兴全绿色投资混合型证券投资基金
（LOF）
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遵规守信情况的说明 9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
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 10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 11
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 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 12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 12
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 12
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 12
§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 15
6.4 报表附注 18
§7 投资组合报告 40
7.1 期末基金资产组合情况 40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 40
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 41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 44
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 45
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 45

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 45
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 45
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 45
7.12 投资组合报告附注 45
§8 基金份额持有人信息 46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 46
8.2 盈利投资者数量占比 46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 46
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 46
§9 开放式基金份额变动 47
§10 重大事件揭示 47
10.1 基金份额持有人大会决议 47
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 47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 47
10.4 基金投资策略的改变 47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 47
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 47
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 48
10.8 其他重大事件 49
§11 影响投资者决策的其他重要信息 49
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 49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 49
§12 备查文件目录 49
12.1 备查文件目录 49
12.2 存放地点 50
12.3 查阅方式 50

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）
基金简称	兴全绿色投资混合（LOF）
场内简称	兴全绿色 LOF
基金主代码	163409
前端交易代码	163409
后端交易代码	163410
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2011 年 5 月 6 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	1,149,242,461.90 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011 年 7 月 7 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过挖掘绿色科技产业或公司，以及其他产业中积极履行环境责任公司的投资机会，力争实现当期投资收益与长期资本增值。
投资策略	本基金在大类资产配置上，采取定性与定量研究相结合，在股票与债券等资产类别之间进行资产配置。在宏观与微观层面对各类资产的价值增长能力展开综合评估，动态优化资产配置。在运用“绿色投资筛选策略”的基础上，采用环境因子与公司财务等基本面因子相结合，进行综合评估筛选，对那些表现相对突出的公司予以优先考虑。
业绩比较基准	80%×中证兴业证券 ESG 盈利 100 指数收益率＋20%×中证国债指数收益率
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期风险、中高预期收益的基金产品。投资者可在二级市场买卖基金份额，受市场供需关系等各种因素的影响，投资者买卖基金份额有可能面临相应的折溢价风险。

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	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	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、基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§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	432,835,716.16
本期利润	235,452,453.94
加权平均基金份额本期利润	0.1746
本期加权平均净值利润率	10.77%
本期基金份额净值增长率	10.62%
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	730,562,087.36
期末可供分配基金份额利润	0.6357
期末基金资产净值	1,879,804,549.26
期末基金份额净值	1.636
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	381.67%

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

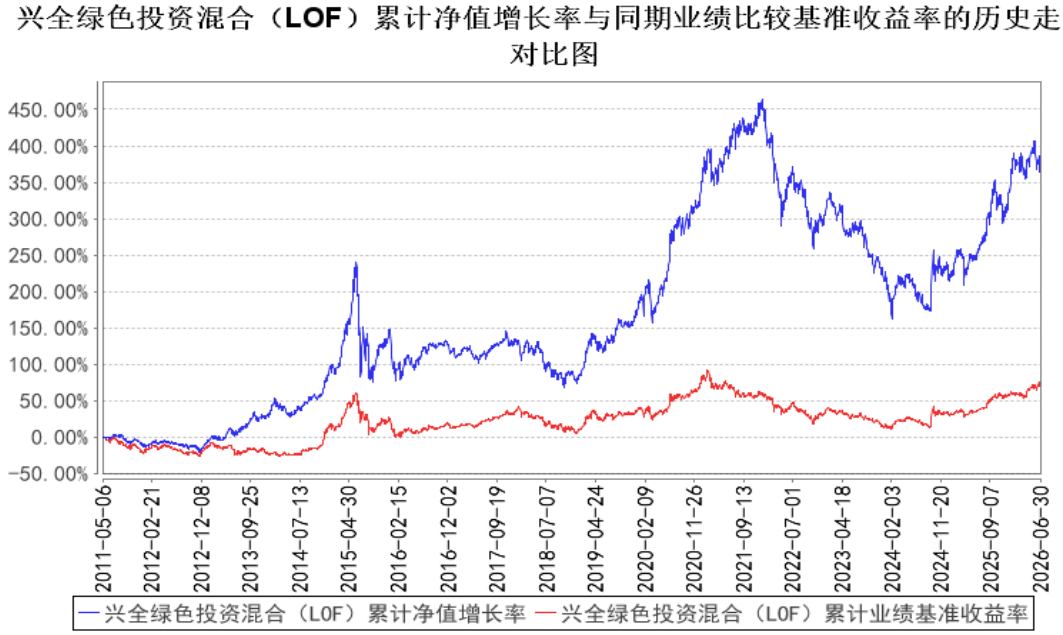
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	4.67%	1.26%	11.71%	1.04%	-7.04%	0.22%
过去六个月	10.62%	1.30%	9.53%	0.93%	1.09%	0.37%
过去一年	34.10%	1.30%	26.35%	0.83%	7.75%	0.47%
过去三年	23.47%	1.36%	35.22%	0.88%	-11.75%	0.48%
过去五年	-6.16%	1.30%	1.20%	0.90%	-7.36%	0.40%
过去七年	107.20%	1.30%	33.18%	0.94%	74.02%	0.36%
过去十年	123.88%	1.26%	59.23%	0.93%	64.65%	0.33%
自基金合同生效起至今	381.67%	1.42%	73.27%	1.08%	308.40%	0.34%

