兴全轻资产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：招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。

基金托管人招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 9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 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 10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 11
§5 托管人报告 11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 11
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） 12
6.1 资产负债表 12
6.2 利润表 13
6.3 净资产变动表 14
6.4 报表附注 17
§7 投资组合报告 41
7.1 期末基金资产组合情况 41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 41
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 42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 47
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 47
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 47

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 47
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 47
7.12 投资组合报告附注 48

§8 基金份额持有人信息 49

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 49
8.2 盈利投资者数量占比 49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 49
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 49

§9 开放式基金份额变动 49

§10 重大事件揭示 49

10.1 基金份额持有人大会决议 49
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 50
10.4 基金投资策略的改变 50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 50
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 50
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 50
10.8 其他重大事件 53

§11 影响投资者决策的其他重要信息 53

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 54

§12 备查文件目录 54

12.1 备查文件目录 54
12.2 存放地点 54
12.3 查阅方式 54

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）
基金简称	兴全轻资产混合（LOF）
场内简称	兴全轻资产 LOF
基金主代码	163412
前端交易代码	163412
后端交易代码	163413
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2012 年 4 月 5 日
基金管理人	兴证全球基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	648,090,027.48 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	2012 年 5 月 31 日

注：本基金场内扩位简称：兴全轻资产 LOF。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以挖掘“轻资产公司”为主要投资策略，力求获取当前收益及实现长期资本增值。
投资策略	在大类资产配置上，本基金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；本基金运用多重指标因子，综合评估判断，选择优秀的轻资产公司进行投资；在行业配置上，积极配置于那些在产品、服务以及业务属性上具有轻资产特征的行业。
业绩比较基准	80%×沪深 300 指数＋20%×中证国债指数
风险收益特征	本基金为混合型基金产品，属于较高风险、较高收益的基金品种，其预期风险收益水平高于债券型基金及货币市场基金。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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨卫东	张姗
	联系电话	021-20398888	400-61-95555
	电子邮箱	yangwd@xqfunds.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4006780099，021-38824536	400-61-95555
传真		021-20398988	0755-83195201

注册地址	上海市黄浦区金陵东路 368 号	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	201204	518040
法定代表人	庄园芳	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	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	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	975,769,153.41
本期利润	1,270,783,110.48
加权平均基金份额本期利润	1.7026
本期加权平均净值利润率	46.33%
本期基金份额净值增长率	57.18%
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	1,846,424,006.36
期末可供分配基金份额利润	2.8490
期末基金资产净值	3,168,861,446.54
期末基金份额净值	4.890
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	969.93%

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

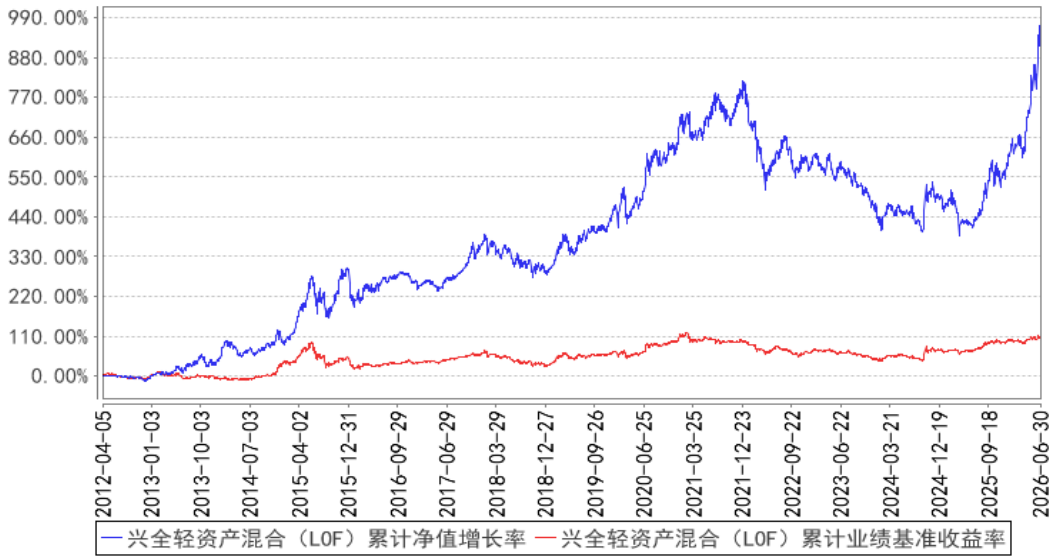
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	49.54%	2.04%	9.75%	1.01%	39.79%	1.03%
过去六个月	57.18%	1.80%	6.53%	0.91%	50.65%	0.89%
过去一年	101.73%	1.66%	21.11%	0.81%	80.62%	0.85%
过去三年	58.20%	1.40%	27.28%	0.88%	30.92%	0.52%
过去五年	26.85%	1.34%	2.02%	0.89%	24.83%	0.45%
过去七年	126.05%	1.34%	33.82%	0.93%	92.23%	0.41%
过去十年	195.03%	1.28%	60.01%	0.91%	135.02%	0.37%
自基金合同生效起至今	969.93%	1.50%	108.30%	1.07%	861.63%	0.43%

