兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）
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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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	兴全沪深 300 指数（LOF）
场内简称	兴全沪深 300LOF
基金主代码	163407
前端交易代码	163407
后端交易代码	163408
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2010 年 11 月 2 日
报告期末基金份额总额	1,226,338,013.24 份
投资目标	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、跟踪沪深 300 指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的组合管理，谋求基金资产的长期增值。本基金力争日均跟踪误差不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，日均下方跟踪误差不超过 0.3%，年下方跟踪误差不超过 4.75%。
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、跟踪沪深 300 指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的组合管理。（详见本基金基金合同及招募说明书）
业绩比较基准	沪深 300 指数×95%＋同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数增强型基金，跟踪标的指数市场表现，追求接近或超越沪深 300 指数所代表的市场平均收益，是股票基金中处于中等风

	险水平的基金产品。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。		
基金管理人	兴证全球基金管理有限公司		
基金托管人	中国农业银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	兴全沪深 300 指数增强（LOF）A	兴全沪深 300 指数增强（LOF）C	兴全沪深 300 指数增强（LOF）Y
下属分级基金的场内简称	兴全 300	无	-
下属分级基金的交易代码	163407	007230	022962
下属分级基金的前端交易代码	163407	-	-
下属分级基金的后端交易代码	163408	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	1,121,386,777.94 份	75,623,609.75 份	29,327,625.55 份

注：1、本基金 A 类份额场内扩位简称：兴全沪深 300LOF。

2、自 2019 年 6 月 5 日起增设兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）C 类份额，仅 A 类份额上市交易。详情请见管理人网站公告。

§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）		
	兴全沪深 300 指数增强（LOF）A	兴全沪深 300 指数增强（LOF）C	兴全沪深 300 指数增强（LOF）Y
1.本期已实现收益	95,516,544.88	6,230,605.19	2,444,162.43
2.本期利润	27,311,676.54	2,081,668.50	503,779.41
3.加权平均基金份额本期利润	0.0241	0.0267	0.0179
4.期末基金资产净值	2,935,355,291.17	192,680,988.61	77,434,026.52
5.期末基金份额净值	2.6176	2.5479	2.6403

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

兴全沪深 300 指数增强（LOF）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	0.79%	1.03%	-11.88%	1.22%	12.67%	-0.19%
过去六个月	0.40%	1.05%	-1.92%	1.22%	2.32%	-0.17%
过去一年	-1.43%	0.95%	-5.72%	1.08%	4.29%	-0.13%
过去三年	17.07%	1.00%	17.46%	1.09%	-0.39%	-0.09%
过去五年	5.07%	1.03%	-9.55%	1.07%	14.62%	-0.04%
过去七年	32.54%	1.10%	14.27%	1.12%	18.27%	-0.02%
过去十年	97.35%	1.09%	33.36%	1.10%	63.99%	-0.01%
自基金合同生效起至今	161.76%	1.26%	26.74%	1.28%	135.02%	-0.02%

兴全沪深 300 指数增强（LOF）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	0.69%	1.03%	-11.88%	1.22%	12.57%	-0.19%
过去六个月	0.20%	1.05%	-1.92%	1.22%	2.12%	-0.17%
过去一年	-1.82%	0.95%	-5.72%	1.08%	3.90%	-0.13%
过去三年	15.68%	1.00%	17.46%	1.09%	-1.78%	-0.09%
过去五年	2.99%	1.03%	-9.55%	1.07%	12.54%	-0.04%
过去七年	29.08%	1.10%	14.27%	1.12%	14.81%	-0.02%
自基金合同生效起至今	39.06%	1.09%	20.82%	1.11%	18.24%	-0.02%