注：1、本基金业绩比较基准为 80%×中证兴业证券 ESG 盈利 100 指数收益率＋20%×中证国债指数收益率，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。

2、本基金原业绩比较基准为：80%×沪深 300 指数收益率＋20%×中证国债指数收益率，修改后的业绩比较基准为：80%×中证兴业证券 ESG 盈利 100 指数收益率＋20%×中证国债指数收益率，修改后的业绩比较基准生效日为 2020 年 9 月 10 日。

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



注：1、净值表现所取数据截至到 2026 年 06 月 30 日。

2、按照《兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）基金合同》的规定，本基金建仓期为 2011 年 5 月 6 日至 2011 年 8 月 5 日。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投资组合的比例范围。

3、本基金原业绩比较基准为：80%×沪深 300 指数收益率＋20%×中证国债指数收益率，修改后的业绩比较基准为:80%×中证兴业证券 ESG 盈利 100 指数收益率＋20%×中证国债指数收益率，修改后的业绩比较基准生效日为 2020 年 9 月 10 日。

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“兴业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		
邹欣	兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）、兴证全球创新优势混合型证券投资基金基金经理	2017 年 6 月 29 日	-	17 年	硕士，历任富国基金管理有限公司研究员，泰达宏利基金管理有限公司研究员，兴证全球基金管理有限公司研究员、兴全社会责任混合型证券投资基金基金经理助理、兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理、研究部总监助理。
孟维维	本基金的基金助理	2025 年 2 月 12 日	2026 年 6 月 15 日	11 年	硕士。历任兴业证券股份有限公司研究员，广发基金管理有限公司研究员，兴证全球基金管理有限公司研究员。现任兴全绿色投资混合型证券投资基金基金经理助理。

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、《兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）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 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

26 年中本基金的相对收益略逊于我们自身的期望，一方面在 5 月中时我们已经发现非常多的股票价格远超出了合理的估值区间，隐含的预期过于乐观而实际上科技发展从来不是一帆风顺，我们认为应该克制追涨的欲望，将组合结构转向防守，提前留出的仓位较好的应对了后续的下跌和赎回。然而另一方面，不如人意之处在于我们配置较多的储能和保险行业，分别遭遇了一些外生因素，例如美国联邦通信委员会对外国逆变器的禁令。经过对组合标的公司尽可能扎实的研究分析工作，站在这个时点展望未来 3 年，我们对超配公司有相对较好的价值表现的确定性仍有很强的信心。

25 年的年报中提到在理论构建工作之后，26 年我们的主要工作是纳入 AI Agent 的使用和更多的算力，实现基础工作的自动化以解放更多的生产力到研究中去，并探索复合策略的定义和使用，下面做一些汇报。

1. 在 LLM 和一些新的数据库工具的帮助下，我们不仅整合了过去 3 年散落的研究资料，还显著扩大了研究基础，过去 3 个月整合的有效内容超过过去 3 年的积累量。