注：本基金业绩比较基准为 80%×沪深 300 指数＋20%×中证国债指数，是根据基金合同中投资策略及资产配置比例等相关规定构建，能够较好地反映本基金的风险收益特征。本基金每个交易日对业绩比较基准依据合同约定的权重比例进行再平衡处理，并用每日连乘方式计算得到指数基准的时间序列。

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

兴全轻资产混合（LOF）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《兴全轻资产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 2012 年 04 月 05 日起共计六个月。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

3.3 其他指标

注：无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

兴证全球基金管理有限公司（成立时名为“兴业基金管理有限公司”，以下简称“公司”）经证监基字[2003]100 号文批准于 2003 年 9 月 30 日成立。2008 年 1 月，中国证监会批复（证监许可[2008]6 号），同意全球人寿保险国际公司（AEGON International B.V）受让公司股权并成为公司股东。2008 年 4 月 9 日，公司完成股权转让、变更注册资本等相关手续后，公司注册资本由 9800 万元变更为人民币 1.2 亿元，其中兴业证券股份有限公司的出资占注册资本的 51%，全球人寿保险国际公司的出资占注册资本的 49%。2008 年 7 月，经中国证监会批准（证监许可[2008]888 号），公司于 2008 年 8 月 25 日完成变更公司名称、注册资本等相关手续后，公司名称变更为“兴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		
程剑	兴全品质甄选混合型证券投资基金、兴全轻资产投资混合型证券投资基金	2025 年 12 月 22 日	-	12 年	硕士。历任万向集团有限公司项目经理、涛石股权投资管理（上海）有限公司投资经理、中国国际金融有限公司研究员，兴证全球基金管理有限公司研究员、基金经理助理、兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理。

	（LOF）基金经理				
董理	研究部副总监、兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理	2017 年 11 月 23 日	2026 年 1 月 20 日	17 年	博士，历任国信智能有限公司技术部系统工程师，嘉实基金管理有限公司分析师、基金经理，华夏久盈资产管理有限公司投资经理，兴证全球基金管理有限公司兴全社会责任混合型证券投资基金基金经理、兴全多维价值混合型证券投资基金基金经理、兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理。
潘博众	本基金的基金助理	2025 年 2 月 12 日	-	8 年	硕士，历任 Korea Investment 研究员，中庚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部研究员。

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、《兴全轻资产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

2026 年上半年 A 股市场呈现震荡上行但结构分化显著加剧的特征，成长风格明显占优，资金持续向 AI 产业链及科技龙头集中，价值、红利及传统周期风格相对落后。从整体经济环境来看，国内经济仍处于温和修复阶段，出口和基建继续提供支撑，但内需修复基础仍不牢固，政策层面延续适度宽松与结构性托底思路，未出现大规模总量强刺激。海外方面，一季度底中东地缘冲突和油价高位一度推升市场对滞胀的担忧，但二季度随着地缘扰动边际缓和以及油价逐渐回落，市场对战争冲击的敏感度明显下降。

