益率为 20.70%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在前期景气成长风格较价值风格累积较大超额和显著估值溢价的背景下，展望下半年，资产定价的 K 型分化或趋于缓和，均衡配置的有效性有望回归。本产品使用基于多因子模型的量化选股策略，在保持行业、市值等风格中性的情况下，力争通过内部多轮迭代的阿尔法因子与适当的仓位管理实现较跟踪指数的稳定超额收益，在动态变化的市场环境下，优化投资者的持有体验。

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》、《兴全创业板综指增强型发起式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，本基金未实施利润分配，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

本基金为发起式基金，截至报告期末成立不满三年，本项不适用。

§ 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，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支、利润分配情况等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本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

本托管人认真复核了报告中的财务指标、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，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：兴全创业板综指增强型发起式证券投资基金

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
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	178,107.70
结算备付金		71,895.58
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	45,653,664.09
其中：股票投资		43,036,811.10
基金投资		-
债券投资		2,616,852.99
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		—
应收股利		—
应收申购款		53,261.33
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.8	—
资产总计		45,956,928.70
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 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		—
应付赎回款		95,956.12
应付管理人报酬		31,595.02
应付托管费		5,924.07
应付销售服务费		2,920.37
应付投资顾问费		—
应交税费		90.83
应付利润		—
递延所得税负债		—
其他负债	6.4.7.9	40,276.96
负债合计		176,763.37
净资产：		
实收基金	6.4.7.10	38,326,696.28
其他综合收益	6.4.7.11	—
未分配利润	6.4.7.12	7,453,469.05
净资产合计		45,780,165.33
负债和净资产总计		45,956,928.70

注：1. 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，兴全创业板综指增强发起式 A 基金份额净值 1.1947 元，基金份额总额 25,242,259.68 份；兴全创业板综指增强发起式 C 基金份额净值 1.1941 元，基金份额总额 13,084,436.60 份。兴全创业板综指增强发起式份额总额合计为 38,326,696.28 份。

2. 本基金合同生效日为 2026 年 03 月 31 日，本期财务报表的实际编制期间为 2026 年 03 月 31 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日止期间。

6.2 利润表

会计主体：兴全创业板综指增强型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 3 月 31 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 3 月 31 日（基金合 同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		11,387,913.34
1. 利息收入		15,616.72
其中：存款利息收入	6.4.7.13	3,623.92
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		11,992.80
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		7,916,866.24
其中：股票投资收益	6.4.7.14	7,642,799.42
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	40,865.40
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	233,201.42
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	3,354,557.05
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	100,873.33
减：二、营业总支出		191,233.86
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	115,867.85
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	21,725.22
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	13,199.71
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		384.44
其中：卖出回购金融资产支出		384.44
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		56.88
8. 其他费用	6.4.7.23	39,999.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号 填列）		11,196,679.48

减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		11,196,679.48
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		11,196,679.48

6.3 净资产变动表

会计主体：兴全创业板综指增强型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 3 月 31 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 3 月 31 日（基金合同生效日）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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	64,157,634.95	-	-	64,157,634.95
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-25,830,938.67	-	7,453,469.05	-18,377,469.62
（一）、综合收益总额	-	-	11,196,679.48	11,196,679.48
（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）	-25,830,938.67	-	-3,743,210.43	-29,574,149.10
其中：1. 基金申购款	15,826,162.99	-	2,391,786.46	18,217,949.45
2. 基金赎回款	-41,657,101.66	-	-6,134,996.89	-47,792,098.55
（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）、其他综合	-	-	-	-

收益结转留存收益				
四、本期期末净资产	38,326,696.28	-	7,453,469.05	45,780,165.33

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：

<u>庄园芳</u>	<u>詹鸿飞</u>	<u>詹鸿飞</u>
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

兴全创业板综指增强型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”),经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予兴全创业板综指增强型发起式证券投资基金注册的批复》(证监许可[2026]185 号文)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《兴全创业板综指增强型发起式证券投资基金基金合同》发售,基金合同于 2026 年 3 月 31 日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。首次设立募集规模为 64,157,634.95 份基金份额。本基金的基金管理人为兴证全球基金管理有限公司,基金托管人为恒丰银行股份有限公司。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括创业板综合指数的成份股及其备选成份股、其他非指数成份股(包含主板、创业板及其他国内依法发行上市的股票及存托凭证)、港股通标的股票、债券(包括国债、地方政府债、政府支持债券、政府支持机构债券、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券(含分离交易可转债的纯债部分)、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、金融衍生工具(包括股指期货、国债期货、股票期权)、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定,参与融资业务和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%(其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%),投资于创业板综合指数的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%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,本基金应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债