2. LLM 仍然是个等权概率系统，在使用过程中我们打磨了一些争取不会被大模型吞噬的 skill，目前来看效果在快速提升。

3. 我们现在很容易得到股价、市场预期之间的表面关系，但是如何得到深层次的真实关系、得到我们自己基于产业规律的预期，仍然是需要构建的部分。

4. 研究资料的质量通常和频率成反比，如何保证足够比例的产业规律型的认知进入我们的投资框架并且赋以足够多的思考，是下半年的主要工作。

本基金投资策略将在未来较长时间内稳定如下：

1. 以布局产业升级的优质公司为主线。

2. 以产业周期和驱动要素认知为组合参数。

3. 深入认知产业规律构建核心标的。

必须说明的是，基金的相对收益仍然受到我们研究效率、资源的供给、宏观周期的影响，很多时候即使我们的行业配置思路指向了某个行业，但如果我们对企业的认知只是达到市场共识的水平，或者有足够投资价值的标的不在可投资市场，这样的研究依然不太会转化出组合中重仓配置的标的，我们一定不会为了投而投某些方向。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，兴全绿色投资混合（LOF）的基金份额净值为 1.636 元，本报告期基金份额净值增长率为 10.62%，同期业绩比较基准收益率为 9.53%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

写下本次半年报的时候，全球的科技股都在过去一个月经历了史上少有的下跌速度，分歧的声音集中在未来 1 年左右的问题上。我们认为从股票的角度来说，很多公司的股价目前仍然锚定的是 28 年以及之后的预期，这样的股价风险仍然偏高。

关于未来 AI 如何发展的问题，人类目前无论对宇宙、海洋、生命的了解都还没有达到 1 级文明的层次，想要仅通过汇总人类历史形成的数字资产就通向 AGI，成功的概率不会太高。

但是即使不通向 AGI，LLM 的工具价值仍然可以比肩搜索引擎和印刷术，假以时日，社会价值和产业价值足够对全球经济发展产生明显推动作用。但是我们必须意识到，对工具型的技术来说，过高的硬件价格从来都是技术发展和产业良性生态的阻碍，在未来 2 年的过程里，产业发展重点从硬件向软件、系统的迁移是我们最关注的投资机会，但是 A 股的产业结构中相关公司目前还偏少，可能会限制我们的投资。

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》、《兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）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：兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）

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	165,142,977.84	135,921,755.47
结算备付金		2,867,907.29	8,852,085.88
存出保证金		994,508.71	1,429,580.76
交易性金融资产	6.4.7.2	1,720,729,395.50	2,101,656,222.57
其中：股票投资		1,620,658,025.64	1,960,526,365.04
基金投资		-	-
债券投资		100,071,369.86	141,129,857.53
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		1,112,190.66	34,375,027.51
应收股利		-	-
应收申购款		232,137.27	184,696.94
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,891,079,117.27	2,282,419,369.13
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		-	-
应付赎回款		8,122,376.92	8,502,362.25

应付管理人报酬		1,900,127.71	2,255,382.98
应付托管费		316,687.95	375,897.14
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2,305.86	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	933,069.57	2,869,169.83
负债合计		11,274,568.01	14,002,812.20
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	1,149,242,461.90	1,534,109,653.40
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	730,562,087.36	734,306,903.53
净资产合计		1,879,804,549.26	2,268,416,556.93
负债和净资产总计		1,891,079,117.27	2,282,419,369.13

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.636 元，基金份额总额 1,149,242,461.90 份。

6.2 利润表

会计主体：兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）

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		250,762,065.34	241,843,293.51
1.利息收入		312,259.91	318,927.11
其中：存款利息收入	6.4.7.13	312,259.91	318,927.11
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		447,661,786.88	205,968,487.77
其中：股票投资收益	6.4.7.14	431,347,913.59	189,817,983.39
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	1,053,903.05	1,390,230.52
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	15,259,970.24	14,760,273.86
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	-197,383,262.22	35,472,363.76
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	171,280.77	83,514.87
减：二、营业总支出		15,309,611.40	18,989,394.41
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	13,022,191.13	16,174,543.78
其中：暂估管理人报酬		-	-
2．托管费	6.4.10.2.2	2,170,365.13	2,695,757.31
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		247.06	-
8．其他费用	6.4.7.23	116,808.08	119,093.32
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		235,452,453.94	222,853,899.10
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		235,452,453.94	222,853,899.10
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		235,452,453.94	222,853,899.10