报告期内，本基金整体持仓水平保持相对较高水位，整体组合配置方向和思路保持了一定延续性，组合结构上二季度持仓相比一季度更加集中。资产类别上在保持稳健增长和趋势增长类资产占比较较高，尤其是国内 AI 产业链和海外 AI 产业链、新能源、创新药等板块资产占比相对较高，整体收益和风险控制实现了本基金预计的目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，兴全轻资产混合（LOF）的基金份额净值为 4.890 元，本报告期基金份额净值增长率为 57.18%，同期业绩比较基准收益率为 6.53%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，市场在经历今年二季度相对极致的 AI 行情后，无论是板块间的涨跌幅或者交易量占比分化程度来看，下半年在 AI 领域的投资可能存在较大波动可能，尤其是前期涨幅较大的存在涨价预期的部分子行业，市场从刚开始认为涨价不可持续给予低估值定价，到后面认为涨价可持续从而给高估值定价，再到逐渐演绎预计未来持续涨价按照乐观的涨价预期给予部分行业和公司较高的估值溢价，该类子行业和相关公司预计将面临较大波动可能。对于其他 AI 领域的机会，我们依然保持较高关注度和配置比例，另外我们将逐渐提高其他非 AI 领域的优质公司配置比例。

本基金坚持长期思维框架，自上而上和自下而上相结合，坚持从产业基本面和股票市场估值两个维度综合考虑进行选股，以期实现合理的收益率。

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》、《兴全轻资产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

托管人声明:

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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：兴全轻资产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	295,164,460.64	277,571,416.19
结算备付金		13,429,503.03	6,727,744.44
存出保证金		1,084,183.94	1,308,391.67
交易性金融资产	6.4.7.2	2,898,318,336.32	2,443,690,683.83
其中：股票投资		2,831,070,037.09	2,433,867,416.68
基金投资		-	-
债券投资		67,248,299.23	9,823,267.15
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		814,995.29	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,546,788.36	186,242.40
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		3,210,358,267.58	2,729,484,478.53
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		18,625,375.11	1,426,976.57
应付赎回款		15,528,507.19	13,860,017.68
应付管理人报酬		2,856,062.82	2,751,115.38
应付托管费		476,010.46	458,519.21
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2,473.63	0.86
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	4,008,391.83	2,663,708.50
负债合计		41,496,821.04	21,160,338.20
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	648,090,027.48	870,513,538.06
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	2,520,771,419.06	1,837,810,602.27
净资产合计		3,168,861,446.54	2,708,324,140.33
负债和净资产总计		3,210,358,267.58	2,729,484,478.53

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 4.890 元，基金份额总额 648,090,027.48 份。

6.2 利润表

会计主体：兴全轻资产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		1,289,912,223.51	-285,414,699.16
1.利息收入		355,451.40	453,988.29
其中：存款利息收入	6.4.7.13	355,451.40	453,988.29
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）		994,141,841.38	-292,629,628.76
其中：股票投资收益	6.4.7.14	978,740,673.95	-318,127,420.68
基金投资收益		-	-

债券投资收益	6.4.7.15	4,097,210.30	2,842.18
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	11,303,957.13	25,494,949.74
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	295,013,957.07	6,618,940.54
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	400,973.66	142,000.77
减：二、营业总支出		19,129,113.03	20,371,726.60
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	16,280,369.98	17,343,046.55
其中：暂估管理人报酬		-	-
2．托管费	6.4.10.2.2	2,713,395.01	2,890,507.76
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		1,554.24	10.16
8．其他费用	6.4.7.23	133,793.80	138,162.13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,270,783,110.48	-305,786,425.76
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,270,783,110.48	-305,786,425.76
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,270,783,110.48	-305,786,425.76

6.3 净资产变动表

会计主体：兴全轻资产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	870,513,538.06	-	1,837,810,602.27	2,708,324,140.33
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	870,513,538.06	-	1,837,810,602.27	2,708,324,140.33
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-222,423,510.58	-	682,960,816.79	460,537,306.21
（一）、综合收益总额	-	-	1,270,783,110.48	1,270,783,110.48
（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）	-222,423,510.58	-	-587,822,293.69	-810,245,804.27
其中：1.基金申购款	60,701,085.51	-	195,057,978.93	255,759,064.44
2.基金赎回款	-283,124,596.09	-	-782,880,272.62	-1,066,004,868.71
（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	648,090,027.48	-	2,520,771,419.06	3,168,861,446.54

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	1,219,658,668.35	-	2,057,946,400.86	3,277,605,069.21
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,219,658,668.35	-	2,057,946,400.86	3,277,605,069.21
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-119,868,571.39	-	-491,380,466.14	-611,249,037.53
（一）、综合收益总额	-	-	-305,786,425.76	-305,786,425.76
（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）	-119,868,571.39	-	-185,594,040.38	-305,462,611.77
其中：1.基金申购款	30,380,833.53	-	45,526,476.26	75,907,309.79
2.基金赎回款	-150,249,404.92	-	-231,120,516.64	-381,369,921.56
（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	1,099,790,096.96	-	1,566,565,934.72	2,666,356,031.68