券投资比例合计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：创业板综合指数收益率 $\times$ 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》及财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、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的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 30 日的财务状况、自 2026 年 03 月 31 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2026 年 03 月 31 日(基金合同生效日)至 2026 年 06 月 30 日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资、资产支持证券投资和买入返售金融资产等。

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务

模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b) 后续计量

— 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

— 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

— 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

— 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

— 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内（若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包

含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资；本基金类基金份额的投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为该类基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金类基金份额默认的收益分配方式是现金分红；本基金类份额的收益分配方式是红利再投资；基金收益分配后各类基金份额的基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额的基金份额净

值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”）在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证监会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78

号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税〔2012〕85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2015〕101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2014〕81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税〔2016〕127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》、中投信〔2021〕20号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部税务总局公告2023年第2号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部 税务总局 中国证监会公告2023年第23号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、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) 对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

对本基金从中国内地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。

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。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。对本基金通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，按照上述规定计征个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至 2027 年 12 月 31 日。

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。对于本基金通过沪港通、深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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 6 月 30 日
活期存款	178,107.70
等于：本金	178,076.11
加：应计利息	31.59

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	178,107.70

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		39,683,060.05	-	43,036,811.10	3,353,751.05
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	2,601,534.00	14,512.99	2,616,852.99	806.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,601,534.00	14,512.99	2,616,852.99	806.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		42,284,594.05	14,512.99	45,653,664.09	3,354,557.05

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：本基金本报告期末未持有期货合约。

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	—
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	—

其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	39,999.76
其他	277.20
合计	40,276.96

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

兴全创业板综指增强发起式 A

项目	本期 2026 年 3 月 31 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	31,062,455.43	31,062,455.43
本期申购	4,061,362.87	4,061,362.87
本期赎回（以“-”号填列）	-9,881,558.62	-9,881,558.62
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	25,242,259.68	25,242,259.68

兴全创业板综指增强发起式 C

项目	本期 2026 年 3 月 31 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	33,095,179.52	33,095,179.52
本期申购	11,764,800.12	11,764,800.12
本期赎回（以“-”号填列）	-31,775,543.04	-31,775,543.04
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	13,084,436.60	13,084,436.60

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

兴全创业板综指增强发起式 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-

前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	4,522,952.61	1,290,513.86	5,813,466.47
本期基金份额交易产生的变动数	-284,988.46	-614,303.52	-899,291.98
其中：基金申购款	346,486.67	241,878.05	588,364.72
基金赎回款	-631,475.13	-856,181.57	-1,487,656.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,237,964.15	676,210.34	4,914,174.49

兴全创业板综指增强发起式 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	3,319,169.82	2,064,043.19	5,383,213.01
本期基金份额交易产生的变动数	-1,130,579.62	-1,713,338.83	-2,843,918.45
其中：基金申购款	571,190.91	1,232,230.83	1,803,421.74
基金赎回款	-1,701,770.53	-2,945,569.66	-4,647,340.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,188,590.20	350,704.36	2,539,294.56

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 3 月 31 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,131.59
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	815.45
其他	676.88
合计	3,623.92

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3月31日（基金合同生效日）至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	7,642,799.42

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	7,642,799.42

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 3 月 31 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	55,818,752.10
减：卖出股票成本总额	48,112,133.90
减：交易费用	63,818.78
买卖股票差价收入	7,642,799.42

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3月31日（基金合同生效日）至2026年6 月30日
债券投资收益——利息收入	3,795.47
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	37,069.93
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	40,865.40

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3月31日（基金合同生效日）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	295,086.88
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	256,918.00
减：应计利息总额	1,095.20

减：交易费用	3.75
买卖债券差价收入	37,069.93

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收益其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 3 月 31 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	233,201.42
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	233,201.42

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 3 月 31 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	3,354,557.05
股票投资	3,353,751.05
债券投资	806.00
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	—
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	3,354,557.05

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 3 月 31 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	100,597.70
基金转换费收入	274.62
其他	1.01
合计	100,873.33

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 3 月 31 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
----	---