兴全沪深 300 指数增强（LOF）Y

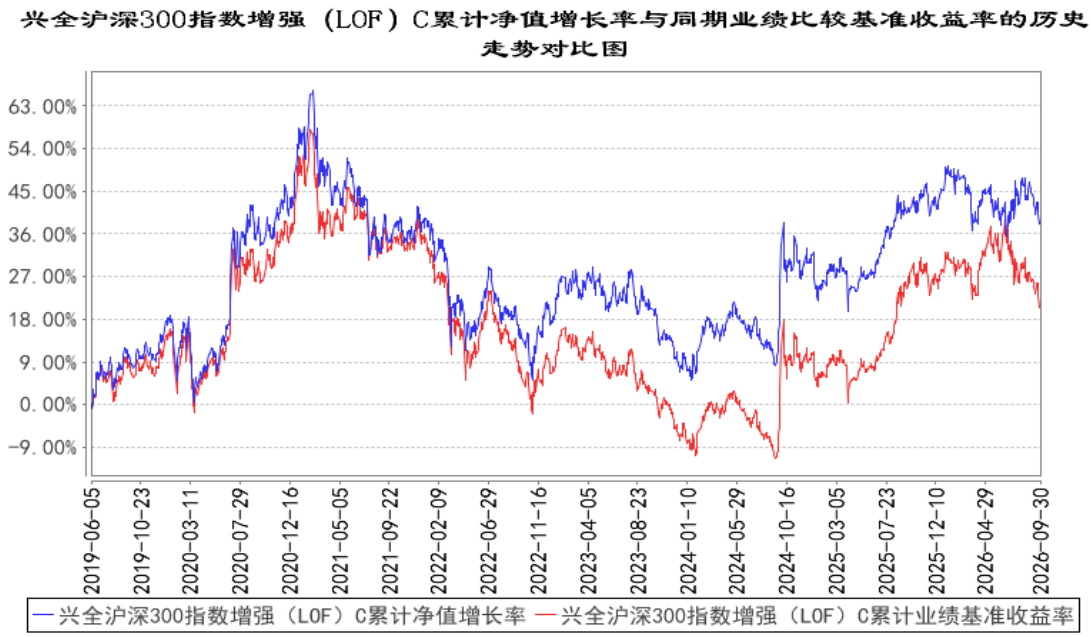
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.91%	1.03%	-11.88%	1.22%	12.79%	-0.19%

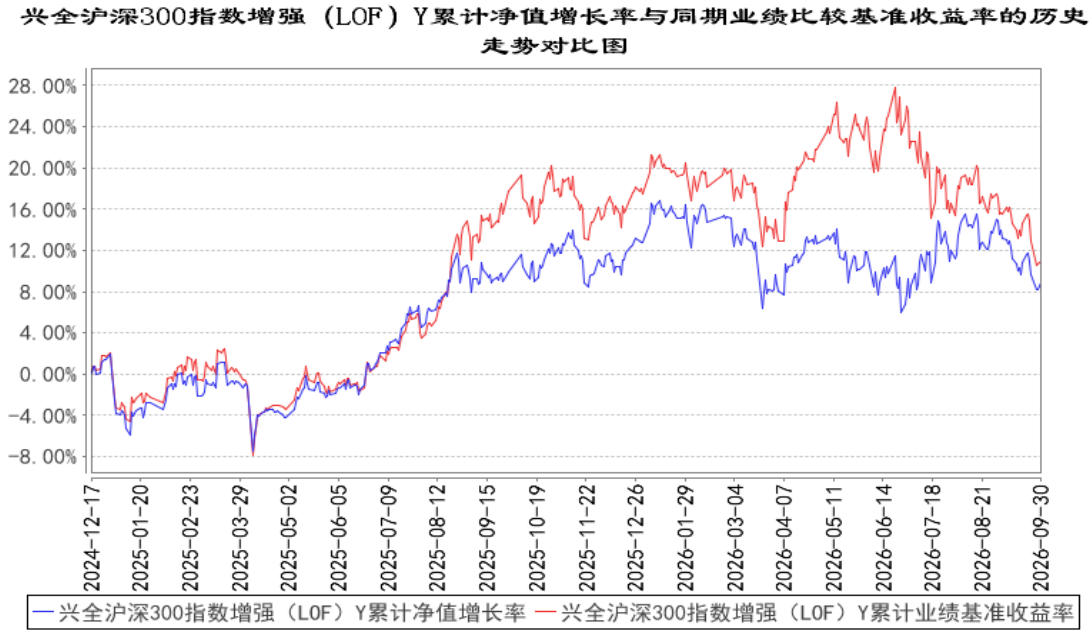
过去六个月	0.64%	1.05%	-1.92%	1.22%	2.56%	-0.17%
过去一年	-0.95%	0.95%	-5.72%	1.08%	4.77%	-0.13%
自基金合同生效起至今	8.84%	0.90%	10.96%	1.00%	-2.12%	-0.10%

