

兴证全球盈鑫多元配置三个月持有期混合
型基金中基金（FOF）
2025 年中期报告

2025 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：2025 年 8 月 29 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，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 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 2025 年 01 月 23 日（基金合同生效日）起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	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	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	51

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	51
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 本报告期投资基金情况	51
7.13 投资组合报告附注	60
§ 8 基金份额持有人信息	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	62
§ 9 开放式基金份额变动	62
§ 10 重大事件揭示	63
10.1 基金份额持有人大会决议	63
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	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
10.4 基金投资策略的改变	63
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	63
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	63
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
10.9 其他重大事件	66
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	67
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	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	67
§ 12 备查文件目录	67
12.1 备查文件目录	67
12.2 存放地点	68
12.3 查阅方式	68

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴证全球盈鑫多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）	
基金简称	兴证全球盈鑫多元配置三个月持有混合（FOF）	
基金主代码	023003	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 1 月 23 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	480,606,504.66 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	兴证全球盈鑫多元配置三个月持有混 合（FOF）A	兴证全球盈鑫多元配置三个月持有混 合（FOF）C
下属分级基金的交 易代码	023003	023004
报告期末下属分级 基金的份额总额	112,675,308.85 份	367,931,195.81 份

注：1、本基金每份基金份额的最短持有期限为 3 个月。

2、若本基金参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日，则基金管理人可根据实际情况决定本基金是否暂停申购及赎回业务，具体以届时提前发布的公告为准。

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的前提下，通过优选基金积极把握基金市场的投资机会，力求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金的主要投资策略包括：资产配置策略、区域资产配置策略、优选基金策略、股票投资策略、存托凭证的投资策略、港股投资策略、债券投资策略、可转换债券及可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、证券公司短期公司债券投资策略、公募 REITs 投资策略
业绩比较基准	中证偏股型基金指数收益率×50%+MSCI 世界指数 (MSCI World Index) 收益率（使用估值汇率折算）×12%+上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约收盘价收益率×3%+中债综合（全价）指数收益率×35%
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金及货币型基金中基金，低于股票型基金、股票型基金中基金。 本基金除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的证券。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	兴证全球基金管理有限公司		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	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.xqfunds.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	兴证全球基金管理有限公司	上海市浦东新区锦康路 308 号陆家嘴世纪金融广场 6 号楼 13 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2025 年 1 月 23 日（基金合同生效日）-2025 年 6 月 30 日	
	兴证全球盈鑫多元配置三个月持有混合（FOF）A	兴证全球盈鑫多元配置三个月持有混合（FOF）C
本期已实现收益	254,472.63	55,002.23
本期利润	2,792,959.04	11,764,646.38
加权平均基金份额本期利润	0.0303	0.0188
本期加权平均净值利润率	3.02%	1.87%
本期基金份额净值增长率	2.57%	2.43%

3.1.2 期末数据 和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	341,611.43	629,838.02
期末可供分配基金份额利润	0.0030	0.0017
期末基金资产净值	115,566,045.72	376,876,266.67
期末基金份额净值	1.0257	1.0243
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	2.57%	2.43%

注：1、上述财务指标采用的计算公式，详见中国证券监督管理委员会发布的《证券投资基金信息披露编报规则第 1 号<主要财务指标的计算及披露>》、《证券投资基金会计核算业务指引》等相关法规。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4、本基金合同于 2025 年 01 月 23 日生效，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴证全球盈鑫多元配置三个月持有混合（FOF）A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	1.89%	0.38%	2.42%	0.36%	-0.53%	0.02%
过去三个月	2.23%	0.67%	2.88%	0.80%	-0.65%	-0.13%
自基金合同生效起至今	2.57%	0.54%	4.41%	0.70%	-1.84%	-0.16%

兴证全球盈鑫多元配置三个月持有混合（FOF）C

阶段	份额净	份额净值	业绩比较	业绩比较基准	①－③	②－④
----	-----	------	------	--------	-----	-----

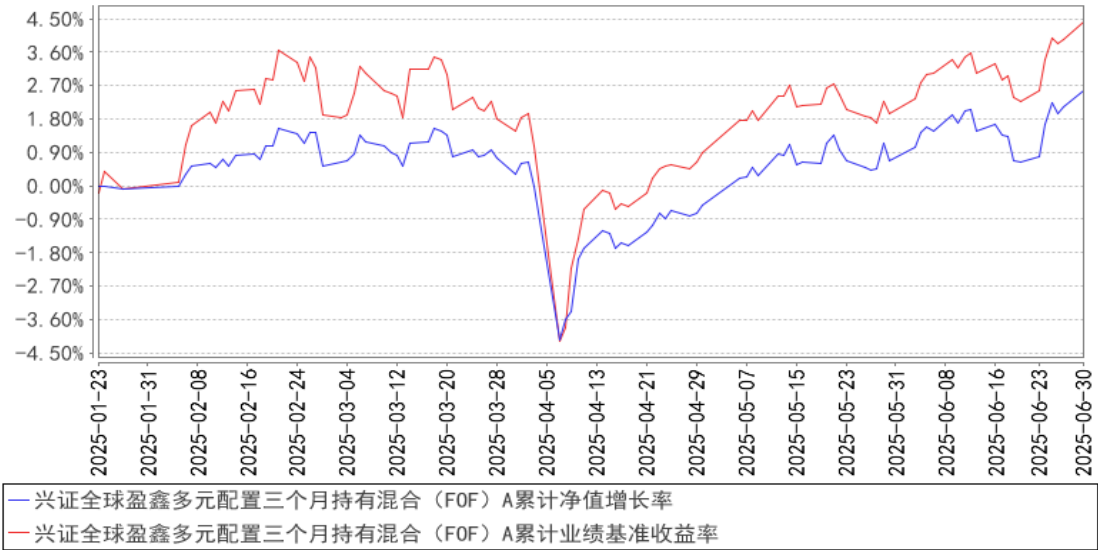
	值增长 率①	增长率标 准差②	基准收益 率③	收益率标准差 ④		
过去一个月	1.86%	0.38%	2.42%	0.36%	-0.56%	0.02%
过去三个月	2.14%	0.67%	2.88%	0.80%	-0.74%	-0.13%
自基金合同生效 起至今	2.43%	0.54%	4.41%	0.70%	-1.98%	-0.16%

注：1、本基金业绩比较基准为中证偏股型基金指数收益率×50%+MSCI 世界指数（MSCI World Index）收益率（使用估值汇率折算）×12%+上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约收盘价收益率×3%+中债综合（全价）指数收益率×35%，是根据基金合同中投资策略及资产配置比例等相关规定构建，能够较好地反映本基金的风险收益特征。本基金每个交易日对业绩比较基准依据合同约定的权重比例进行再平衡处理，并用每日连乘方式计算得到指数基准的时间序列。