审计费用	6,666.32
信息披露费	33,333.44
证券出借违约金	-
合计	39,999.76

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
恒丰银行股份有限公司	基金托管人
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 3 月 31 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
兴业证券	143,613,946.05	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 3 月 31 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
兴业证券	3,152,449.24	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 3 月 31 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
兴业证券	231,600,000.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内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3月31日（基金合同生效日）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	26,702.67	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 3 月 31 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	115,867.85
其中：应支付销售机构的客户维护费	34,762.27
应支付基金管理人的净管理费	81,105.58

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 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×0.80%/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 3 月 31 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
----	---

当期发生的基金应支付的托管费	21,725.22
----------------	-----------

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 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×0.15%/当年天数。

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 3 月 31 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴全创业板综指增强 发起式 A	兴全创业板综指增强 发起式 C	合计
兴业证券	-	10,358.79	10,358.79
合计	-	10,358.79	10,358.79

注：兴全创业板综指增强发起式 A 不收取销售服务费。

兴全创业板综指增强发起式 C 的基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 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：每日应支付的基金份额销售服务费=基金份额前一日 C 类基金资产净值×0.20%/当年天数。

根据证监会公告[2025]22 号《公开募集证券投资基金销售费用管理规定》，自该规定施行之日起，或对于已发售基金自其完成基金合同修订及相关调整之日起，投资人通过基金管理人认购/申购的或者通过代销机构认购/申购且持续持有期限超过一年的基金份额不收取销售服务费。本基金按照该法规要求对不应收取的销售服务费将在投资者赎回基金份额或基金合同终止时随赎回款或清算款一并返还给投资者。

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

份额单位：份

项目	本期 2026 年 3 月 31 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	兴全创业板综指增强发起式 A	兴全创业板综指增强发起式 C
基金合同生效日（2026 年 3 月 31 日）持有的基金份额	10,000,361.11	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,361.11	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	26.0924%	-%

注：1. 期间申购/买入总份额含红利再投资、转换入份额，期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

2. 关联方投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定，符合公允性要求。

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 3 月 31 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
恒丰银行股份有限公司	178,107.70	2,131.59

注：本基金的银行存款由基金托管人恒丰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

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行过利润分配。

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

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

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

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的信用债。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金于本报告期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	178,107.70	-	-	-	-	-	178,107.70
结算备付金	71,895.58	-	-	-	-	-	71,895.58
交易性金融资产	-	-	2,616,852.99	-	-	43,036,811.10	45,653,664.09
应收申购款	17,095.00	-	-	-	-	36,166.33	53,261.33
资产总计	267,098.28	-	2,616,852.99	-	-	43,072,977.43	45,956,928.70
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	95,956.12	95,956.12
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	31,595.02	31,595.02
应付托管费	-	-	-	-	-	5,924.07	5,924.07
应付销售服务费	-	-	-	-	-	2,920.37	2,920.37
应交税费	-	-	-	-	-	90.83	90.83
其他负债	-	-	-	-	-	40,276.96	40,276.96
负债总计	-	-	-	-	-	176,763.37	176,763.37
利率敏感度缺口	267,098.28	-	2,616,852.99	-	-	42,896,214.06	45,780,165.33

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）	
	对资产负债表日基金资产净值的	

分析	相关风险变量的变动	影响金额（单位：人民币元）
		本期末 （2026 年 6 月 30 日）
	市场利率下降 1%	14,183.77
	市场利率上升 1%	-14,030.80

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。

6.4.13.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

注：无。

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	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	43,036,811.10	94.01
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—债券投资	2,616,852.99	5.72
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	45,653,664.09	99.72

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）
	业绩比较基准上升 10%	4,717,481.21
	业绩比较基准下降 10%	-4,717,481.21

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 6 月 30 日
第一层次	43,036,811.10
第二层次	2,616,852.99

第三层次	—
合计	45,653,664.09

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，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股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

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 06 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，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

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	43,036,811.10	93.65
	其中：股票	43,036,811.10	93.65
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	2,616,852.99	5.69
	其中：债券	2,616,852.99	5.69
	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	250,003.28	0.54
8	其他各项资产	53,261.33	0.12
9	合计	45,956,928.70	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	63,240.00	0.14
B	采矿业	644,326.00	1.41
C	制造业	35,860,923.10	78.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	775,681.00	1.69
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	3,722,843.80	8.13
J	金融业	1,107,705.00	2.42
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	9,492.20	0.02
M	科学研究和技术服务业	427,810.00	0.93
N	水利、环境和公共设施管理业	90,148.00	0.20
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	109,920.00	0.24
Q	卫生和社会工作	93,736.00	0.20
R	文化、体育和娱乐业	130,986.00	0.29
S	综合	—	—
	合计	43,036,811.10	94.01