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

兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）(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”)《关于核准兴全轻资产投资股票型证券投资基金（LOF）募集的批复》(证监许可[2011]2161 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《兴全轻资产投资混合型证券投资基金(LOF)基金合同》发售，基金合同于 2012 年 4 月 5 日生效。本基金为契约型上市开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为 993,929,233.72 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，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

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(包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核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其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。

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，符合轻资产投资理念的股票合计投资比例不低于股票资产的 80%；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）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，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩基准为：80%×沪深 300 指数＋20%×中证国债指数。

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 01 月 01 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 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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023] 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025] 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基

金适用的主要税项列示如下：

a） 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3%的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入， 自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b） 对本基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c） 对本基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对本基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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

d） 本基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

e） 对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	295,164,460.64

等于：本金	295,140,045.11
加：应计利息	24,415.53
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	295,164,460.64

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		2,280,067,856.20	-	2,831,070,037.09	551,002,180.89
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	3,767,600.00	1,730.74	6,476,354.02	2,707,023.28
	银行间市场	59,998,980.00	741,945.21	60,771,945.21	31,020.00
	合计	63,766,580.00	743,675.95	67,248,299.23	2,738,043.28
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,343,834,436.20	743,675.95	2,898,318,336.32	553,740,224.17

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	6,904.56
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	3,903,227.12

其中：交易所市场	3,903,227.12
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	98,260.15
合计	4,008,391.83

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	870,513,538.06	870,513,538.06
本期申购	60,701,085.51	60,701,085.51
本期赎回（以“-”号填列）	-283,124,596.09	-283,124,596.09
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	648,090,027.48	648,090,027.48

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	1,306,496,535.71	531,314,066.56	1,837,810,602.27
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	1,306,496,535.71	531,314,066.56	1,837,810,602.27
本期利润	975,769,153.41	295,013,957.07	1,270,783,110.48
本期基金份额交易产生的变动数	-435,841,682.76	-151,980,610.93	-587,822,293.69
其中：基金申购款	143,690,631.12	51,367,347.81	195,057,978.93
基金赎回款	-579,532,313.88	-203,347,958.74	-782,880,272.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,846,424,006.36	674,347,412.70	2,520,771,419.06

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	336,352.81
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	16,229.64
其他	2,868.95
合计	355,451.40

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	978,740,673.95
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	978,740,673.95

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	8,260,312,885.68
减：卖出股票成本总额	7,269,493,990.73
减：交易费用	12,078,221.00
买卖股票差价收入	978,740,673.95

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	435,326.69
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,661,883.61
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	4,097,210.30

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	14,296,316.06
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	10,540,720.00
减：应计利息总额	93,163.00
减：交易费用	549.45
买卖债券差价收入	3,661,883.61

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	11,303,957.13
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	11,303,957.13

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	295,013,957.07
股票投资	292,283,193.79
债券投资	2,730,763.28
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	295,013,957.07

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	398,829.88
基金转换费收入	2,143.78
合计	400,973.66

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	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	25,933.65
账户维护费用	18,600.00
合计	133,793.80

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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	1,058,635,538.79	6.79	1,234,827,786.54	12.67

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
兴业证券	4,581,600.00	42.48	-	-

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	472,038.15	6.79	242,391.68	6.21
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	550,621.30	12.67	201,048.69	9.98

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	16,280,369.98	17,343,046.55
其中：应支付销售机构的客户维护费	6,440,168.71	6,582,926.44
应支付基金管理人的净管理费	9,840,201.27	10,760,120.11

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	2,713,395.01	2,890,507.76

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

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

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	295,164,460.64	336,352.81	218,597,654.92	440,007.98

注：本基金的银行存款由基金托管人招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
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股流通受限	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股流通受限	10.11	10.11	58,873	595,206.03	595,206.03	-
00124	华	202	1 个月	新	10.11	10.11	25,231	255,085.41	255,085.41	-

8	润新能源	6 年 6 月 24 日	内（含）	股流通受限						
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
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	新股流通受限	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	-
300750	宁德时代	2026 年 4 月 24 日	6 个月	询价转让流通受限	410.34	373.17	123,000	50,471,820.00	45,899,910.00	-
30151	尚	202	6 个月	新	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-