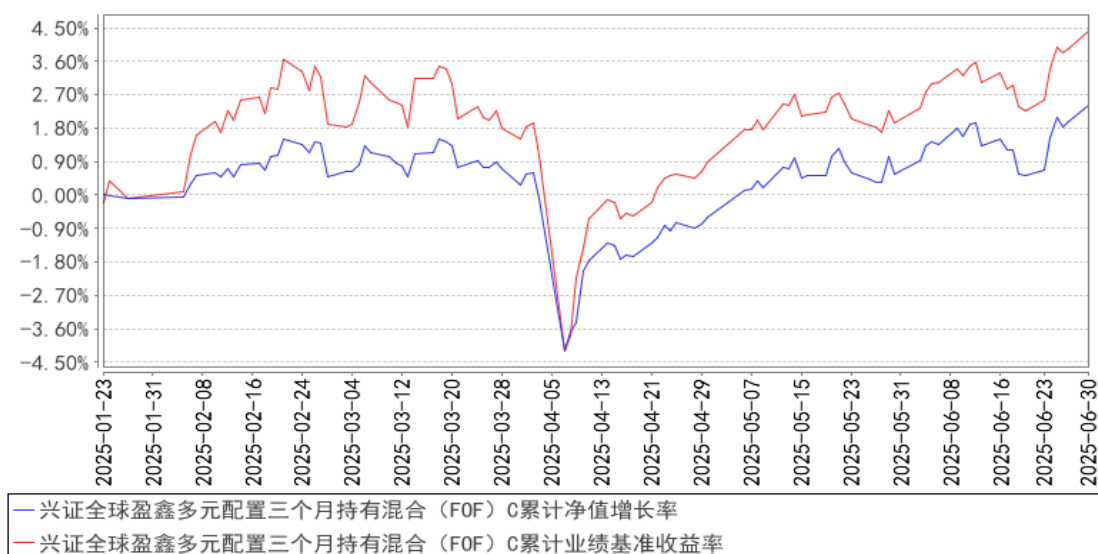
2、本基金成立于 2025 年 01 月 23 日，截至 2025 年 06 月 30 日，本基金成立不满一年。

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

兴证全球盈鑫多元配置三个月持有混合（FOF）A 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



兴证全球盈鑫多元配置三个月持有混合（FOF）C 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、净值表现所取数据截至到 2025 年 06 月 30 日。

2、按照《兴证全球盈鑫多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》的规定，本基金建仓期为 2025 年 01 月 23 日起共计六个月。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

3、本基金成立于 2025 年 01 月 23 日，截至 2025 年 06 月 30 日，本基金成立不满一年。

3.3 其他指标

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

兴证全球基金管理有限公司（成立时名为“兴业基金管理有限公司”，以下简称“公司”）经证监基字[2003]100 号文批准于 2003 年 9 月 30 日成立。2008 年 1 月，中国证监会批复（证监许可[2008]6 号），同意全球人寿保险国际公司（AEGON International B.V）受让公司股权并成为公司股东。2008 年 4 月 9 日，公司完成股权转让、变更注册资本等相关手续后，公司注册资本由 9800 万元变更为人民币 1.2 亿元，其中兴业证券股份有限公司的出资占注册资本的 51%，全球人寿保险国际公司的出资占注册资本的 49%。2008 年 7 月，经中国证监会批准（证监许可[2008]888 号），公司于 2008 年 8 月 25 日完成变更公司名称、注册资本等相关手续后，公司名称变更为“兴证全球基金管理有限公司”，注册资本增加为 1.5 亿元人民币，其中两股东出资比例不变。2016 年 12 月 28 日，因公司发展需要，公司名称变更为“兴全基金管理有限公司”。2020 年 3 月 18 日，

公司名称变更为“兴证全球基金管理有限公司”。

截至 2025 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 76 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		
林国怀	总经理助理、FOF 投资与金融工程部总监、养老金管理部总监，兴全安泰平衡养老三年持有混合 FOF、兴全优选进取三个月持有混合 FOF、兴全安泰积极养老五年持有混合发起式 FOF、兴证全球优选平衡三个月持有混合 FOF、兴证全球安悦稳健养老目标一年持有混合 FOF、兴证全球积极配置混合 FOF-LOF、兴证全球优选积极三个月持有混	2025 年 1 月 23 日	-	18 年	硕士。历任天相投资顾问有限公司基金分析师，瑞泰人寿保险基金组合投资经理，合众人寿资产管理中心基金组合投资经理，泰康资产管理有限公司执行总监，天安人寿资产管理中心权益投资部经理，兴证全球基金管理有限公司兴全安泰稳健养老一年持有混合 FOF 基金经理、兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF 基金经理。

	合 FOF、兴证全球盈鑫多元配置三个月持有混合 FOF 基金经理				
丁凯琳	兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF、兴证全球优选积极三个月持有混合 FOF、兴证全球盈鑫多元配置三个月持有混合 FOF 的基金经理	2025 年 1 月 23 日	-	12 年	硕士，历任美国芝加哥商品交易所量化风险管理经理、兴证全球基金管理有限公司研究员、基金经理助理、兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理、兴证全球优选平衡三个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理和兴证全球积极配置三年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）基金经理。

注：1、职务指截止报告期末的职务（报告期末仍在任的）或离任前的职务（报告期内离任的）。
2、任职日期指基金合同生效之日（基金成立时即担任基金经理）或公司作出聘任决定之日（基金成立后担任基金经理）；离任日期指公司作出解聘决定之日。
3、证券从业的涵义遵从行业的相关规定，包括资管相关行业从业经历。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本报告期末，本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划的投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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、《兴证全球盈鑫多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易

制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，确保各投资组合之间得到公平对待，保护投资者的合法权益。公司风险管理部对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异进行统计，从不同的角度分析差异的来源、考察是否存在不公平的因素。

本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的公平交易制度，未发现违反公平交易原则的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，不存在本投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在贸易摩擦加剧背景下，2025 年上半年全球资本市场在经历关税冲击后呈现修复态势并展现出较强韧性。A 股权益资产历经震荡后快速反弹，上证指数上涨 2.8%，中证偏股基金指数上涨 5.4%，具体到 A 股基金风格层面，小盘风格显著占优，成长风格也小幅跑赢价值风格。港股表现强势，恒生指数与恒生科技指数分别上涨 20.0% 和 18.7%。海外权益资产走出“深 V”行情，以人民币计价的标普 500 指数和纳斯达克 100 指数分别上涨 5.1% 和 7.5%。固定收益资产维持震荡，中债总财富指数和中长期纯债指数均微涨 0.7%，而中证转债指数受益于中小市值权益行情上涨 7.0%。另类资产表现突出，大商所豆粕期货指数上涨 4.8%，中证 REITs 全收益指数上涨 14.2%，黄金现货价格以 24.3% 的涨幅领涨全球各类资产。