6.3 净资产变动表

会计主体：兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）

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	1,534,109,653.40	-	734,306,903.53	2,268,416,556.93
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,534,109,653.40	-	734,306,903.53	2,268,416,556.93
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-384,867,191.50	-	-3,744,816.17	-388,612,007.67
（一）、综合收益总额	-	-	235,452,453.94	235,452,453.94
（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）	-384,867,191.50	-	-239,197,270.11	-624,064,461.61
其中：1.基金申购款	86,832,133.96	-	53,489,131.59	140,321,265.55
2.基金赎回款	-471,699,325.46	-	-292,686,401.70	-764,385,727.16
（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	1,149,242,461.90	-	730,562,087.36	1,879,804,549.26

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	2,490,540,517.45	-	312,198,552.66	2,802,739,070.11

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,490,540,517.45	-	312,198,552.66	2,802,739,070.11
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-254,067,840.42	-	180,397,408.72	-73,670,431.70
（一）、综合收益总额	-	-	222,853,899.10	222,853,899.10
（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）	-254,067,840.42	-	-42,456,490.38	-296,524,330.80
其中：1.基金申购款	32,665,034.86	-	4,991,764.61	37,656,799.47
2.基金赎回款	-286,732,875.28	-	-47,448,254.99	-334,181,130.27
（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	2,236,472,677.03	-	492,595,961.38	2,729,068,638.41

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	詹鸿飞	詹鸿飞
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

兴全绿色投资混合型证券投资基金(LOF)(原名兴全绿色投资股票型证券投资基金(LOF))(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”)证监许可[2011]241号《关于核准兴全绿色投资股票型证券投资基金(LOF)募集的批复》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《兴全绿色投资股票型证券投资基金(LOF)基金合同》(以下简称“基金合同”)向社会公开募集，基金合同于 2011 年 5 月 6 日正式生效，首次设立募集规模为 2,022,398,091.00 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为兴证全球基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。本基金于 2015 年 8 月 7 日起更名为兴全绿色投资混合型证券投资基金(LOF)。

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括依法公开发行上市的股票及存托凭证(包括创业板、中小板以及其他经中国证监会批准上市的股票及存托凭证)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具(但需符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金为混合型基金，股票投资比例为基金资产的 60%-95%，其中，符合绿色投资理念的股票合计投资比例不低于股票资产的 80%；债券投资比例为基金资产的 5%-40%，其中本基金保留不低于基金资产净值的 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券；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%×中证兴业证券 ESG 盈利 100 指数收益率+20%×中证国债指数收益率。

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	165,142,977.84
等于：本金	165,127,223.22
加：应计利息	15,754.62
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	165,142,977.84

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		1,609,540,138.71	-	1,620,658,025.64	11,117,886.93
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	99,933,800.00	141,369.86	100,071,369.86	-3,800.00
	合计	99,933,800.00	141,369.86	100,071,369.86	-3,800.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,709,473,938.71	141,369.86	1,720,729,395.50	11,114,086.93

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	2,312.79
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	837,454.22
其中：交易所市场	837,054.22
银行间市场	400.00
应付利息	-
预提费用	93,302.56
合计	933,069.57

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	1,534,109,653.40	1,534,109,653.40
本期申购	86,832,133.96	86,832,133.96
本期赎回（以“-”号填列）	-471,699,325.46	-471,699,325.46
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	1,149,242,461.90	1,149,242,461.90

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	517,821,796.83	216,485,106.70	734,306,903.53
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	517,821,796.83	216,485,106.70	734,306,903.53
本期利润	432,835,716.16	-197,383,262.22	235,452,453.94
本期基金份额交易产生的变动数	-217,738,685.23	-21,458,584.88	-239,197,270.11
其中：基金申购款	46,912,299.88	6,576,831.71	53,489,131.59
基金赎回款	-264,650,985.11	-28,035,416.59	-292,686,401.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	732,918,827.76	-2,356,740.40	730,562,087.36

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	301,058.78
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	8,587.03
其他	2,614.10
合计	312,259.91

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	431,347,913.59

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	431,347,913.59

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	3,737,887,011.77
减：卖出股票成本总额	3,301,153,842.10
减：交易费用	5,385,256.08
买卖股票差价收入	431,347,913.59

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	914,648.05
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	139,255.00
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	1,053,903.05

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	142,059,879.45
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	139,860,345.00
减：应计利息总额	2,059,879.45
减：交易费用	400.00
买卖债券差价收入	139,255.00

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	15,259,970.24
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	15,259,970.24

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	-197,383,262.22
股票投资	-197,323,807.22
债券投资	-59,455.00
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	-197,383,262.22

