兴证全球中证沪港深 300 指数增强型证券投资基金
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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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 04 月 01 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遵规守信情况的说明 10
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 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 12
§5 托管人报告 13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13
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 13
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 13
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 13
6.1 资产负债表 13
6.2 利润表 15
6.3 净资产变动表 16
6.4 报表附注 17
§7 投资组合报告 42
7.1 期末基金资产组合情况 42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 43
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 44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 47
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 50

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 50
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 50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 50
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 投资组合报告附注 51

§8 基金份额持有人信息 52

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 52
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 53

§9 开放式基金份额变动 53

§10 重大事件揭示 53

10.1 基金份额持有人大会决议 53
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 53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 54
10.4 基金投资策略的改变 54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 54
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 54
10.8 其他重大事件 55

§11 影响投资者决策的其他重要信息 56

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 56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 56

§12 备查文件目录 56

12.1 备查文件目录 56
12.2 存放地点 56
12.3 查阅方式 56

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴证全球中证沪港深 300 指数增强型证券投资基金	
基金简称	兴证全球中证沪港深 300 指数增强	
基金主代码	023203	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 4 月 1 日	
基金管理人	兴证全球基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	81,187,662.38 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	兴证全球中证沪港深 300 指数增强 A	兴证全球中证沪港深 300 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	023203	023204
报告期末下属分级基金的份额总额	50,190,250.00 份	30,997,412.38 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对中证沪港深 300 指数进行有效跟踪的基础上，对基金投资组合进行相对增强，力争实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用指数复制结合相对增强的投资策略，即通过指数复制的方法拟合、跟踪中证沪港深 300 指数，并在严格控制与业绩比较基准偏离风险的前提下进行相对增强的组合管理，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。本基金力争日均跟踪误差的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。
业绩比较基准	中证沪港深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期收益和预期风险高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金可投资于港股通标的股票，需面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。基金管理人对本基金的风险评级为 R3。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		兴证全球基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨卫东	王小飞
	联系电话	021-20398888	021-60637103
	电子邮箱	yangwd@xqfunds.com	wangxiaofei.zh@ccb.com

客户服务电话	4006780099，021-38824536	021-60637228
传真	021-20398988	021-60635778
注册地址	上海市黄浦区金陵东路 368 号	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	上海市浦东新区芳甸路 1155 号嘉里城办公楼 28-29 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	201204	100033
法定代表人	庄园芳	张金良

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 4 月 1 日（基金合同生效日）-2025 年 6 月 30 日	
	兴证全球中证沪港深 300 指数增强 A	兴证全球中证沪港深 300 指数增强 C
本期已实现收益	6,272,537.96	6,028,558.90
本期利润	6,138,744.15	9,654,906.54
加权平均基金份额本期利润	0.0904	0.0896
本期加权平均净值利润率	8.75%	8.73%
本期基金份额净值增长率	8.29%	8.18%
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	4,159,204.44	2,534,348.42

期末可供分配基金份额利润	0.0829	0.0818
期末基金资产净值	54,349,454.44	33,531,760.80
期末基金份额净值	1.0829	1.0818
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	8.29%	8.18%

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 04 月 01 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

兴证全球中证沪港深 300 指数增强 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	3.33%	0.53%	2.23%	0.62%	1.10%	-0.09%
过去三个月	8.29%	0.55%	1.33%	1.26%	6.96%	-0.71%
自基金合同生效起至今	8.29%	0.55%	1.33%	1.26%	6.96%	-0.71%

兴证全球中证沪港深 300 指数增强 C

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	3.29%	0.53%	2.23%	0.62%	1.06%	-0.09%
过去三个月	8.18%	0.55%	1.33%	1.26%	6.85%	-0.71%