3	水智能	6 年 4 月 10 日		股流通受限						
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	-
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股流通受限	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
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	-
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	新股流通受限	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
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	-
301683	慧谷新	2026 年 3 月	6 个月	新股流	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-

	材	24 日		通受限						
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股流通受限	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
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	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股流通受限	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603407	长裕集团	2026 年 4 月 29 日	6 个月	新股流通受限	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-

				限						
603459	红板科技	2026年3月31日	6个月	新股流通受限	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688635	长进光子	2026年5月20日	6个月	新股流通受限	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688712	北芯生命	2026年1月28日	6个月	新股流通受限	17.52	35.92	234	4,099.68	8,405.28	-
688781	视涯科技	2026年3月18日	9个月	新股流通受限	22.68	42.16	6,335	143,677.80	267,083.60	-
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	-
688795	摩尔线程	2025年11月26日	9个月	新股流通受限	114.28	676.94	10,139	1,158,684.92	6,863,494.66	-
688797	臻宝科技	2026年6月16日	6个月	新股流通受限	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
68880	联	202	6个月	新	81.88	1,584.3	163	13,346.44	258,245.79	-

8	讯仪器	6 年 4 月 16 日		股流通受限		3				
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	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股流通受限	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	6,476,354.02	1,734,026.60

未评级	-	-
合计	6,476,354.02	1,734,026.60

注：此处列示的信用证券不包括国债、央行票据、政策性金融债券等非信用债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末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	295,164,460.64	-	-	-	-	-	295,164,460.64
结算备付金	13,429,503.03	-	-	-	-	-	13,429,503.03
存出保证金	1,084,183.94	-	-	-	-	-	1,084,183.94
交易性金融资产	-	60,771,945.21	-	-	6,476,354.02	2,831,070,037.09	2,898,318,336.32
应收申购款	132,470.00	-	-	-	-	1,414,318.36	1,546,788.36
应收清算款	-	-	-	-	-	814,995.29	814,995.29
资产总计	309,810,617.61	60,771,945.21	-	-	6,476,354.02	2,833,299,350.74	3,210,358,267.58
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	15,528,507.19	15,528,507.19
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,856,062.82	2,856,062.82
应付托管费	-	-	-	-	-	476,010.46	476,010.46
应付清算款	-	-	-	-	-	18,625,375.11	18,625,375.11
应交税费	-	-	-	-	-	2,473.63	2,473.63
其他负债	-	-	-	-	-	4,008,391.83	4,008,391.83
负债总计	-	-	-	-	-	41,496,821.04	41,496,821.04
利率敏感度缺口	309,810,617.61	60,771,945.21	-	-	6,476,354.02	2,791,802,529.70	3,168,861,446.54
上年度末 2025 年 12 月	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

31 日							
资产							
货币资金	277,571,416.19	-	-	-	-	-	277,571,416.19
结算备付金	6,727,744.44	-	-	-	-	-	6,727,744.44
存出保证金	1,308,391.67	-	-	-	-	-	1,308,391.67
交易性金融资产	8,089,240.55	-	-	-	1,734,026.60	2,433,867,416.68	2,443,690,683.83
应收申购款	1,659.25	-	-	-	-	184,583.15	186,242.40
资产总计	293,698,452.10	-	-	-	1,734,026.60	2,434,051,999.83	2,729,484,478.53
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	13,860,017.68	13,860,017.68
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,751,115.38	2,751,115.38
应付托管费	-	-	-	-	-	458,519.21	458,519.21
应付清算款	-	-	-	-	-	1,426,976.57	1,426,976.57
应交税费	-	-	-	-	-	0.86	0.86
其他负债	-	-	-	-	-	2,663,708.50	2,663,708.50
负债总计	-	-	-	-	-	21,160,338.20	21,160,338.20
利率敏感度缺口	293,698,452.10	-	-	-	1,734,026.60	2,412,891,661.63	2,708,324,140.33

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）		
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%	116,684.21	3,289.36
	市场利率上升 1%	-116,232.19	-3,286.64

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	2,831,070,037.09	89.34	2,433,867,416.68	89.87
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	67,248,299.23	2.12	9,823,267.15	0.36
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,898,318,336.32	91.46	2,443,690,683.83	90.23