回顾上半年，本基金主要进行的操作有：

（1）资产配置层面，本基金处于建仓期，组合逢低逐步完成了建仓，相对于业绩比较基准而言，目前组合的偏离幅度较小，本基金在基准设计层面即旨在通过多元化资产配置的方式来平滑组合的波动；随着 AH 溢价率的持续下行，本基金适度降低了港股基金的配置比例，提升了 A 股基金的配置比例；

（2）国内权益资产上，持续提升组合中成长型基金的占比，降低价值型基金的占比，保持整体组合均衡略偏成长风格；

（3）投资品种上，过去几年，A 股的 ETF 基金的规模持续提升，本基金在国内权益资产的配置上降低了国内 ETF 基金的占比，提升了国内主动权益基金的占比；在海外权益和黄金等商品的配置上，依然主要配置费率更低的 ETF 基金；

（4）固定收益类资产上，鉴于国内的债券收益率持续下行，组合不断通过公司内部货币基金、美元债基、可转债基金以及有偏绝对收益套利机会的品种替换组合的债券型基金，但随着

可转债市场的持续上涨，组合降低了可转债配置为主的相关基金的配置比例；

（5）其他方面，上半年本基金积极参与相关股票的定增机会；根据基金经理变更、产品转型等因素对相关持仓品种进行调整。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，兴证全球盈鑫多元配置三个月持有混合（FOF）A 的基金份额净值为 1.0257 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.57%，同期业绩比较基准收益率为 4.41%；兴证全球盈鑫多元配置三个月持有混合（FOF）C 的基金份额净值为 1.0243 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.43%，同期业绩比较基准收益率为 4.41%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着近几年房地产市场的降温和房价调整，国内家庭的金融资产占比持续提升，从结构上来看，依然是以银行存款、理财产品和货币基金等偏稳健收益类资产为主；但同时债券市场收益率持续下行，未来家庭资产寻求稳健增值的需求将延展至多元资产配置领域。

多元资产配置的方式一方面可以有效提升底层风险资产的占比，提高家庭资产的潜在回报率；另一方面可以利用资产间的低相关性可平滑组合波动，所以从这一角度来看，多元资产配置将是未来满足家庭理财配置的重要方式，基于此，我们对后续市场的展望以及投资策略主要有：

（1）在遵守合同要求和保持与业绩比较基准合理的跟踪误差的前提下，继续保持组合中对国内权益、国内固收、海外权益、海外固收、商品等多元资产的配置；

（2）虽然今年以来市场持续上涨，但目前股票相对于债券市场的吸引力依然较高，未来在市场未大幅上涨的前提下，将继续保持权益市场与基准配置一致；

（3）自 2021 年以来，主动基金显著落后于主流的宽基指数，并带动了 ETF 基金的大发展，但随着 ETF 基金的规模增长，可能使得“自由流通市值加权”这一因子不再低估，我们认为当前可积极关注主动基金可能的 α 机会；

（4）国内债券收益率维持低位，本基金将积极寻找其他品类进行替代，包括但不限于货币市场基金、可转债基金、美元债基以及其他具有绝对收益特征的品种；

（5）积极参与股票定增、大宗交易的投资机会，并跟踪测算新股申购带来的收益贡献，在新股贡献具有显著性价比时积极参与。

本基金是一只平衡型风格的多元配置型 FOF 基金，战略资产配置层面在国内权益和固收资产的基础上引入了境外权益资产、黄金等多类资产。我们将保持一贯的“略偏左侧”和“适度均衡”的配置策略，通过积极挖掘市场上相对收益和绝对收益的投资机会不断增厚组合收益，通过“多资产、多策略”的方式来平滑组合波动，努力将该基金呈现为“相对稳定的‘贝塔’和相对确定

的‘阿尔法’特征”。我们将秉承勤勉尽责的态度进行组合管理，遵守契约要求、保持策略的稳定性，兼顾长期收益率和改善持有人体验，力争陪伴投资者实现财富增值。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：1、估值委员会制定旗下基金的估值政策和流程，选取适当的估值方法、定期对估值政策和程序进行评价。采用的基金估值方法、政策和程序应经估值委员会审议，并报管理层批准后方可实施。2、估值方法确立后，由 IT 人员或 IT 人员协助估值系统开发商及时对系统中的参数或模型作相应的调整或对系统进行升级，以适应新的估值方法的需要。3、基金会计具体负责执行估值委员会确定的估值策略，并通过与托管行核对等方法确保估值准确无误；4、投资人员（包括基金经理）积极关注市场环境变化及证券发行机构有关影响证券价格的重大事件等可能对估值造成影响的因素，并就可能带来的影响提出建议和意见；5、合规管理人员参与估值方案的制定，确保估值方案符合相关法律法规及基金合同的约定；负责基金估值业务的定期和临时信息披露。6、审计部对估值流程、估值结果等进行检查，确保估值委员会决议的有效执行。

上述参与估值流程人员均具备估值业务所需的专业胜任能力。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《兴证全球盈鑫多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）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合规守信、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：兴证全球盈鑫多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	15,538,713.12
结算备付金		125,429.57
存出保证金		36,525.75
交易性金融资产	6.4.7.2	489,535,845.09
其中：股票投资		5,729,210.20
基金投资		461,212,964.34
债券投资		22,593,670.55
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		2,013,745.69

应收股利		—
应收申购款		158,275.44
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.8	15,364.41
资产总计		507,423,899.07
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日
负 债：		
短期借款		—
交易性金融负债		—
衍生金融负债	6.4.7.3	—
卖出回购金融资产款		—
应付清算款		9.06
应付赎回款		14,440,832.90
应付管理人报酬		297,669.29
应付托管费		42,720.30
应付销售服务费		106,249.00
应付投资顾问费		—
应交税费		16,529.54
应付利润		—
递延所得税负债		—
其他负债	6.4.7.9	77,576.59
负债合计		14,981,586.68
净资产：		
实收基金	6.4.7.10	480,606,504.66
其他综合收益	6.4.7.11	—
未分配利润	6.4.7.12	11,835,807.73
净资产合计		492,442,312.39
负债和净资产总计		507,423,899.07

注：1. 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，兴证全球盈鑫多元配置三个月持有混合（FOF）A 基金份额净值 1.0257 元，基金份额总额 112,675,308.85 份；兴证全球盈鑫多元配置三个月持有混合（FOF）C 基金份额净值 1.0243 元，基金份额总额 367,931,195.81 份。兴证全球盈鑫多元配置三个月持有混合（FOF）份额总额合计为 480,606,504.66 份。

2. 本基金合同生效日为 2025 年 01 月 23 日，本期财务报表的实际编制期间为 2025 年 01 月 23 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日止期间。