注：本基金 C 类基金份额于 2019 年 6 月 5 日开始运作，本基金 Y 类基金份额于 2024 年 12 月 17 日开始运作。

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《兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》的规定，本基金建仓期为 2010 年 11 月 02 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、经与基金托管人中国农业银行协商一致，并报中国证监会备案，管理人决定自 2019 年 6 月 5 日起增设兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）C 类份额（代码：007230）。详情请见管理人网站公告。

4、本基金 Y 类基金份额于 2024 年 12 月 17 日开始运作。

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		
申庆	兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）、兴全中证 800 六个	2010 年 11 月 2 日	-	29 年	硕士，历任兴业证券研究发展中心研究员，兴证全球基金管理有限公司行业研究员，兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理助理、兴全全球视野股票型证券投资基金基金经理、基金管理部总监助理、兴全恒益债券型证券投资基金基金经理。

	月持有期指数增强型证券投资基金基金经理				

注：1、职务指截止报告期末的职务（报告期末仍在任的）或离任前的职务（报告期内离任的）。

2、任职日期指基金合同生效之日（基金成立时即担任基金经理）或公司作出聘任决定之日（基金成立后担任基金经理）；离任日期指公司作出解聘决定之日。

3、证券从业的涵义遵从行业的相关规定，包括资管相关行业从业经历。

4.1.1 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

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、《兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（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 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

二季度宏大叙事的高估值板块急剧冲高见顶，在 6 月底到三季度出现连续下跌。已经很久没

有出现的近垂直式上涨后的类垂直型下跌的个股走势在这个时间段大面积出现。对高仓位运作或者集中式的投资策略的绩效影响可能很大。最近半年的市场急剧变化不能说成纯粹的意料之外，但确实在情理之中。经过这次波折，相信更多的投资者会更充分重视和理解价值投资的长期意义；很多人会摒弃既想火中取栗又要全身而退的幻想；大家会更支持增强型宽基不能对指数内部显著的结构性风险无动于衷；更接受管理人要把控制组合回撤作为重要目标，避免盲目追求降低跟踪误差而使组合遭受更大的净值波动和下方风险的运作策略。

展望后期，当前的市场变化趋势尚未结束，新的市场影响因素又在酝酿。10 月初证监会就《公开募集证券投资基金运作管理办法（征求意见稿）》及配套规则公开征求意见。该政策对本产品在内的很多产品运作积极意义重大。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，兴全沪深 300 指数增强（LOF）A 的基金份额净值为 2.6176 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.79%，同期业绩比较基准收益率为-11.88%；兴全沪深 300 指数增强（LOF）C 的基金份额净值为 2.5479 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.69%，同期业绩比较基准收益率为-11.88%；兴全沪深 300 指数增强（LOF）Y 的基金份额净值为 2.6403 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.91%，同期业绩比较基准收益率为-11.88%。

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	3,131,736,769.70	93.95
	其中：股票	3,131,736,769.70	93.95
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	188,090,629.94	5.64
	其中：债券	188,090,629.94	5.64
	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	6,599,920.22	0.20
	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	5,040,389.90	0.15
8	其他资产	2,078,474.89	0.06
9	合计	3,333,546,184.65	100.00