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	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末 （2025 年 12 月 31 日 ）
	业绩比较基准上升 10%	584,182,606.15	512,441,547.78
	业绩比较基准下降 10%	-584,182,606.15	-512,441,547.78

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	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	2,781,570,538.04	2,426,989,917.66
第二层次	61,622,236.65	9,823,267.15
第三层次	55,125,561.63	6,877,499.02
合计	2,898,318,336.32	2,443,690,683.83

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。（2025 年 12 月 31 日：无。）

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括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	2,831,070,037.09	88.19
	其中：股票	2,831,070,037.09	88.19
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	67,248,299.23	2.09
	其中：债券	67,248,299.23	2.09
	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	308,593,963.67	9.61
8	其他各项资产	3,445,967.59	0.11
9	合计	3,210,358,267.58	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	42,133,334.82	1.33

C	制造业	2,677,211,411.59	84.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	850,291.44	0.03
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
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	110,873,415.78	3.50
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	2,831,070,037.09	89.34

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	300308	中际旭创	212,600	270,002,000.00	8.52
2	300750	宁德时代	610,258	237,397,176.58	7.49
3	300502	新易盛	260,400	158,062,800.00	4.99
4	002008	大族激光	913,700	137,155,507.00	4.33
5	688981	中芯国际	861,414	136,809,771.48	4.32
6	002475	立讯精密	1,887,100	132,851,840.00	4.19
7	002463	沪电股份	852,049	130,193,087.20	4.11
8	603259	药明康德	890,478	110,873,415.78	3.50
9	002371	北方华创	121,100	107,120,216.00	3.38
10	688041	海光信息	285,176	105,600,672.80	3.33
11	002203	海亮股份	4,363,851	99,713,995.35	3.15
12	688012	中微公司	190,000	89,015,000.00	2.81
13	600426	华鲁恒升	3,284,500	78,565,240.00	2.48
14	603268	松发股份	537,200	74,821,216.00	2.36
15	300408	三环集团	432,370	72,162,553.00	2.28

16	600176	中国巨石	987,500	71,969,000.00	2.27
17	300274	阳光电源	441,260	70,169,165.20	2.21
18	603986	兆易创新	83,306	67,894,390.00	2.14
19	300394	天孚通信	222,680	67,400,782.40	2.13
20	600487	亨通光电	611,900	66,905,146.00	2.11
21	000338	潍柴动力	2,337,100	63,685,975.00	2.01
22	688120	华海清科	176,761	56,948,858.98	1.80
23	300811	铂科新材	528,293	50,129,722.77	1.58
24	603993	洛阳钼业	2,398,700	42,097,185.00	1.33
25	002518	科士达	748,300	40,101,397.00	1.27
26	688627	精智达	54,723	39,126,945.00	1.23
27	688235	百济神州	150,465	38,309,893.65	1.21
28	688249	晶合集成	611,213	36,079,903.39	1.14
29	002916	深南电路	71,900	32,923,010.00	1.04
30	600584	长电科技	290,800	30,112,340.00	0.95
31	688428	诺诚健华	867,292	24,691,803.24	0.78
32	688275	万润新能	188,347	24,023,659.85	0.76
33	300763	锦浪科技	216,821	19,589,777.35	0.62
34	301538	骏鼎达	382,900	19,286,673.00	0.61
35	301511	德福科技	133,500	19,203,975.00	0.61
36	688795	摩尔线程	10,139	6,863,494.66	0.22
37	001248	华润新能源	84,104	850,291.44	0.03
38	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.02
39	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.01
40	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.01
41	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.01
42	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.01
43	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.00
44	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.00
45	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.00
46	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
47	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
48	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
49	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
50	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
51	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
52	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
53	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
54	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
55	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
56	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
57	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
58	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00

59	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
60	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
61	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
62	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
63	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
64	688712	北芯生命	234	8,405.28	0.00
65	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
66	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
67	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
68	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
69	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
70	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00