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	166,873.36
基金转换费收入	4,407.41
合计	171,280.77

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	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	13,905.52
账户维护费用	18,000.00
其他	600.00

合计	116,808.08

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、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	1,480,430,794.73	21.47	1,842,397,468.70	11.81

6.4.10.1.2 债券交易

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债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

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	660,120.65	21.47	344,262.25	41.13
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	821,531.21	11.81	184,810.19	5.30

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	13,022,191.13	16,174,543.78
其中：应支付销售机构的客户维护费	4,800,241.30	4,939,067.54
应支付基金管理人的净管理费	8,221,949.83	11,235,476.24

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	2,170,365.13	2,695,757.31

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

份额单位：份

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
基金合同生效日（2011 年 5 月 6 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	24,593,765.87	24,593,765.87
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	24,593,765.87	-
报告期末持有的基金份额	-	24,593,765.87
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-%	1.0997%

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	165,142,977.84	301,058.78	212,760,822.07	298,915.66

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

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

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
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	-
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新股流通受限	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新股流通	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-

				受限						
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	-
301669	高特电子	2026 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	-
301682	宏明电子	2026 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	-
301696	三瑞智能	2026 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	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-
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	-

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	-
688765	禾元生物	2025 年 10 月 16 日	9 个月	新股流通受限	29.06	48.56	16,470	478,618.20	799,783.20	-
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	2026 年 6	6 个月	新股	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-

	科技	月 16 日		流通受限						
688802	沐曦股份	2025 年 12 月 9 日	9 个月	新股流通受限	104.66	768.89	3,994	418,012.04	3,070,946.66	-
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	有研复材	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	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
688820	盛合晶微	2026 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

注：本基金本报告期末及上年度末均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

本基金为上市契约型开放式（LOF）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	165,142,977.84	-	-	-	-	-	165,142,977.84
结算备付金	2,867,907.29	-	-	-	-	-	2,867,907.29
存出保证金	994,508.71	-	-	-	-	-	994,508.71
交易性金融资产	-	-	100,071,369.86	-	-	1,620,658,025.64	1,720,729,395.50
应收申购款	13,405.46	-	-	-	-	218,731.81	232,137.27
应收清算款	-	-	-	-	-	1,112,190.66	1,112,190.66
资产总计	169,018,799.30	-	100,071,369.86	-	-	1,621,988,948.11	1,891,079,117.27
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	8,122,376.92	8,122,376.92
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,900,127.71	1,900,127.71
应付托管费	-	-	-	-	-	316,687.95	316,687.95
应交税费	-	-	-	-	-	2,305.86	2,305.86
其他负债	-	-	-	-	-	933,069.57	933,069.57
负债总计	-	-	-	-	-	11,274,568.01	11,274,568.01
利率敏感度缺口	169,018,799.30	-	100,071,369.86	-	-	1,610,714,380.10	1,879,804,549.26
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	135,921,755.47	-	-	-	-	-	135,921,755.47

结算备付金	8,852,085.88	-	-	-	-	-	8,852,085.88
存出保证金	1,429,580.76	-	-	-	-	-	1,429,580.76
交易性金融资产	-	-	141,129,857.53	-	-	1,960,526,365.04	2,101,656,222.57
应收申购款	4,794.35	-	-	-	-	179,902.59	184,696.94
应收清算款	-	-	-	-	-	34,375,027.51	34,375,027.51
资产总计	146,208,216.46	-	141,129,857.53	-	-	1,995,081,295.14	2,282,419,369.13
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	8,502,362.25	8,502,362.25
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,255,382.98	2,255,382.98
应付托管费	-	-	-	-	-	375,897.14	375,897.14
其他负债	-	-	-	-	-	2,869,169.83	2,869,169.83
负债总计	-	-	-	-	-	14,002,812.20	14,002,812.20
利率敏感度缺口	146,208,216.46	-	141,129,857.53	-	-	1,981,078,482.94	2,268,416,556.93

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%	895,055.02	619,609.61
	市场利率上升 1%	-879,302.06	-614,169.68

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	1,620,658,025.64	86.21	1,960,526,365.04	86.43
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	100,071,369.86	5.32	141,129,857.53	6.22
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	1,720,729,395.50	91.54	2,101,656,222.57	92.65

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	209,564,178.21	376,613,008.84