6.2 利润表

会计主体：兴证全球盈鑫多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2025 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 23 日（基金合 同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		18,042,943.19
1. 利息收入		818,210.82
其中：存款利息收入	6.4.7.13	321,768.07
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		496,442.75
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,856,749.92
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-871.68
基金投资收益	6.4.7.15	2,100,965.84
债券投资收益	6.4.7.16	72,449.16
资产支持证券投资收益	6.4.7.17	-
贵金属投资收益	6.4.7.18	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-
股利收益	6.4.7.20	684,206.60
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）	6.4.7.21	14,248,130.56
4. 汇兑收益（损失以“-”号填 列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填 列）	6.4.7.22	119,851.89
减：二、营业总支出		3,485,337.77
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,204,538.39
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	365,279.86
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	818,833.67
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	6.4.7.24	-
7. 税金及附加		4,092.43
8. 其他费用	6.4.7.25	92,593.42
三、利润总额（亏损总额以“-”号 填列）		14,557,605.42
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填 列）		14,557,605.42

五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		14,557,605.42

6.3 净资产变动表

会计主体：兴证全球盈鑫多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2025 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 23 日（基金合同生效日）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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	796,951,994.73	-	-	796,951,994.73
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	- 316,345,490.07	-	11,835,807.73	-304,509,682.34
（一）、综合收益总额	-	-	14,557,605.42	14,557,605.42
（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）	- 316,345,490.07	-	-2,721,797.69	-319,067,287.76
其中：1. 基金申购款	34,337,348.27	-	223,593.30	34,560,941.57
2. 基金赎回款	- 350,682,838.34	-	-2,945,390.99	-353,628,229.33
（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	480,606,504.66	-	11,835,807.73	492,442,312.39
-----------	----------------	---	---------------	----------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>庄园芳</u>	<u>庄园芳</u>	<u>詹鸿飞</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

兴证全球盈鑫多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）（以下简称“本基金”）系由基金管理人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》、《兴证全球盈鑫多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》（以下简称“基金合同”）及其他有关法律法规的规定，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〔2024〕1770 号文准予公开募集注册。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期。本基金首次设立募集基金份额为 796,951,994.73 份，经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了编号为德师报(验)字(25)第 00028 号验资报告。基金合同于 2025 年 1 月 23 日正式生效。基金托管人为招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金（包括 QDII 基金、香港互认基金、公开募集基础设施证券投资基金（以下简称“公募 REITs”））、国内依法发行上市的股票及存托凭证（包括主板、创业板及其他中国证监会核准或注册发行的股票及存托凭证）、港股通标的证券（包括股票和 ETF）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、证券公司短期公司债券、可转换债券（含可分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本基金不投资具有复杂、衍生品性质的基金份额，包括分级基金和中国证监会认定的其他基金份额。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

本基金投资于经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金的资产比例不低于基金资产

的 80%；投资于 QDII 基金和香港互认基金的比例合计不超过基金资产的 20%。本基金投资于权益类资产（股票、存托凭证、股票型基金、混合型基金）的投资比例范围为基金资产的 60%-85%。

前述的混合型基金需符合下列两个条件之一：

- 1、基金合同约定股票资产投资比例不低于基金资产 60%的混合型基金；
- 2、根据基金披露的定期报告，最近四个季度中任一季度股票资产占基金资产比例均不低于 60%的混合型基金。

本基金投资于货币市场基金的比例不超过本基金资产净值的 15%；投资于商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）的比例不超过本基金资产净值的 10%；投资于港股通标的股票占股票资产的 0-50%；本基金应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者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。若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许，本基金管理人在履行适当程序后，可对上述资产配置比例进行调整。

本基金的业绩比较基准为：中证偏股型基金指数收益率 $\times$ 50%+MSCI 世界指数(MSCI World Index)收益率（使用估值汇率折算） $\times$ 12%+上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约收盘价收益率 $\times$ 3%+中债综合（全价）指数收益率 $\times$ 35%。

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 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及 2025 年 1 月 23 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2025 年 1 月 23 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

(2) 金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在前一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是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；第二层次输入值是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；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值原则如下：

（1）对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采

用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当投资品种不存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

(3) 经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配（未分配利润）已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配（未分配利润）。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

（2）投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

基金投资收益于卖出基金成交日确认，并按卖出基金成交金额扣除应结转的基金投资成本、相关交易费用与税费后的差额入账。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

（3）公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

（4）信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

（5）其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 的年费率逐日计提，但本基金投资于本基金管理人所管理的基金的部分不收取管理费；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率逐日计提，但本基金投资于本基金托管人所托管的基金的部分不收取托管费；

(3) 本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.30% 年费率逐日计提；

卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提。

其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权后的基金份额净值自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金份额持有人因持有的基金份额（原份额）所获得的红利再投资份额的持有期，按原份额的持有期计算；

(2) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(3) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。在不影响基金份额持有人利益的情况下，基金管理人经与基金托管人协商一致后，可在法律法规允许的前提下并按照监管部门要求履行适当程序后酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和基金投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于基金投资，根据中基协发[2017]3号《关于发布〈基金中基金估值业务指引（试行）〉的通知》之附件《基金中基金估值业务指引（试行）》的规定在估值日对非上市基金和上市基金进行估值。

(2) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》（中基协发[2017]6号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

(3) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证监会公告[2017]13号）及《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》（中基协发[2013]13号）相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(4) 对于中国证券投资基金业协会《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》（中基协字[2022]566号）所规定的固定收益品种，本基金按照相关规定，对以公允价值计量的固定收益品种选取第三方估值基准服务机构提供估值全价进行估值；对以摊余成本计量的固定收益品种用自建或由第三方估值基准服务机构提供的预期信用损失模型参数或减值计量结果。

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更正。

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 日上海证券交易所发布的《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所发布的《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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[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[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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继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[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[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《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《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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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、债券免征增值税;2018 年 1 月 1 日起, 公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务, 以基金管理人为增值税纳税人, 暂适用简易计税方法, 按照 3%的征收率缴纳增值税。

(2) 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, 暂不计缴企业所得税。

(3) 对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。对基金通过港股通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(4) 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，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。对于基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	15,538,713.12
等于：本金	15,537,086.20
加：应计利息	1,626.92
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	15,538,713.12

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		5,436,053.00	-	5,729,210.20	293,157.20
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	2,500,100.00	7,225.34	2,507,725.34	400.00
	银行间市场	19,994,240.00	75,945.21	20,085,945.21	15,760.00
	合计	22,494,340.00	83,170.55	22,593,670.55	16,160.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		447,274,150.98	-	461,212,964.34	13,938,813.36
其他		-	-	-	-
合计		475,204,543.98	83,170.55	489,535,845.09	14,248,130.56

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

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	15,364.41
待摊费用	-
合计	15,364.41

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	7.86
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	400.00
其中：交易所市场	-
银行间市场	400.00
应付利息	-
预提费用	77,168.73
合计	77,576.59

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

兴证全球盈鑫多元配置三个月持有混合（FOF）A

项目	本期 2025 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	92,509,300.53	92,509,300.53