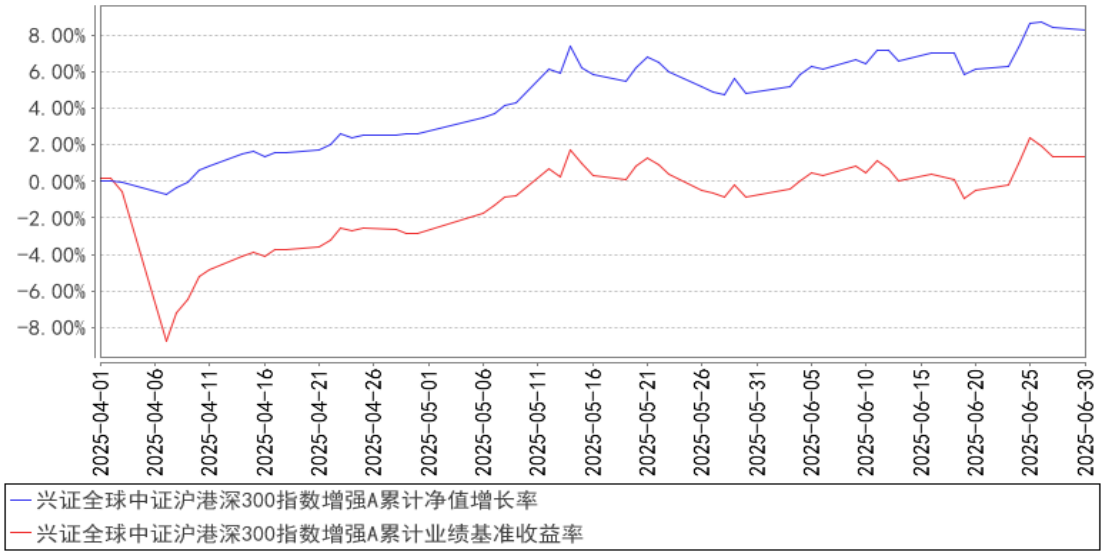
自基金合同生效起至今	8.18%	0.55%	1.33%	1.26%	6.85%	-0.71%

注：1、本基金业绩比较基准为中证沪港深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%，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。

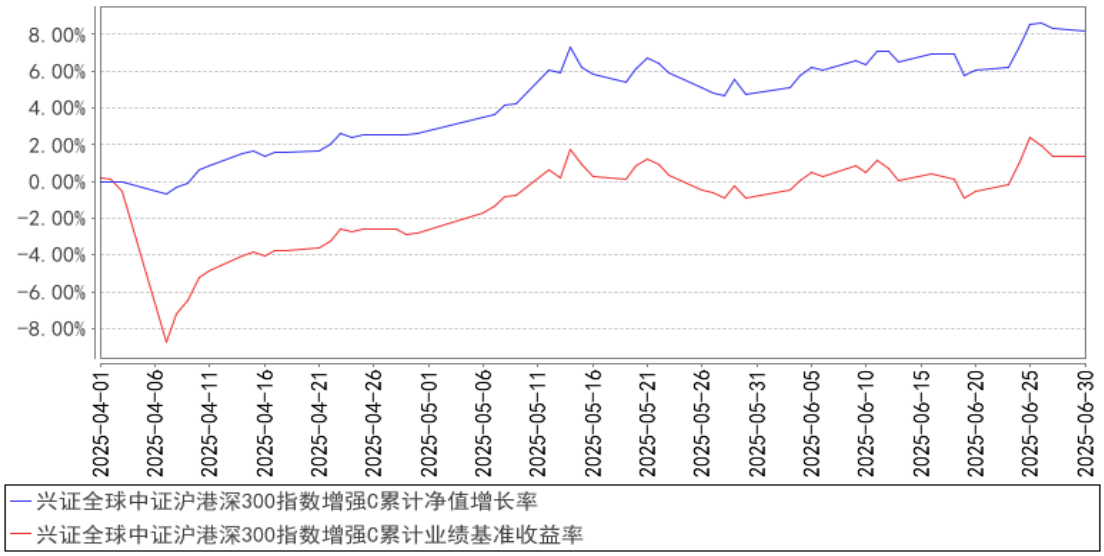
2、本基金成立于 2025 年 04 月 01 日，截至 2025 年 06 月 30 日，本基金成立不满一年。

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

兴证全球中证沪港深300指数增强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



兴证全球中证沪港深300指数增强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《兴证全球中证沪港深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》的规定，本基金建仓期为 2025 年 04 月 01 日起共计六个月。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

3、本基金成立于 2025 年 04 月 01 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 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		
田大伟	兴证全球基金管理有限公司专户投资部总监助理兼投资	2025 年 4 月 1 日	-	15 年	CFA，金融工程专业博士。历任光大保德信基金管理有限公司绝对收益部总监、基金经理；华鑫证券有限责任公司资产管理总部副总经理，兼任投资总监、资管量化投资部总经理和投资经理。

	经理、兴证全球红利量化选股股票型证券投资基金、兴证全球中证A500指数增强型证券投资基金基金经理、兴证全球中证沪港深 300 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。