	10%		
	业绩比较基准下降 10%	-209,564,178.21	-376,613,008.84

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	1,615,447,718.67	1,917,498,760.09
第二层次	100,071,369.86	141,129,857.53
第三层次	5,210,306.97	43,027,604.95
合计	1,720,729,395.50	2,101,656,222.57

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	1,620,658,025.64	85.70
	其中：股票	1,620,658,025.64	85.70
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	100,071,369.86	5.29
	其中：债券	100,071,369.86	5.29
	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	168,010,885.13	8.88
8	其他各项资产	2,338,836.64	0.12
9	合计	1,891,079,117.27	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	36,149.82	0.00
C	制造业	1,261,960,667.80	67.13
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	13,704,414.00	0.73
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	96,156,845.92	5.12
J	金融业	164,839,866.86	8.77
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	83,960,081.24	4.47
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	1,620,658,025.64	86.21

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	605117	德业股份	1,225,868	130,162,664.24	6.92
2	300763	锦浪科技	1,286,455	116,231,209.25	6.18
3	300274	阳光电源	697,697	110,947,776.94	5.90
4	601318	中国平安	2,017,189	96,300,602.86	5.12
5	000100	TCL 科技	15,237,900	88,684,578.00	4.72
6	300502	新易盛	142,660	86,594,620.00	4.61
7	300750	宁德时代	215,434	84,667,716.34	4.50
8	603259	药明康德	674,324	83,960,081.24	4.47
9	603997	继峰股份	6,951,410	82,235,180.30	4.37
10	300308	中际旭创	56,600	71,882,000.00	3.82
11	601601	中国太保	2,403,200	68,539,264.00	3.65
12	002624	完美世界	5,082,800	63,128,376.00	3.36
13	605016	百龙创园	2,263,237	58,504,676.45	3.11
14	002648	卫星化学	2,440,033	57,316,375.17	3.05
15	603638	艾迪精密	2,201,228	51,618,796.60	2.75
16	300373	扬杰科技	291,300	45,801,099.00	2.44
17	600426	华鲁恒升	1,736,516	41,537,462.72	2.21
18	688506	百利天恒	134,294	39,486,464.82	2.10

19	600519	贵州茅台	32,220	38,196,487.80	2.03
20	688281	华秦科技	724,405	36,386,863.15	1.94
21	002466	天齐锂业	533,800	32,732,616.00	1.74
22	000902	新洋丰	2,233,302	25,816,971.12	1.37
23	002364	中恒电气	370,200	19,916,760.00	1.06
24	600589	大位科技	1,919,208	19,652,689.92	1.05
25	688036	传音控股	319,265	18,820,671.75	1.00
26	603353	和顺石油	356,700	13,704,414.00	0.73
27	000997	新 大 陆	820,600	13,375,780.00	0.71
28	300593	新雷能	343,500	10,325,610.00	0.55
29	000936	华西股份	1,613,900	8,553,670.00	0.46
30	688802	沐曦股份	3,994	3,070,946.66	0.16
31	688765	禾元生物	16,470	799,783.20	0.04
32	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.02
33	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.01
34	301045	天禄科技	2,300	204,884.00	0.01
35	688809	强一股份	259	161,357.00	0.01
36	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.01
37	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.01
38	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.01
39	688781	视涯科技	1,300	61,893.00	0.00
40	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
41	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
42	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
43	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
44	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
45	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
46	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
47	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
48	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
49	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
50	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
51	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
52	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
53	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
54	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
55	603293	埃泰克	72	2,442.96	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	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)

	码			
1	300763	锦浪科技	132,920,828.44	5.86
2	601601	中国太保	128,276,886.00	5.65
3	002463	沪电股份	95,422,211.94	4.21
4	300750	宁德时代	93,822,919.40	4.14
5	605117	德业股份	92,639,112.24	4.08
6	600426	华鲁恒升	92,160,136.29	4.06
7	002624	完美世界	90,768,023.00	4.00
8	300475	香农芯创	82,752,972.26	3.65
9	000100	TCL 科技	77,393,578.00	3.41
10	300408	三环集团	71,205,058.80	3.14
11	603360	百傲化学	69,518,078.60	3.06
12	300274	阳光电源	69,010,829.53	3.04
13	002648	卫星化学	68,343,269.93	3.01
14	300502	新易盛	66,955,170.41	2.95
15	688281	华秦科技	65,609,161.04	2.89
16	300347	泰格医药	65,563,293.98	2.89
17	603259	药明康德	65,042,660.96	2.87
18	002928	华夏航空	61,545,771.83	2.71
19	603179	新泉股份	59,251,202.08	2.61
20	605016	百龙创园	58,064,517.40	2.56
21	300593	新雷能	54,300,051.50	2.39
22	603638	艾迪精密	53,887,239.06	2.38
23	688052	纳芯微	48,406,767.54	2.13
24	600522	中天科技	47,855,991.50	2.11
25	000811	冰轮环境	47,562,214.40	2.10
26	002460	赣锋锂业	47,021,681.30	2.07
27	301358	湖南裕能	46,891,823.59	2.07
28	600989	宝丰能源	46,482,332.00	2.05
29	300308	中际旭创	45,463,950.00	2.00
30	600938	中国海油	45,372,120.84	2.00