本期申购	30,094,204.40	30,094,204.40
本期赎回（以“-”号填列）	-9,928,196.08	-9,928,196.08
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	112,675,308.85	112,675,308.85

兴证全球盈鑫多元配置三个月持有混合（FOF）C

项目	本期 2025 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	704,442,694.20	704,442,694.20
本期申购	4,243,143.87	4,243,143.87
本期赎回（以“-”号填列）	-340,754,642.26	-340,754,642.26
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	367,931,195.81	367,931,195.81

注：申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

兴证全球盈鑫多元配置三个月持有混合（FOF）A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	254,472.63	2,538,486.41	2,792,959.04
本期基金份额交易产生的变动数	87,138.80	10,639.03	97,777.83
其中：基金申购款	79,123.09	131,395.33	210,518.42
基金赎回款	8,015.71	-120,756.30	-112,740.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	341,611.43	2,549,125.44	2,890,736.87

兴证全球盈鑫多元配置三个月持有混合（FOF）C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-

加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	55,002.23	11,709,644.15	11,764,646.38
本期基金份额交易产生的变动数	574,835.79	-3,394,411.31	-2,819,575.52
其中：基金申购款	-4,687.41	17,762.29	13,074.88
基金赎回款	579,523.20	-3,412,173.60	-2,832,650.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	629,838.02	8,315,232.84	8,945,070.86

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	312,156.67
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	9,463.34
其他	148.06
合计	321,768.07

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 2025年1月23日（基金合同生效日）至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-871.68
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	-871.68

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 2025 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	-

减：卖出股票成本总额	-
减：交易费用	871.68
买卖股票差价收入	-871.68

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 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	279,874,293.25
减：卖出/赎回基金成本总额	277,427,103.86
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	19,210.28
减：交易费用	327,013.27
基金投资收益	2,100,965.84

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月23日（基金合同生效日）至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	67,908.16
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	4,541.00
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	72,449.16

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月23日（基金合同生效日）至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	17,241,407.05
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	17,194,185.00
减：应计利息总额	42,281.05
减：交易费用	400.00
买卖债券差价收入	4,541.00

6.4.7.16.3 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。

6.4.7.16.4 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。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 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。

6.4.7.17.2 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。

6.4.7.17.3 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。

6.4.7.17.4 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。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 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。

6.4.7.18.2 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。

6.4.7.18.3 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。

6.4.7.18.4 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。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 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。

6.4.7.19.2 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。

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
----	---

股票投资产生的股利收益	43,326.00
其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	640,880.60
合计	684,206.60

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	14,248,130.56
股票投资	293,157.20
债券投资	16,160.00
资产支持证券投资	—
基金投资	13,938,813.36
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	14,248,130.56

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	25,102.33
销售服务费返还	94,749.54
基金转换费收入	0.02
合计	119,851.89

6.4.7.23 持有基金产生的费用

项目	本期 2025 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	124,737.95
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	1,634,710.10
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	293,974.66

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金

的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

6.4.7.24 信用减值损失

注：本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.25 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	18,542.58
信息披露费	55,626.15
证券出借违约金	—
银行费用	15,424.69
账户维护费用	3,000.00
合计	92,593.42

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、注册登记机构
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

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
兴业证券	16,892,731.00	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
兴业证券	5,538,000,000.00	100.00

6.4.10.1.4 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期基金 成交总额的比例（%）
兴业证券	242,000,428.38	100.00

6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

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 2025 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,204,538.39
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,531,566.89
应支付基金管理人的净管理费	672,971.50

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 1.00%的年费率计提，但本基金投资于本基金管理人所管理的基金的部分不收取管理费，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（扣除投资于本基金管理人所管理的基金的部分）×1.00%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	365,279.86

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提，但本基金投资于本基金托管人所托管的基金的部分不收取托管费，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（扣除投资于本基金托管人所托管的基金的部分）×0.15%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2025 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴证全球盈鑫多元配置三个月持有混合（FOF）A	兴证全球盈鑫多元配置三个月持有混合（FOF）C	合计
兴业证券	-	37.58	37.58
兴证全球基金	-	-	-
招商银行	-	755,688.26	755,688.26
合计	-	755,725.84	755,725.84

注：A 类份额不收取销售服务费，C 类份额的基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.30% 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 C 类基金份额销售服务费=C 类基金份额前一日基金资产净值×0.30%/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：本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

注：本基金本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

注：本基金本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2025 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	兴证全球盈鑫多元配置三个月持有混合（FOF）A	兴证全球盈鑫多元配置三个月持有混合（FOF）C
基金合同生效日（2025 年 1 月 23 日）持有的基金份额	—	—
报告期初持有的基金份额	—	—
报告期间申购/买入总份额	29,789,499.05	—
报告期间因拆分变动份额	—	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	—	—
报告期末持有的基金份额	29,789,499.05	—
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	6.1983%	—%

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

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	15,538,713.12	312,156.67

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

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

于 2025 年 06 月 30 日，本基金持有基金管理人兴证全球基金管理有限公司所管理的基金合计 157,056,241.99 元，占本基金资产净值的比例为 31.89%。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

项目	本期费用
	2025 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期交易基金产生的申购费（元）	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	30,075.90
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	95,226.92
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	401,188.44
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	74,387.79

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金资产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用。

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（2025 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
300916	朗	2025	6 个	询	23.20	26.92	21,100	489,520.00	568,012.00	-

	特 智 能	年 6 月 30 日	月	价 转 让 流 通 受 限						
688114	华 大 智 造	2025 年 4 月 16 日	6 个 月	询 价 转 让 流 通 受 限	65.00	61.48	30,200	1,963,000.00	1,856,696.00	-
688301	奕 瑞 科 技	2025 年 6 月 27 日	6 个 月	询 价 转 让 流 通 受 限	75.86	81.89	6,500	493,090.00	532,285.00	-
688556	高 测 股 份	2025 年 4 月 11 日	6 个 月	询 价 转 让 流 通 受 限	8.30	6.64	240,700	1,997,810.00	1,598,248.00	-
688556	高 测 股 份	2025 年 6 月 27 日	3 个 月	询 价 转 让 流 通 受 限- 转 增	-	6.64	96,280	-	639,299.20	注 1
688698	伟 创 电	2025 年 6 月 24	6 个 月	询 价 转	38.79	42.10	12,700	492,633.00	534,670.00	-

	气	日		让 流 通 受 限						
--	---	---	--	-----------------------	--	--	--	--	--	--

注：1、本基金持有的询价转让流通受限股票高测股份，于 2025 年 6 月 27 日实施 2024 年年度权益分配方案，每股派发现金红利 0.18 元（含税），以资本公积金向全体股东每股转增 0.40 股。本基金新增 96,280 股。

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%，投资于单只基金市值不高于本基金资产净值的 20%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，

