兴全中证沪港深 300 指数增强型证券投资基金
2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 10 月 27 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	兴全中证沪港深 300 指数增强
基金主代码	023203
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2025 年 4 月 1 日
报告期末基金份额总额	141,920,703.76 份
投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对中证沪港深 300 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、跟踪中证沪港深 300 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%。
业绩比较基准	中证沪港深 300 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。基金管理人对本基金的风险评级为 R3。
基金管理人	兴证全球基金管理有限公司

基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	兴全中证沪港深 300 指数增强 A	兴全中证沪港深 300 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	023203	023204
报告期末下属分级基金的份额总额	29,893,602.65 份	112,027,101.11 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日）	
	兴全中证沪港深 300 指数增强 A	兴全中证沪港深 300 指数增强 C
1.本期已实现收益	201,322.93	785,828.59
2.本期利润	-573,492.62	-1,830,374.87
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0205	-0.0160
4.期末基金资产净值	37,302,815.43	138,967,863.00
5.期末基金份额净值	1.2479	1.2405

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（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

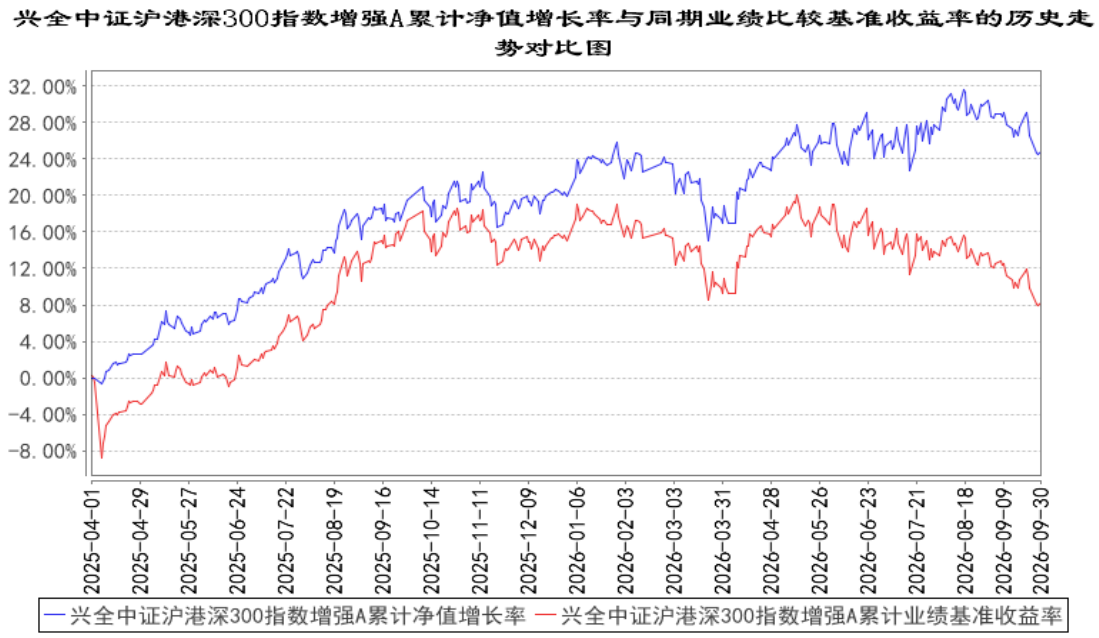
兴全中证沪港深 300 指数增强 A

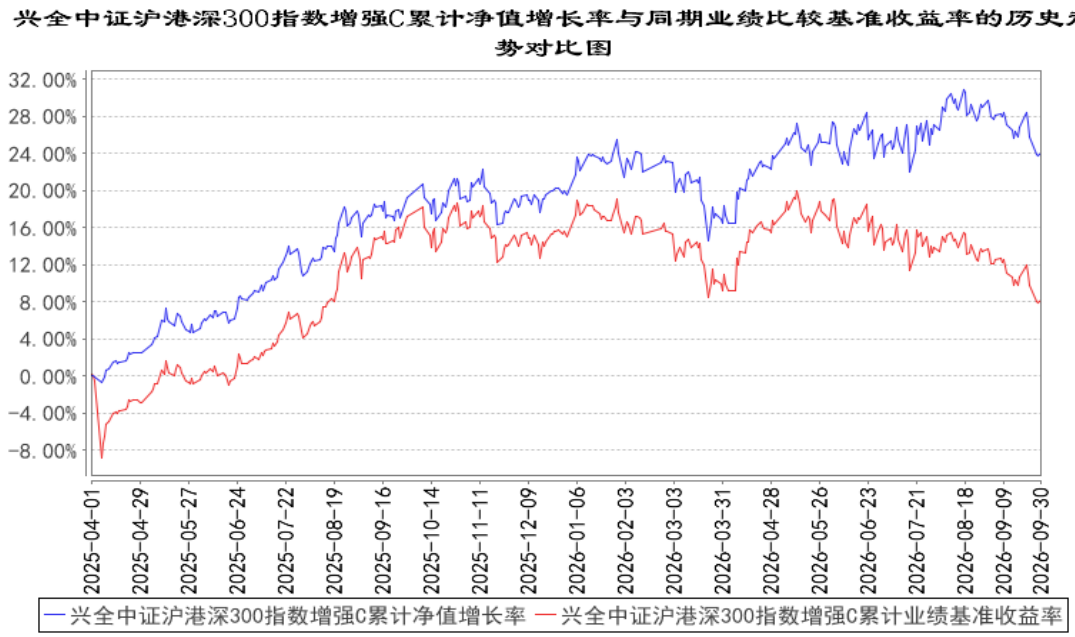
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-1.38%	1.05%	-7.01%	0.97%	5.63%	0.08%
过去六个月	6.69%	1.03%	-0.90%	1.02%	7.59%	0.01%
过去一年	4.47%	0.96%	-7.71%	0.96%	12.18%	0.00%
自基金合同生效起至今	24.79%	0.86%	8.21%	0.98%	16.58%	-0.12%