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	2,437,071.84	0.08
B	采矿业	254,436,308.43	7.94
C	制造业	1,555,980,804.01	48.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	92,810,125.50	2.90
E	建筑业	51,835,636.51	1.62
F	批发和零售业	1,104,969.45	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	5,563,130.24	0.17
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	102,884,021.96	3.21
J	金融业	695,440,061.46	21.70
K	房地产业	25,453,592.00	0.79
L	租赁和商务服务业	96,279,432.20	3.00
M	科学研究和技术服务业	3,020,654.34	0.09
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	2,887,245,807.94	90.07

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	30,300,021.96	0.95
C	制造业	162,855,383.12	5.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	549,873.82	0.02
E	建筑业	4,380,175.80	0.14
F	批发和零售业	28,932.85	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	17,829.60	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,358,533.90	0.14

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	36,020.48	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	170,644.23	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	41,793,546.00	1.30
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	244,490,961.76	7.63

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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	000938	紫光股份	8,669,929	268,941,197.58	8.39
2	601318	中国平安	3,859,912	205,694,710.48	6.42
3	000100	TCL 科技	36,100,980	172,923,694.20	5.39
4	601138	工业富联	2,629,900	153,060,180.00	4.77
5	601009	南京银行	11,019,933	132,018,797.34	4.12
6	002938	鹏鼎控股	1,585,900	123,757,345.00	3.86
7	600741	华域汽车	7,799,900	119,962,462.00	3.74
8	600519	贵州茅台	76,410	96,171,154.20	3.00
9	601888	中国中免	1,815,513	93,389,988.72	2.91
10	000001	平安银行	5,120,080	59,239,325.60	1.85

注：上表中股票名称以报告期末名称为准。

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	002044	美年健康	9,399,900	41,793,546.00	1.30
2	002841	视源股份	819,993	37,047,283.74	1.16
3	000983	山西焦煤	4,669,900	30,260,952.00	0.94
4	002773	康弘药业	1,199,900	26,157,820.00	0.82
5	002728	特一药业	1,923,001	19,056,939.91	0.59

注：上表中股票名称以报告期末名称为准。

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	2,118,179.67	0.07
2	央行票据	-	-
3	金融债券	172,788,232.88	5.39
	其中：政策性金融债	172,788,232.88	5.39
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）	13,184,217.39	0.41
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	188,090,629.94	5.87

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	220402	22 农发 02	400,000	40,892,602.74	1.28
2	240403	24 农发 03	400,000	40,619,627.40	1.27
3	260401	26 农发 01	300,000	30,345,410.96	0.95
4	240303	24 进出 03	200,000	20,263,435.62	0.63
5	110081	闻泰转债	112,810	11,437,234.12	0.36

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

股指期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

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

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

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中，平安银行股份有限公司具有在报告编制日前一年内受到监管部门处罚的情况；本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

前十名证券的发行主体中，未见其他发行主体有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	337,624.21
2	应收证券清算款	3,061.06
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,737,789.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,078,474.89

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110081	闻泰转债	11,437,234.12	0.36
2	113052	兴业转债	915,637.73	0.03

3	127061	美锦转债	829,645.48	0.03

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

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	002938	鹏鼎控股	53,284,000.00	1.66	大宗交易购入流通受限

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	002044	美年健康	13,646,000.00	0.43	大宗交易购入流通受限

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	兴全沪深 300 指数增强（LOF）A	兴全沪深 300 指数增强（LOF）C	兴全沪深 300 指数增强（LOF）Y
报告期期初基金份额总额	1,168,244,541.38	81,449,752.85	26,762,136.51
报告期期间基金总申购份额	55,387,846.69	12,049,801.02	4,644,387.28
减:报告期期间基金总赎回份额	102,245,610.13	17,875,944.12	2,078,898.24
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	1,121,386,777.94	75,623,609.75	29,327,625.55

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

注：本报告期内，基金管理人未持有本基金的基金份额。

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

投资者可在二级市场买卖本基金 A 类基金份额，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。

§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、《兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》；

3、《兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（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。

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