以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的信用债。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金于本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的信用债。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金于本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易。因此，除在附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金每份基金份额设有最短持有期。对于基金份额持有人而言，存在投资本基金后，在最短持有期内无法赎回的风险。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 2025 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	15,538,713.12	-	-	-	-	-	15,538,713.12
结算备付金	125,429.57	-	-	-	-	-	125,429.57
存出保证金	36,525.75	-	-	-	-	-	36,525.75
交易性金融资产	-	-	22,593,670.55	-	-	466,942,174.54	489,535,845.09
应收申购款	60.00	-	-	-	-	158,215.44	158,275.44
应收清算款	-	-	-	-	-	2,013,745.69	2,013,745.69
其他资产	-	-	-	-	-	15,364.41	15,364.41
资产总计	15,700,728.44	-	22,593,670.55	-	-	469,129,500.08	507,423,899.07
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	14,440,832.90	14,440,832.90
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	297,669.29	297,669.29
应付托管费	-	-	-	-	-	42,720.30	42,720.30
应付清算款	-	-	-	-	-	9.06	9.06
应付销售服务费	-	-	-	-	-	106,249.00	106,249.00
应交税费	-	-	-	-	-	16,529.54	16,529.54

其他负债	-	-	-	-	-	77,576.59	77,576.59
负债总计	-	-	-	-	-	14,981,586.68	14,981,586.68
利率敏感度缺口	15,700,728.44	-22,593,670.55	-	-	-454,147,913.40	492,442,312.39	

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（2025 年 6 月 30 日）
	市场利率下降 1%	170,518.85
	市场利率上升 1%	-167,973.57

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。本基金持有非记账本位币人民币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

本报告期末基金各外币资产负债项目汇率风险敞口如下。本报告出于列报考虑，风险敞口金额以人民币列示，以资产负债表日即期汇率折算。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	美元折合人民币元	港币折合人民币元	其他币种折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	13,676,970.13	-	13,676,970.13
资产合计	-	13,676,970.13	-	13,676,970.13
以外币计价的				

负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	13,676,970.13	-	13,676,970.13

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他变量不变		
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（2025 年 6 月 30 日）	
	所有外币对人民币升值 5%	683,848.51	
	所有外币对人民币贬值 5%	-683,848.51	

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 2025 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	5,729,210.20	1.16
交易性金融资产—基金投资	461,212,964.34	93.66
交易性金融资产—债券投资	22,593,670.55	4.59
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	489,535,845.09	99.41

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（2025 年 6 月 30 日）
	业绩比较基准上升 10%	45,864,371.39
	业绩比较基准下降 10%	-45,864,371.39

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 2025 年 6 月 30 日
第一层次	461,212,964.34
第二层次	22,593,670.55

第三层次	5,729,210.20
合计	489,535,845.09

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业等情况，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 2025 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。

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	5,729,210.20	1.13
	其中：股票	5,729,210.20	1.13
2	基金投资	461,212,964.34	90.89
3	固定收益投资	22,593,670.55	4.45
	其中：债券	22,593,670.55	4.45
	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	15,664,142.69	3.09
8	其他各项资产	2,223,911.29	0.44
9	合计	507,423,899.07	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	-	-
C	制造业	5,729,210.20	1.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,729,210.20	1.16

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	688556	高测股份	336,980	2,237,547.20	0.45
2	688114	华大智造	30,200	1,856,696.00	0.38
3	300916	朗特智能	21,100	568,012.00	0.12
4	688698	伟创电气	12,700	534,670.00	0.11
5	688301	奕瑞科技	6,500	532,285.00	0.11

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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	688556	高测股份	1,997,810.00	0.41
2	688114	华大智造	1,963,000.00	0.40
3	688301	奕瑞科技	493,090.00	0.10
4	688698	伟创电气	492,633.00	0.10
5	300916	朗特智能	489,520.00	0.10

注：“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：无。

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	5,436,053.00
卖出股票收入（成交）总额	-

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	2,507,725.34	0.51
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,085,945.21	4.08
	其中：政策性金融债	20,085,945.21	4.08
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	22,593,670.55	4.59

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	250206	25 国开 06	200,000	20,085,945.21	4.08

2	019773	25 国债 08	25,000	2,507,725.34	0.51
---	--------	----------	--------	--------------	------

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

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。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

本基金为基金中基金，通过定量和定性相结合的方法筛选出各类资产类别中优秀的基金经理和基金品种进行投资，力求基金资产的长期稳健增值。本基金主要投资于公开募集证券投资基金，且资产比例不低于基金资产的 80%；投资于 QDII 基金和香港互认基金的比例合计不超过基金资产的 20%。本基金投资于权益类资产（股票、存托凭证、股票型基金、混合型基金）的投资比例范围为基金资产的 60%-85%。本基金整体风险中等，符合基金合同约定的投资政策、投资限制等要求。

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	018610	兴证全球中证同业存单 AAA 指数 7	契约型开放式	46,188,657.70	48,105,486.99	9.77	是

		天持有					
2	161125	标普 500LOF	上市 契约 型开 放式 (LOF)	13,912,075.00	37,479,130.05	7.61	否
3	012324	兴证全球恒 惠 30 天持 有超短债 A	契约 型开 放式	25,856,853.03	29,088,959.66	5.91	是
4	012325	兴证全球恒 惠 30 天持 有超短债 C	契约 型开 放式	16,903,420.80	18,901,405.14	3.84	是
5	518850	黄金 9999	交易 型开 放式 (ETF)	1,766,700.00	12,987,011.70	2.64	否
6	968124	高腾亚洲收 益基金 M 类 (人民币)- 累积	契约 型开 放式	1,194,404.14	11,812,656.94	2.40	否
7	02800	盈富基金	交易 型开 放式 (ETF)	507,500.00	11,348,214.61	2.30	否
8	159655	标普 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	6,414,900.00	10,334,403.90	2.10	否
9	001821	兴全天添益 货币 B	契约 型开 放式	10,002,166.69	10,002,166.69	2.03	是
10	163415	兴全商业模 式混合 (LOF) A	上市 契约 型开 放式 (LOF)	2,252,513.01	7,964,886.00	1.62	是

10	163415	兴全商业模式 LOF	上市 契约 型开 放式 (LOF)	147,400.00	516,931.80	0.10	是
11	010624	富国稳健增 长混合 A	契约 型开 放式	12,100,300.03	8,413,338.61	1.71	否
12	163406	兴全合润混 合 A	上市 契约 型开 放式 (LOF)	4,420,840.85	7,021,621.52	1.43	是
12	163406	兴全合润 LOF	上市 契约 型开 放式 (LOF)	867,649.00	1,367,414.82	0.28	是
13	008269	大成睿享混 合 A	契约 型开 放式	5,154,477.34	8,338,913.44	1.69	否
14	016311	中欧优质企 业混合 A	契约 型开 放式	9,540,657.80	8,334,718.65	1.69	否
15	159920	恒生 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	5,589,000.00	8,294,076.00	1.68	否
16	002808	泓德优势领 航混合	契约 型开 放式	5,507,086.44	8,206,660.21	1.67	否
17	022503	富国全球债 券(QDII)人 民币 E	契约 型开 放式	6,300,009.50	8,181,192.34	1.66	否
18	001044	嘉实新消费 股票 A	契约 型开 放式	3,331,866.27	8,179,731.69	1.66	否