兴全中证沪港深 300 指数增强 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-1.48%	1.05%	-7.01%	0.97%	5.53%	0.08%
过去六个月	6.48%	1.03%	-0.90%	1.02%	7.38%	0.01%
过去一年	4.05%	0.96%	-7.71%	0.96%	11.76%	0.00%
自基金合同生效起至今	24.05%	0.86%	8.21%	0.98%	15.84%	-0.12%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





注：1、净值表现所取数据截至到 2026 年 09 月 30 日。

2、按照《兴全中证沪港深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》的规定，本基金建仓期为 2025 年 04 月 01 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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
田大伟	专户投资部总监助理兼投资经理、兴全红利量化选股股票型证券投资基金基金经理、兴全中证A500 指数增强型	2025 年 4 月 1 日	-	16 年	CFA，金融工程专业博士。历任光大保德信基金管理有限公司绝对收益部总监、基金经理；华鑫证券有限责任公司资产管理总部副总经理，兼任投资总监、资管量化投资部总经理和投资经理。

	证券投资基金基金经理、兴全中证沪港深 300 指数增强型证券投资基金基金经理、兴全中证沪港深 500 指数增强型证券投资基金基金经理、兴全中证 500 指数增强型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基金经理、兴全中证全指指数增强型发起式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。

4.1.1 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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间

田大伟	公募基金	7	2,007,300,124.31	2024 年 10 月 31 日
	私募资产管理计划	1	659,758,999.33	2024 年 5 月 10 日
	其他组合	-	-	-
	合计	8	2,667,059,123.64	-

注：任职日期为该基金经理首次任职基金经理和私募资产管理计划投资经理的日期。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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、《兴全中证沪港深 300 指数增强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 公平交易专项说明

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、考察是否存在非公平的因素。

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

进入 2026 年的 3 季度，市场从 8 月市场相对平稳过渡到 9 月中下旬以来的震荡向下，各类板块和风格时有表现。总体而言，成长风格承压较大，价值风格相对较优。我们的产品在风控上十分严格，不仅持仓贴近成份股，且行业和风格也做了严格的偏离限制，因此产品超额收益相对平稳。

面对不断变化的市场情况，我们观察到产品所用模型在价值等因子上的敞口呈现出较强的动

态适应性。无论是在年初价值占优期、4 月成长切换期，还是 7 月成长动能衰退期，模型均对价值等因子实施了相对准确的敞口调节。总体而言，我们在严格控制产品各类风格敞口的此过程中，模型仍会通过努力捕捉市场风格演变特征，在较小的风险预算框架内，对微小的风格敞口进行主动管理。这种基于模型自身研判的动态倾斜，使得策略能较好地抵御市场风格的剧烈波动，也能努力将其转化为组合稳定的超额收益。因此，我们对产品到年底保持较稳定超额收益是有信心的。