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

无。

7.2.3 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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	10,000	3,930,100.00	8.58
2	300308	中际旭创	2,900	3,683,000.00	8.04
3	300502	新易盛	2,820	1,711,740.00	3.74
4	300408	三环集团	5,600	934,640.00	2.04
5	300476	胜宏科技	2,600	900,718.00	1.97
6	301308	江波龙	1,000	703,800.00	1.54
7	300433	蓝思科技	11,800	633,188.00	1.38
8	300394	天孚通信	2,080	629,574.40	1.38
9	301200	大族数控	1,700	613,105.00	1.34
10	300857	协创数据	1,800	611,820.00	1.34
11	300475	香农芯创	1,800	540,000.00	1.18
12	300014	亿纬锂能	7,800	507,234.00	1.11
13	300059	东方财富	23,000	468,740.00	1.02
14	301165	锐捷网络	5,780	465,001.00	1.02
15	300124	汇川技术	6,300	417,879.00	0.91
16	300661	圣邦股份	2,900	416,092.00	0.91
17	300274	阳光电源	2,600	413,452.00	0.90
18	300757	罗博特科	600	371,400.00	0.81
19	300672	国科微	1,200	354,000.00	0.77
20	300803	指南针	3,500	320,845.00	0.70
21	300033	同花顺	1,320	318,120.00	0.69
22	300765	石药创新	11,600	315,868.00	0.69
23	300870	欧陆通	900	311,121.00	0.68
24	300450	先导智能	7,400	301,328.00	0.66
25	300102	乾照光电	11,400	296,856.00	0.65
26	301358	湖南裕能	3,900	295,893.00	0.65
27	301392	汇成真空	1,000	288,640.00	0.63
28	300979	华利集团	9,700	288,575.00	0.63
29	301536	星辰科技	2,200	283,162.00	0.62
30	300458	全志科技	7,060	278,587.60	0.61
31	300759	康龙化成	9,400	271,942.00	0.59
32	300073	当升科技	5,400	259,416.00	0.57
33	300760	迈瑞医疗	1,900	258,077.00	0.56
34	300255	常山药业	10,700	250,594.00	0.55
35	300613	富瀚微	3,100	248,248.00	0.54
36	301086	鸿富瀚	1,180	246,950.40	0.54
37	300919	中伟新材	5,600	245,000.00	0.54
38	300118	东方日升	19,600	244,020.00	0.53
39	301321	翰博高新	5,500	242,825.00	0.53
40	300953	震裕科技	1,800	240,660.00	0.53
41	300454	深信服	2,500	240,500.00	0.53
42	300339	润和软件	6,200	238,762.00	0.52

43	300413	芒果超媒	16,300	238,469.00	0.52
44	301219	腾远钴业	4,340	237,832.00	0.52
45	300199	翰宇药业	10,700	236,256.00	0.52
46	300085	银之杰	6,700	234,299.00	0.51
47	300122	智飞生物	20,000	233,800.00	0.51
48	300493	润欣科技	15,600	232,596.00	0.51
49	300277	汽轮科技	15,400	231,616.00	0.51
50	300072	海新能科	67,400	229,160.00	0.50
51	300084	海默科技	18,700	224,961.00	0.49
52	300682	朗新科技	22,100	218,790.00	0.48
53	300129	泰胜风能	25,100	214,605.00	0.47
54	300773	拉卡拉	13,920	212,976.00	0.47
55	300139	晓程科技	5,800	211,990.00	0.46
56	300587	天铁科技	55,000	211,750.00	0.46
57	300324	旋极信息	56,600	210,552.00	0.46
58	301285	鸿日达	1,900	209,627.00	0.46
59	300590	移为通信	14,600	209,510.00	0.46
60	300700	岱勒新材	9,800	208,544.00	0.46
61	300191	潜能恒信	7,500	207,375.00	0.45
62	300879	大叶股份	13,200	206,976.00	0.45
63	300047	天源迪科	23,200	206,016.00	0.45
64	301487	盟固利	10,700	204,905.00	0.45
65	301002	崧盛股份	5,300	204,580.00	0.45
66	300699	光威复材	7,100	203,415.00	0.44
67	300358	楚天科技	25,400	203,200.00	0.44
68	301662	宏工科技	2,000	202,640.00	0.44
69	300393	中来股份	27,700	201,933.00	0.44
70	301479	弘景光电	3,300	198,660.00	0.43
71	300775	三角防务	9,000	198,360.00	0.43
72	301510	固高科技	6,000	191,580.00	0.42
73	301538	骏鼎达	3,800	191,406.00	0.42
74	301189	奥尼电子	3,200	188,576.00	0.41
75	300428	立中集团	10,100	183,618.00	0.40
76	300128	锦富技术	30,400	179,968.00	0.39
77	301439	泓淋电力	11,400	179,208.00	0.39
78	300171	东富龙	16,200	179,172.00	0.39
79	300034	钢研高纳	10,400	178,256.00	0.39
80	300779	惠城环保	3,520	176,704.00	0.39
81	300168	万达信息	38,000	174,420.00	0.38
82	300473	德尔股份	5,700	173,280.00	0.38
83	301260	格力博	12,800	172,928.00	0.38
84	300604	长川科技	500	170,710.00	0.37
85	300357	我武生物	7,300	170,236.00	0.37