19	002980	华夏创新前沿股票	契约型开放式	3,305,170.98	8,124,110.27	1.65	否
20	001667	南方转型增长灵活配置混合 A	契约型开放式	4,362,831.86	8,054,223.90	1.64	否
21	016465	兴证全球合瑞混合 C	契约型开放式	8,367,726.10	8,041,384.78	1.63	是
22	450009	国富中小盘股票 A	契约型开放式	3,164,162.54	8,026,531.12	1.63	否
23	009069	大成睿鑫股票 A	契约型开放式	6,029,158.32	8,015,163.07	1.63	否
24	160916	大成优选混合 (LOF) A	上市契约型开放式 (LOF)	2,097,273.20	7,963,346.34	1.62	否
25	000471	富国城镇发展股票	契约型开放式	3,601,587.59	7,951,224.92	1.61	否
26	014794	富国远见优选混合 A	契约型开放式	8,207,537.13	7,946,537.45	1.61	否
27	007449	兴全多维价值混合 A	契约型开放式	4,078,433.46	7,928,474.65	1.61	是
28	019505	国泰君安中证 1000 优选股票发起 A	契约型开放式	5,980,450.72	7,836,184.58	1.59	否
29	166001	中欧新趋势混合 (LOF) A	上市契约型开	6,706,161.19	7,631,611.43	1.55	否

			放式 (LOF)				
30	002863	金信深圳成长混合 A	契约 型开 放式	3,403,153.04	7,568,952.68	1.54	否
31	260116	景顺长城核心竞争力混合 A 类	契约 型开 放式	2,291,882.80	7,072,750.32	1.44	否
32	110023	易方达医疗保健行业混合 A	契约 型开 放式	1,885,749.46	7,009,330.74	1.42	否
33	968155	中银香港亚洲债 C4	契约 型开 放式	775,018.09	6,393,899.24	1.30	否
34	014155	国泰君安中证 500 指数增强 A	契约 型开 放式	4,937,388.19	5,221,288.01	1.06	否
35	010673	兴全中证 800 六个月持有指数增强 A	契约 型开 放式	4,550,827.38	5,211,607.52	1.06	是
36	022374	富国亚洲收益债券 (QDII) 人民币 E	契约 型开 放式	4,697,040.86	5,058,243.30	1.03	否
37	002350	华安安华灵活配置混合 A	契约 型开 放式	3,069,319.09	4,992,247.50	1.01	否
38	000824	圆信永丰双利 A	契约 型开 放式	6,196,851.37	4,945,707.08	1.00	否
39	017826	兴证全球欣越混合 A	契约 型开 放式	4,271,313.86	4,917,136.52	1.00	是
40	018424	路博迈中国机遇混合 A	契约 型开	5,232,935.98	4,910,587.12	1.00	否

			放式				
41	003293	易方达科瑞混合	契约型开放式	2,657,002.30	4,683,232.25	0.95	否
42	163417	兴全合宜混合 A	上市契约型开放式 (LOF)	1,502,300.00	2,438,383.13	0.50	是
42	163417	兴全合宜 LOF	上市契约型开放式 (LOF)	1,286,100.00	2,074,479.30	0.42	是
43	513800	东证 ETF	交易型开放式 (ETF)	2,821,200.00	4,271,296.80	0.87	否
44	184801	鹏华前海万科 REITS	契约型开放式	34,900.00	3,536,766.00	0.72	否
45	03110	G X 恒生高股息率	交易型开放式 (ETF)	91,200.00	2,328,755.52	0.47	否
46	163407	兴全沪深 300 指数增强 (LOF) A	上市契约型开放式 (LOF)	885,867.56	2,155,492.95	0.44	是
47	506005	科创板 BS	上市契约型开放式 (LOF)	2,381,300.00	1,995,529.40	0.41	否

48	506000	科创板基	上市 契约 型开 放式 (LOF)	2,626,200.00	1,961,771.40	0.40	否
49	159985	豆粕 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	996,000.00	1,917,300.00	0.39	否
50	513080	法国 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	1,066,100.00	1,834,758.10	0.37	否
51	506002	易基科创	上市 契约 型开 放式 (LOF)	1,883,600.00	1,699,007.20	0.35	否
52	518680	金 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	220,300.00	1,680,007.80	0.34	否
53	506003	富国科创	上市 契约 型开 放式 (LOF)	2,050,526.00	1,449,721.88	0.29	否
54	159561	德国 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	896,900.00	1,238,618.90	0.25	否
55	159915	创业板 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	556,600.00	1,187,227.80	0.24	否
56	161914	创业板 2 年 定开	上市 契约	1,774,537.00	1,125,056.46	0.23	否

			型开 放式 (LOF)				
57	160325	华夏创业板 定开	上市 契约 型开 放式 (LOF)	1,248,800.00	1,027,762.40	0.21	否
58	506001	万家科创	上市 契约 型开 放式 (LOF)	1,020,000.00	963,900.00	0.20	否
59	159741	恒生科技 ETF 嘉实	交易 型开 放式 (ETF)	1,342,500.00	949,147.50	0.19	否
60	004417	兴全货币 B	契约 型开 放式	937,613.09	937,613.09	0.19	是
61	506006	添富科创	上市 契约 型开 放式 (LOF)	1,016,518.00	835,577.80	0.17	否
62	022512	南方亚洲美 元收益债券 (QDII)E(人 民币)	契约 型开 放式	679,809.65	703,059.14	0.14	否
63	160926	创业板定开	上市 契约 型开 放式 (LOF)	661,934.00	536,166.54	0.11	否
64	163418	兴全合兴 LOF	上市 契约 型开	625,486.00	382,797.43	0.08	是

			放式 (LOF)				
65	166027	中欧创业定开	上市 契约 型开 放式 (LOF)	442,720.00	347,092.48	0.07	否
66	161040	创业富国定开	上市 契约 型开 放式 (LOF)	247,300.00	281,427.40	0.06	否
67	159656	300 成长 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	324,600.00	278,831.40	0.06	否
68	160726	嘉实瑞享定开	上市 契约 型开 放式 (LOF)	207,899.00	189,188.09	0.04	否
69	513690	恒生股息	交易 型开 放式 (ETF)	180,500.00	183,749.00	0.04	否
70	008706	建信富时 100 指数 (QDII)C 人 民币	契约 型开 放式	70,610.46	90,995.70	0.02	否
71	539003	建信富时 100 指数 (QDII)A 人 民币	契约 型开 放式	69,368.62	90,907.58	0.02	否
72	166024	中欧恒利定开	上市 契约 型开 放式	64,600.00	61,951.40	0.01	否