注：上表中股票名称以报告期末名称为准。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	291,244,968.37	10.75
2	300308	中际旭创	249,497,587.27	9.21
3	300502	新易盛	231,297,189.67	8.54
4	002463	沪电股份	198,519,534.18	7.33
5	002475	立讯精密	188,978,997.45	6.98
6	002203	海亮股份	175,371,116.23	6.48
7	300394	天孚通信	172,917,247.11	6.38
8	002008	大族激光	148,359,075.58	5.48
9	600487	亨通光电	144,783,638.52	5.35
10	601799	星宇股份	134,122,249.73	4.95
11	688041	海光信息	132,384,901.91	4.89
12	600938	中国海油	130,769,643.52	4.83
13	688981	中芯国际	129,928,321.55	4.80
14	600482	中国动力	119,246,926.50	4.40
15	688012	中微公司	117,898,541.80	4.35
16	300274	阳光电源	115,910,237.04	4.28
17	603986	兆易创新	114,700,238.36	4.24
18	688275	万润新能	112,695,327.91	4.16
19	601138	工业富联	101,462,375.03	3.75
20	300763	锦浪科技	99,786,170.94	3.68
21	600183	生益科技	95,564,822.00	3.53
22	600584	长电科技	89,575,744.02	3.31
23	000338	潍柴动力	89,384,502.80	3.30
24	300408	三环集团	86,636,659.00	3.20

25	688037	芯源微	84,942,850.92	3.14
26	002532	天山铝业	84,107,688.00	3.11
27	688111	金山办公	81,213,805.29	3.00
28	002371	北方华创	78,702,521.75	2.91
29	688120	华海清科	77,101,356.07	2.85
30	301526	国际复材	75,258,128.00	2.78
31	301382	蜂助手	74,181,774.08	2.74
32	600176	中国巨石	72,977,090.00	2.69
33	600519	贵州茅台	72,164,059.00	2.66
34	688388	嘉元科技	70,931,942.93	2.62
35	688521	芯原股份	69,623,026.02	2.57
36	600875	东方电气	69,079,908.80	2.55
37	600309	万华化学	67,908,177.50	2.51
38	601899	紫金矿业	66,376,815.00	2.45
39	002484	江海股份	64,805,622.33	2.39
40	600522	中天科技	61,329,189.00	2.26
41	600426	华鲁恒升	59,837,378.00	2.21
42	600673	东阳光	57,895,754.46	2.14
43	688408	中信博	57,493,335.11	2.12
44	000581	威孚高科	56,161,183.42	2.07
45	688256	寒武纪	55,838,305.04	2.06
46	301511	德福科技	54,167,690.26	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	300750	宁德时代	246,599,286.54	9.11
2	601899	紫金矿业	215,191,000.00	7.95
3	300502	新易盛	201,814,124.37	7.45
4	002475	立讯精密	192,996,308.93	7.13
5	002484	江海股份	191,258,015.10	7.06
6	600183	生益科技	169,956,385.30	6.28
7	002008	大族激光	168,798,375.19	6.23
8	002463	沪电股份	160,400,503.13	5.92
9	600938	中国海油	141,458,490.05	5.22
10	600482	中国动力	134,510,463.78	4.97
11	300308	中际旭创	134,309,880.00	4.96
12	300394	天孚通信	124,751,552.22	4.61
13	600489	中金黄金	122,871,532.71	4.54
14	600487	亨通光电	122,326,994.76	4.52
15	002290	禾盛新材	121,065,732.00	4.47
16	601799	星宇股份	121,031,749.13	4.47

17	688041	海光信息	119,684,648.39	4.42
18	601601	中国太保	113,415,693.88	4.19
19	002138	顺络电子	109,176,361.42	4.03
20	603986	兆易创新	107,434,396.74	3.97
21	002203	海亮股份	106,918,512.79	3.95
22	601318	中国平安	106,275,897.54	3.92
23	300408	三环集团	98,035,200.84	3.62
24	601138	工业富联	97,144,514.96	3.59
25	688275	万润新能	93,623,535.58	3.46
26	300763	锦浪科技	93,190,141.70	3.44
27	688256	寒武纪	92,496,593.98	3.42
28	688525	佰维存储	92,155,449.75	3.40
29	600584	长电科技	88,816,817.00	3.28
30	688037	芯源微	86,083,012.22	3.18
31	002532	天山铝业	86,076,736.67	3.18
32	300274	阳光电源	85,652,847.96	3.16
33	301526	国际复材	80,633,868.32	2.98
34	301358	湖南裕能	76,810,829.15	2.84
35	688521	芯原股份	76,241,153.23	2.82
36	688388	嘉元科技	76,212,513.06	2.81
37	688120	华海清科	76,196,700.32	2.81
38	688111	金山办公	75,987,535.09	2.81
39	600426	华鲁恒升	74,523,837.00	2.75
40	600519	贵州茅台	73,053,804.17	2.70
41	301382	蜂助手	72,547,337.36	2.68
42	603993	洛阳钼业	71,744,206.00	2.65
43	600875	东方电气	70,888,802.20	2.62
44	688300	联瑞新材	70,287,447.41	2.60
45	600522	中天科技	69,236,144.16	2.56
46	603799	华友钴业	67,906,344.01	2.51
47	688012	中微公司	66,634,955.30	2.46
48	688008	澜起科技	65,634,028.09	2.42
49	600309	万华化学	64,162,707.68	2.37
50	688627	精智达	62,487,360.50	2.31
51	002192	融捷股份	59,436,679.78	2.19
52	002812	恩捷股份	58,703,203.80	2.17
53	600547	山东黄金	57,338,319.16	2.12
54	601336	新华保险	56,277,308.00	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	7,374,413,417.35
卖出股票收入（成交）总额	8,260,312,885.68