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	688525	佰维存储	195,314,491.78	8.61
2	300442	润泽科技	172,482,489.42	7.60
3	002384	东山精密	157,479,728.30	6.94
4	688472	阿特斯	114,778,668.42	5.06
5	300750	宁德时代	94,722,656.20	4.18
6	000977	浪潮信息	91,616,229.65	4.04
7	002463	沪电股份	89,624,279.90	3.95

8	001389	广合科技	85,790,339.00	3.78
9	603179	新泉股份	82,603,685.94	3.64
10	300408	三环集团	78,812,441.38	3.47
11	301550	斯菱智驱	75,740,984.15	3.34
12	301358	湖南裕能	73,767,736.02	3.25
13	605376	博迁新材	71,705,758.18	3.16
14	300347	泰格医药	68,890,024.06	3.04
15	002928	华夏航空	66,662,450.63	2.94
16	300475	香农芯创	65,818,846.57	2.90
17	300863	卡倍亿	63,367,052.45	2.79
18	603920	世运电路	62,175,778.33	2.74
19	000811	冰轮环境	57,748,170.90	2.55
20	002202	金风科技	55,432,617.72	2.44
21	002460	赣锋锂业	53,422,909.40	2.36
22	600522	中天科技	52,823,842.00	2.33
23	300593	新雷能	52,656,959.50	2.32
24	002150	正泰电源	49,410,582.00	2.18
25	605111	新洁能	47,171,954.82	2.08

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	3,158,609,309.92
卖出股票收入（成交）总额	3,737,887,011.77

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	100,071,369.86	5.32
	其中：政策性金融债	100,071,369.86	5.32
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	100,071,369.86	5.32

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	260304	26 进出 04	1,000,000	100,071,369.86	5.32

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，中国进出口银行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	994,508.71
2	应收清算款	1,112,190.66
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	232,137.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,338,836.64

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

注：本基金本报告期末前十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

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（%）
112,753	10,192.57	60,629,054.63	5.28	1,088,613,407.27	94.72

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（%）	98.65

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	969,437.43	0.0844

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	50~100

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011 年 5 月 6 日）基金份额总额	2,022,398,091.00
本报告期期初基金份额总额	1,534,109,653.40
本报告期基金总申购份额	86,832,133.96
减：本报告期基金总赎回份额	471,699,325.46
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,149,242,461.90

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(%)	
中信证券	2	2,552,082,209.10	37.02	1,137,966.27	37.02	-
兴业证券	3	1,480,430,794.73	21.47	660,120.65	21.47	-
野村证券	1	1,292,152,972.01	18.74	576,173.75	18.74	-
瑞银证券	2	1,164,698,848.31	16.89	519,352.03	16.89	-
国海证券	1	305,184,551.32	4.43	136,081.10	4.43	-
光大证券	2	100,031,869.18	1.45	44,604.67	1.45	-

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(%)
中信证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
野村证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-

国海证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-

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	关于旗下部分基金暂停直销渠道后端申购业务的公告	中国证券报、指定互联网网站	2026 年 1 月 23 日
2	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	中国证券报、指定互联网网站	2026 年 1 月 26 日
3	兴证全球基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、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）	中国证券报、指定互联网网站	2026 年 3 月 30 日
5	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	-	-	-	-	-	-	-
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

投资者可在二级市场买卖本基金基金份额，受市场供需关系等各种因素的影响，投资者买卖基金份额有可能面临相应的折溢价风险。

§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、《兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；

3、《兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）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