86	300628	亿联网络	4,900	165,718.00	0.36
87	300252	金信诺	9,400	162,150.00	0.35
88	300539	横河精密	7,800	158,886.00	0.35
89	300596	利安隆	3,000	157,440.00	0.34
90	300320	海达股份	16,500	157,410.00	0.34
91	300079	数码视讯	37,100	155,820.00	0.34
92	300680	隆盛科技	6,820	154,950.40	0.34
93	301626	苏州天脉	400	153,584.00	0.34
94	300647	超频三	25,600	152,320.00	0.33
95	301039	中集车辆	21,600	152,280.00	0.33
96	300777	中简科技	5,700	149,796.00	0.33
97	301217	铜冠铜箔	900	148,563.00	0.32
98	300337	银邦股份	12,700	148,082.00	0.32
99	300447	全信股份	9,900	147,807.00	0.32
100	301608	博实结	2,925	147,010.50	0.32
101	300903	科翔股份	1,400	141,834.00	0.31
102	300442	润泽科技	1,700	141,219.00	0.31
103	300342	天银机电	3,000	141,000.00	0.31
104	300696	爱乐达	5,300	137,959.00	0.30
105	300183	东软载波	13,200	137,940.00	0.30
106	300259	新天科技	20,600	136,578.00	0.30
107	300363	博腾股份	8,300	134,792.00	0.29
108	300768	迪普科技	9,700	133,569.00	0.29
109	300369	绿盟科技	24,400	132,736.00	0.29
110	301238	瑞泰新材	5,400	131,760.00	0.29
111	300397	天和防务	8,200	124,148.00	0.27
112	301507	民生健康	10,300	123,909.00	0.27
113	300896	爱美客	1,400	122,080.00	0.27
114	301328	维峰电子	1,700	121,040.00	0.26
115	300415	伊之密	6,000	119,460.00	0.26
116	300580	贝斯特	5,900	118,649.00	0.26
117	301061	匠心家居	3,200	112,224.00	0.25
118	300271	华宇软件	23,100	111,342.00	0.24
119	300492	华图山鼎	3,200	109,920.00	0.24
120	300256	星星科技	42,100	109,881.00	0.24
121	301606	绿联科技	1,800	109,836.00	0.24
122	301101	明月镜片	4,000	108,960.00	0.24
123	300049	福瑞医科	2,800	108,864.00	0.24
124	300207	欣旺达	5,700	108,243.00	0.24
125	301280	珠城科技	2,140	108,219.80	0.24
126	300048	合康新能	23,100	107,877.00	0.24
127	301371	敷尔佳	4,100	106,600.00	0.23
128	300595	欧普康视	10,100	106,353.00	0.23