基于以上对市场分析，以及对沪港深 300 指数增强产品所用量化增强模型的了解，我们仍会在首选稳健性模型的同时积极应对。第一目标仍是跟上沪港深 300 指数，之后谋求超额。我们会在符合基金合同的情况下，继续维持大多数持仓来自成份股，在一定程度上维持行业和市值等风格的中性。同时我们也会在量化多因子的框架下，研究各行业和风格板块在量化因子上的载荷变化，择机适度进行行业和风格板块的偏离。在 2026 年 4 季度，在港股资产和 A 股资产大类上进行重点研究，继续迭代研发新模型，在不断迭代高频量价因子、机器学习类因子的同时，高度重视和积极运用基金重仓股因子、行业研究员一致预期因子、业绩超预期、成长类因子的研究和使用，储备和运用在某一类型资产聚集性表现时或者市场极涨极跌时相对稳健的模型，力争实现持续稳定的超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，兴全中证沪港深 300 指数增强 A 的基金份额净值为 1.2479 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.38%，同期业绩比较基准收益率为-7.01%；兴全中证沪港深 300 指数增强 C 的基金份额净值为 1.2405 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.48%，同期业绩比较基准收益率为-7.01%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	166,914,277.87	91.69
	其中：股票	166,914,277.87	91.69
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	10,213,000.00	5.61
	其中：债券	10,213,000.00	5.61
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,368,559.87	2.40
8	其他资产	541,840.17	0.30
9	合计	182,037,677.91	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 45,713,061.72 元，占净值比例 25.93%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	8,801,068.00	4.99
C	制造业	63,347,374.70	35.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,261,488.00	2.42
E	建筑业	619,971.00	0.35
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,754,137.00	2.13
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,215,580.07	3.53
J	金融业	29,041,554.00	16.48
K	房地产业	450,679.00	0.26
L	租赁和商务服务业	939,851.00	0.53
M	科学研究和技术服务业	2,694,174.00	1.53
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	120,125,876.77	68.15

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,589.30	0.00
C	制造业	1,049,677.38	0.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,072.70	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,075,339.38	0.61

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	1,229,386.20	0.70
非日常生活消费品	6,722,446.68	3.81
日常消费品	429,046.90	0.24
能源	2,755,004.56	1.56
金融	19,193,133.81	10.89
医疗保健	1,494,200.18	0.85
工业	1,827,875.78	1.04
信息技术	1,471,300.12	0.83
通信服务	7,440,982.00	4.22
公用事业	2,114,837.85	1.20
房地产	1,034,847.64	0.59
合计	45,713,061.72	25.93

注：以上分类采用财汇大智慧提供的国际通用行业分类标准。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	00700	腾讯控股	16,500	6,104,653.83	3.46
2	00005	汇丰控股	43,600	5,913,483.70	3.35
3	300308	中际旭创	6,400	5,174,016.00	2.94
4	09988	阿里巴巴-W	51,700	4,730,941.47	2.68
5	601899	紫金矿业	131,100	3,905,469.00	2.22
5	02899	紫金矿业	24,000	664,211.06	0.38
6	601398	工商银行	296,700	2,456,676.00	1.39
6	01398	工商银行	280,000	1,853,157.10	1.05
7	300750	宁德时代	13,800	4,017,318.00	2.28
8	601988	中国银行	353,100	2,376,363.00	1.35
8	03988	中国银行	245,000	1,279,754.00	0.73
9	000725	京东方 A	533,800	3,053,336.00	1.73
10	603986	兆易创新	8,500	3,008,150.00	1.71

注：上表中股票名称以报告期末名称为准。

对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688825	长鑫科技	25,161	972,472.65	0.55
2	688828	国仪公司	472	27,682.80	0.02
3	688801	燧原科技	70	23,072.70	0.01
4	688835	高凯技术	51	12,803.55	0.01
5	688836	宇树科技	37	11,774.14	0.01

注：上表中股票名称以报告期末名称为准。

对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,213,000.00	5.79
	其中：政策性金融债	10,213,000.00	5.79
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	10,213,000.00	5.79

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	220203	22 国开 03	100,000	10,213,000.00	5.79

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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。本基金在股指期货投资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，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货以套期保值为目的，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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货，故此项不适用。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	120,872.63
4	应收利息	-
5	应收申购款	420,967.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	541,840.17

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688825	长鑫科技	972,472.65	0.55	新股流通受限
2	688828	国仪公司	27,682.80	0.02	新股流通受限
3	688801	燧原科技	23,072.70	0.01	新股流通受限
4	688835	高凯技术	12,803.55	0.01	新股流通受限

5	688836	宇树科技	11,774.14	0.01	新股流通受限

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	兴全中证沪港深 300 指数增强 A	兴全中证沪港深 300 指数增强 C
报告期期初基金份额总额	26,130,299.61	111,511,828.93
报告期期间基金总申购份额	6,644,035.49	35,866,743.17
减:报告期期间基金总赎回份额	2,880,732.45	35,351,470.99
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	29,893,602.65	112,027,101.11

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	兴全中证沪港深 300 指数增强 A	兴全中证沪港深 300 指数增强 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	13,836,715.87	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	13,836,715.87	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	46.29	-

注：1、申购份额包括红利再投、转换入份额、因份额拆分而增加的份额；赎回份额包括转换出份额、因份额合并而减少的份额。

2、“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。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本基金管理人本报告期未运用固有资金对本基金进行交易。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
机构	-	-	-	-	-	-	-
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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予基金募集注册的文件；

2、《兴全中证沪港深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》；

3、《兴全中证沪港深 300 指数增强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。

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

9.3 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 10 月 27 日