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	60,771,945.21	1.92
	其中：政策性金融债	60,771,945.21	1.92
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）	6,476,354.02	0.20
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	67,248,299.23	2.12

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	250211	25 国开 11	600,000	60,771,945.21	1.92
2	127113	长高转债	20,336	3,485,183.12	0.11
3	118063	金 05 转债	17,340	2,991,170.90	0.09

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	1,084,183.94
2	应收清算款	814,995.29
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,546,788.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,445,967.59

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	300750	宁德时代	45,899,910.00	1.45	询价转让流通受限

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
206,937	3,131.82	30,646,965.82	4.73	617,443,061.66	95.27

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（%）	99.69

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	662,065.84	0.1022

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	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012 年 4 月 5 日）基金份额总额	993,929,233.72
本报告期期初基金份额总额	870,513,538.06
本报告期基金总申购份额	60,701,085.51
减：本报告期基金总赎回份额	283,124,596.09
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	648,090,027.48

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，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

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，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

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(%)	
国海证券	2	2,558,375,040.89	16.42	1,140,779.98	16.42	-
东吴证券	2	2,424,246,257.50	15.56	1,080,981.23	15.56	-
广发证券	4	2,009,707,707.75	12.90	896,125.76	12.90	-
天风证券	2	1,318,163,6	8.46	587,770.88	8.46	-

		70.87				
国金证券	2	1,086,812,529.26	6.98	484,611.34	6.98	-
中金公司	2	1,060,258,081.62	6.80	472,770.89	6.80	-
兴业证券	3	1,058,635,538.79	6.79	472,038.15	6.79	-
中信证券	5	689,327,619.54	4.42	307,377.07	4.42	-
华创证券	1	581,253,142.13	3.73	259,181.76	3.73	-
中信建投证券	3	550,693,980.00	3.53	245,547.12	3.53	-
申万宏源证券	2	531,015,210.19	3.41	236,777.67	3.41	-
长江证券	2	453,318,165.17	2.91	202,136.22	2.91	-
华福证券	1	310,331,515.18	1.99	138,377.71	1.99	-
招商证券	2	286,192,017.36	1.84	127,614.01	1.84	-
中泰证券	2	277,567,405.00	1.78	123,766.87	1.78	-
华泰证券	2	201,752,352.74	1.29	89,961.56	1.29	-
国信证券	2	173,316,845.30	1.11	77,281.93	1.11	-
国盛证券	2	9,686,435.64	0.06	4,319.25	0.06	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
国联民生证券	1	-	-	-	-	-
国泰海通证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
摩根大通证券	2	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-

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(%)
国海证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	6,203,516.06	57.52	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券	4,581,600.00	42.48	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国联民生证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-

摩根大通证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理变更公告	证券时报、指定互联网网站	2026 年 1 月 20 日
2	兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）更新招募说明书（2026 年 01 月 21 日更新）	证券时报、指定互联网网站	2026 年 1 月 21 日
3	兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）基金产品资料概要更新	证券时报、指定互联网网站	2026 年 1 月 21 日
4	关于旗下部分基金暂停直销渠道后端申购业务的公告	证券时报、指定互联网网站	2026 年 1 月 23 日
5	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	证券时报、指定互联网网站	2026 年 1 月 26 日
6	兴证全球基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、指定互联网网站	2026 年 3 月 20 日
7	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）	证券时报、指定互联网网站	2026 年 3 月 30 日
8	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	证券时报、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、《兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；

3、《兴全轻资产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