129	300855	图南股份	3,400	106,284.00	0.23
130	300409	道氏技术	5,300	105,629.00	0.23
131	300767	震安科技	4,700	104,763.00	0.23
132	301500	飞南资源	4,000	104,200.00	0.23
133	301535	浙江华远	7,700	103,334.00	0.23
134	300002	神州泰岳	13,200	103,092.00	0.23
135	300986	志特新材	6,000	102,900.00	0.22
136	301551	无线传媒	5,100	100,623.00	0.22
137	300515	三德科技	7,700	100,485.00	0.22
138	300185	通裕重工	36,300	99,099.00	0.22
139	300478	杭州高新	2,700	99,063.00	0.22
140	300848	美瑞新材	7,100	99,045.00	0.22
141	301210	金杨精密	3,300	99,000.00	0.22
142	300459	汤姆猫	28,100	95,259.00	0.21
143	301155	海力风电	2,200	94,380.00	0.21
144	300098	高新兴	20,100	92,259.00	0.20
145	300267	尔康制药	27,900	92,070.00	0.20
146	300940	南极光	6,100	91,988.00	0.20
147	300834	星辉环材	2,200	91,960.00	0.20
148	300504	天邑股份	5,700	91,941.00	0.20
149	300913	兆龙互连	1,900	91,029.00	0.20
150	300170	汉得信息	5,700	86,868.00	0.19
151	300867	圣元环保	4,700	85,164.00	0.19
152	300984	金沃股份	1,500	80,595.00	0.18
153	300424	航新科技	5,100	80,274.00	0.18
154	300148	天舟文化	25,500	79,305.00	0.17
155	300467	迅游科技	2,100	78,078.00	0.17
156	300427	红相股份	11,500	77,165.00	0.17
157	301202	朗威股份	2,300	76,659.00	0.17
158	300206	理邦仪器	6,200	75,826.00	0.17
159	300244	迪安诊断	3,900	73,086.00	0.16
160	300418	昆仑万维	1,800	72,648.00	0.16
161	300177	中海达	11,400	70,680.00	0.15
162	300445	康斯特	3,300	68,706.00	0.15
163	300572	安车检测	2,100	59,577.00	0.13
164	301377	鼎泰高科	100	55,090.00	0.12
165	301228	实朴检测	700	54,712.00	0.12
166	300635	中达安	4,300	52,331.00	0.11
167	300291	百纳千成	10,700	51,681.00	0.11
168	300681	英搏尔	1,800	51,516.00	0.11
169	301091	深城交	3,150	48,825.00	0.11
170	300996	普联软件	4,120	44,866.80	0.10
171	300693	盛弘股份	900	43,875.00	0.10

172	300810	中科海讯	1,700	43,146.00	0.09
173	300498	温氏股份	3,500	43,120.00	0.09
174	300219	鸿利智汇	3,900	40,677.00	0.09
175	300685	艾德生物	2,400	40,416.00	0.09
176	300620	光库科技	100	37,820.00	0.08
177	300378	鼎捷数智	900	32,490.00	0.07
178	301152	天力锂能	1,200	28,404.00	0.06
179	300136	信维通信	200	23,850.00	0.05
180	300109	新开源	1,340	21,507.00	0.05
181	300015	爱尔眼科	2,500	20,650.00	0.05
182	300511	雪榕生物	4,000	20,120.00	0.04
183	300373	扬杰科技	100	15,723.00	0.03
184	300563	神宇股份	500	14,195.00	0.03
185	300233	金城医药	1,100	13,640.00	0.03
186	300285	国瓷材料	100	10,318.00	0.02
187	300226	上海钢联	620	9,492.20	0.02
188	301329	信音电子	300	7,287.00	0.02
189	301109	军信股份	400	4,984.00	0.01
190	301295	美硕科技	100	4,218.00	0.01
191	301558	三态股份	500	3,085.00	0.01

注：上表中股票名称以报告期末名称为准。

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

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	4,825,776.00	10.54
2	300308	中际旭创	2,478,454.00	5.41
3	300502	新易盛	1,332,131.00	2.91
4	300394	天孚通信	1,228,801.00	2.68
5	300124	汇川技术	960,626.00	2.10
6	300476	胜宏科技	944,415.00	2.06
7	300857	协创数据	924,137.00	2.02
8	300255	常山药业	829,300.00	1.81
9	300408	三环集团	682,447.00	1.49
10	300223	北京君正	681,051.00	1.49
11	300433	蓝思科技	679,974.00	1.49
12	300014	亿纬锂能	658,999.00	1.44
13	300775	三角防务	650,491.00	1.42

14	300033	同花顺	642,747.00	1.40
15	300059	东方财富	608,682.00	1.33
16	300454	深信服	588,008.70	1.28
17	300779	惠城环保	559,272.00	1.22
18	300672	国科微	556,439.00	1.22
19	300765	石药创新	517,266.00	1.13
20	301510	固高科技	513,191.00	1.12