			(LOF)				
73	501093	华夏翔阳	上市 契约 型开 放式 (LOF)	55,600.00	58,769.20	0.01	否
74	501088	嘉实瑞虹	上市 契约 型开 放式 (LOF)	24,000.00	17,160.00	0.00	否

注：对于同时在场内和场外持有的基金，合并计算公允价值参与排序，并按照不同基金分别披露。

7.12.3 报告期末基金持有的全部公开募集基础设施证券投资基金情况

注：本基金本报告期末未持有公开募集基础设施证券投资基金。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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，易方达基金管理有限公司、国家开发银行、华夏基金管理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。

7.13.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.13.3 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	36,525.75
2	应收清算款	2,013,745.69
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	158,275.44
6	其他应收款	15,364.41
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	2,223,911.29
---	----	--------------

7.13.4 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。

7.13.5 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	688556	高测股份	2,237,547.20	0.45	询价转让流通受限
2	688114	华大智造	1,856,696.00	0.38	询价转让流通受限
3	300916	朗特智能	568,012.00	0.12	询价转让流通受限
4	688698	伟创电气	534,670.00	0.11	询价转让流通受限
5	688301	奕瑞科技	532,285.00	0.11	询价转让流通受限

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
兴证全球盈鑫多元配置三个月持有混合（FOF）A	581	193,933.41	29,789,499.05	26.44	82,885,809.80	73.56
兴证全球盈鑫多元配置三个	8,057	45,666.03	15,083,814.81	4.10	352,847,381.00	95.90

月持有混合（FOF）C						
合计	8,638	55,638.63	44,873,313.86	9.34	435,733,190.80	90.66

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	兴证全球盈鑫多元配置三个月持有混合（FOF）A	214,310.26	0.1902
	兴证全球盈鑫多元配置三个月持有混合（FOF）C	264,696.86	0.0719
	合计	479,007.12	0.0997

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	兴证全球盈鑫多元配置三个月持有混合（FOF）A	0
	兴证全球盈鑫多元配置三个月持有混合（FOF）C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	兴证全球盈鑫多元配置三个月持有混合（FOF）A	0~10
	兴证全球盈鑫多元配置三个月持有混合（FOF）C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	兴证全球盈鑫多元配置三个月持有混合（FOF）A	兴证全球盈鑫多元配置三个月持有混合（FOF）C
基金合同生效日（2025 年 1 月 23 日）基金份额总额	92,509,300.53	704,442,694.20
基金合同生效日起	30,094,204.40	4,243,143.87

至报告期期末基金总申购份额		
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	9,928,196.08	340,754,642.26
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	112,675,308.85	367,931,195.81

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。

2025 年 6 月 22 日，基金管理人的董事长、法定代表人杨华辉先生离任，由公司副董事长、总经理、财务负责人庄园芳女士代为履行董事长、法定代表人职务。

（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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自 2025 年起聘请德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 基金租用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 (%)	
长江证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	4	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰海通证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
摩根大通证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	3	-	-	-	-	-
中信证券	5	-	-	-	-	-

注：1. 报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：新增中信证券交易单元 5 个，新增广发证券交易单元 4 个，新增中信建投证券交易单元 3 个，新增长江证券交易单元 2 个，新增德邦证券

交易单元 2 个，新增东吴证券交易单元 2 个，新增国金证券交易单元 2 个，新增国盛证券交易单元 2 个，新增国泰海通证券交易单元 2 个，新增国投证券交易单元 2 个，新增国信证券交易单元 2 个，新增华泰证券交易单元 2 个，新增华西证券交易单元 2 个，新增摩根大通证券交易单元 2 个，新增申万宏源证券交易单元 2 个，新增天风证券交易单元 2 个，新增信达证券交易单元 2 个，新增兴业证券交易单元 2 个，新增招商证券交易单元 2 个，新增中金公司交易单元 2 个，新增中泰证券交易单元 2 个，新增东方证券交易单元 1 个，新增国海证券交易单元 1 个，新增华创证券交易单元 1 个，新增华福证券交易单元 1 个，新增民生证券交易单元 1 个；

2. 上表列示交易单元数量为截至本报告期末本基金租用数量，成交金额及佣金为本报告期间数；
3. 根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力、客户服务质量的基础上，选择基金专用交易席位。

10.8.2 基金租用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		基金交易	
	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 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
摩根大通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	16,892, 731.00	100.00	5,538,0 00,000. 00	100.00	-	-	242,000 ,428.38	100.00
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.9 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	关于增加兴证全球盈鑫多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）销售机构的公告	上海证券报、指定互联网网站	2025 年 1 月 6 日
2	关于增加兴证全球盈鑫多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）销售机构的公告	上海证券报、指定互联网网站	2025 年 1 月 9 日
3	关于调整旗下部分基金最低申购、追加申购、定期定额投资金额的公告	上海证券报、指定互联网网站	2025 年 1 月 11 日
4	关于增加兴证全球盈鑫多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）销售机构的公告	上海证券报、指定互联网网站	2025 年 1 月 13 日
5	兴证全球盈鑫多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同生效公告	上海证券报、指定互联网网站	2025 年 1 月 24 日
6	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（2024 年 7 月-12 月）	上海证券报、指定互联网网站	2025 年 3 月 29 日
7	兴证全球基金管理有限公司关于使用固有资金自购旗下权益类公募基金的公告	上海证券报、指定互联网网站	2025 年 4 月 9 日
8	兴证全球盈鑫多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）开放日	上海证券报、指定互联网网站	2025 年 4 月 22 日

	常申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告		
9	兴证全球基金管理有限公司关于终止民商基金销售（上海）有限公司办理旗下基金销售业务的公告	上海证券报、指定互联网网站	2025 年 6 月 6 日
10	兴证全球基金管理有限公司董事长、法定代表人离任及总经理代为履行董事长、法定代表人职务的公告	上海证券报、指定互联网网站	2025 年 6 月 24 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

本基金每份基金份额的最短持有期限为 3 个月。对于每份基金份额，最短持有期指基金合同生效日（对认购份额而言，下同）或基金份额申购确认日（对申购份额而言，下同）起（即最短持有期起始日），至基金合同生效日或基金份额申购申请日起 3 个月后的月度对日（即最短持有期到期日）。若该月度对日为非工作日或不存在对应日期的，则顺延至下一个工作日。本基金每份基金份额自其最短持有期到期日（含该日）起，基金份额持有人方可就该基金份额提出赎回申请。因此，对于基金份额持有人而言，存在投资本基金后，3 个月内无法赎回的风险。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会准予兴证全球盈鑫多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）募集注册

的文件；

- 2、《兴证全球盈鑫多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》；
- 3、《兴证全球盈鑫多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议》；
- 4、关于申请募集兴证全球盈鑫多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）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

2025 年 8 月 29 日