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	1,172,184.00	2.56
2	300750	宁德时代	869,026.00	1.90
3	300394	天孚通信	789,725.00	1.73
4	300223	北京君正	789,238.00	1.72
5	300857	协创数据	721,157.00	1.58
6	300604	长川科技	618,890.00	1.35
7	300302	同有科技	589,612.00	1.29
8	300502	新易盛	573,686.00	1.25
9	300433	蓝思科技	525,899.00	1.15
10	300255	常山药业	525,070.00	1.15
11	300124	汇川技术	519,956.00	1.14
12	300373	扬杰科技	494,439.00	1.08
13	300283	温州宏丰	485,657.00	1.06
14	300769	德方纳米	443,332.00	0.97
15	300751	迈为股份	443,130.00	0.97
16	300263	隆华科技	438,945.00	0.96
17	300843	胜蓝股份	425,986.00	0.93
18	300001	特锐德	424,195.00	0.93
19	300221	银禧科技	422,286.00	0.92
20	300390	天华新能	416,600.00	0.91

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	87,795,193.95
卖出股票收入（成交）总额	55,818,752.10

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	2,616,852.99	5.72
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	2,616,852.99	5.72

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	019827	26 国债 01	26,000	2,616,852.99	5.72

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

基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货交易中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货交易，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

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

本基金参与国债期货交易以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以萃取相应债券组合的超额收益。

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本期未出现被监管部门立案调查，并且未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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	53,261.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	53,261.33

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不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不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

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

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（%）
兴全创业板综指增强发起式 A	434	58,161.89	10,000,361.11	39.62	15,241,898.57	60.38
兴全创业板综指增强发起式 C	276	47,407.38	4,460,395.36	34.09	8,624,041.24	65.91
合计	710	53,981.26	14,460,756.47	37.73	23,865,939.81	62.27

注：对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总数）。

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	兴全创业板综指增强发起式 A	11,071.12	0.0439
	兴全创业板综指增强发起式 C	867.30	0.0066
	合计	11,938.42	0.0311

注：“占基金总份额比例”对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总数）。

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	兴全创业板综指增强发起式 A	0
	兴全创业板综指增强发起式 C	0

	合计	0
本基金基金经理持有 本开放式基金	兴全创业板综指增强发起 式 A	0
	兴全创业板综指增强发起 式 C	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份 额占基 金总份 额比例 (%)	发起份额总数	发起份 额占基 金总份 额比例(%)	发起份 额承 诺持 有期 限
基金管理人固有 资金	10,000,361.11	26.0924	10,000,361.11	26.0924	3 年
基金管理人高级 管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,361.11	26.0924	10,000,361.11	26.0924	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	兴全创业板综指增强发起式 A	兴全创业板综指增强发起式 C
基金合同生效日 （2026 年 3 月 31 日）基金份额总额	31,062,455.43	33,095,179.52
基金合同生效日起 至报告期期末基金 总申购份额	4,061,362.87	11,764,800.12
减：基金合同生效 日起至报告期期末 基金总赎回份额	9,881,558.62	31,775,543.04
基金合同生效日起 至报告期期末基金 拆分变动份额	-	-
本报告期末基金 份额总额	25,242,259.68	13,084,436.60

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

本基金自 2026 年起聘请毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。

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：无。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：无。

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	143,613,946 .05	100.00	26,702.67	100.00	-
------	---	--------------------	--------	-----------	--------	---

- 注：1. 报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：新增兴业证券交易单元 3 个；
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	3,152,449.24	100.00	231,600,000.00	100.00	-	-

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	兴全创业板综指增强型发起式证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、指定互联网网站	2026 年 4 月 1 日
2	兴全创业板综指增强型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	中国证券报、指定互联网网站	2026 年 4 月 29 日
3	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	中国证券报、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	1	2026 年 05 月 12 日-2026 年 06 月 30 日	0.00	10,000,361.11	0.00	10,000,361.11	26.09

个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金本报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，有可能对基金净值产生一定影响，甚至可能引发基金的流动性风险。在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。基金管理人将在基金运作中保持合适的流动性水平，并对申购赎回进行合理的应对，加强防范流动性风险，保护持有人利益。							

注：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、《兴全创业板综指增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《兴全创业板综指增强型发起式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