4.1.3 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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
田大伟	公募基金	3	1,635,639,854.45	2024 年 10 月 31 日
	私募资产管理计划	1	564,480,295.30	2024 年 5 月 10 日
	其他组合	-	-	-
	合计	4	2,200,120,149.75	-

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、《兴证全球中证沪港深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 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

今年二季度初美国发起的贸易争端对市场造成了短暂冲击，随后市场一直处于修复状态。

我们一直认为贸易争端虽然会对外部需求造成较大的冲击，特别对制造业出口驱动经济增长构成较大挑战,但中国国内经济和资本市场环境已与首次贸易争端时迥然不同(首次贸易争端时，房地产问题、地方债务、资本新规等都同时聚焦在一起)。另外，此次美国增加关税是对全球多个国家同时进行，以中国目前的制造业实力，相对腾挪的空间更大。同时，关税争端的冲击也存在递减效应。因此，我们判断之后的 A 股市场走势虽然仍会受到国际市场的扰动，但将更多地取决于国内因素。

我们观察到国内科技、消费、甚至投资都有很多闪亮点，国内政策态度积极，各界对资本市场呵护力量较强，因此，权益市场总体下行风险可控，上行空间仍然存在。在这种背景下，沪港深 300 这样的宽基指数值得关注。

与此同时，我们也观察到今年上半年市场市值偏小的股票表现相对较好。目前市值偏小股票的交易量占比已接近 2024 年年初时的水平，而当时市值偏小股票出现了一定程度的风险。我们虽然难以判断是否类似的情况就要发生，但显然相关的风险正在累积。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，兴证全球中证沪港深 300 指数增强 A 的基金份额净值为 1.0829 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.29%，同期业绩比较基准收益率为 1.33%；兴证全球中证沪港深 300 指数增强 C 的基金份额净值为 1.0818 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.18%，同期业绩比较基

准收益率为 1.33%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

基于以上对市场分析，以及对沪港深 300 指数增强产品所用量化增强模型的了解，我们仍会首先选择稳健性模型，第一目标是跟上沪港深 300 指数，之后谋求超额。继续维持大多数持仓来自成份股，在一定程度上维持行业和市值等风格的中性。继续迭代研发新模型，在不断迭代高频量价因子、机器学习类因子的同时。高度重视港股相关因子的研究。储备和运用在某一类型资产聚集性表现时或者市场极涨极跌时相对稳健的模型，力争实现持续稳定的超额收益。

4.6 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》、《兴证全球中证沪港深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，本报告期内，本基金未实施利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未发生需披露的基金份额持有人数不满两百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为 。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§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：兴证全球中证沪港深 300 指数增强型证券投资基金

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	1,199,265.71
结算备付金		4,117,850.32
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	86,930,046.22
其中：股票投资		81,815,299.64
基金投资		-
债券投资		5,114,746.58
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		-
应收股利		113,277.82
应收申购款		1,206,143.73
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.8	-
资产总计		93,566,583.80
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		3,542,990.83
应付赎回款		2,019,060.90
应付管理人报酬		54,005.50
应付托管费		10,126.03
应付销售服务费		13,483.07
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.9	45,702.23
负债合计		5,685,368.56
净资产：		
实收基金	6.4.7.10	81,187,662.38
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	6,693,552.86
净资产合计		87,881,215.24
负债和净资产总计		93,566,583.80

注：1. 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，兴证全球中证沪港深 300 指数增强 A 基金份额净值 1.0829 元，基金份额总额 50,190,250.00 份；兴证全球中证沪港深 300 指数增强 C 基金份额净值 1.0818 元，基金份额总额 30,997,412.38 份。兴证全球中证沪港深 300 指数增强份额总额合计为 81,187,662.38 份。

2. 本基金合同生效日为 2025 年 04 月 01 日，本期财务报表的实际编制期间为 2025 年 04 月 01 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：兴证全球中证沪港深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 4 月 1 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 4 月 1 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		16,382,749.18
1.利息收入		96,866.26
其中：存款利息收入	6.4.7.13	21,455.26
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		75,411.00
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		12,499,775.30
其中：股票投资收益	6.4.7.14	11,483,711.20
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	21,536.13
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	994,527.97
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	3,492,553.83
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	293,553.79
减：二、营业总支出		589,098.49
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	362,697.27
其中：暂估管理人报酬		-
2．托管费	6.4.10.2.2	68,005.73
3．销售服务费	6.4.10.2.3	111,387.62
4．投资顾问费		-
5．利息支出		890.12
其中：卖出回购金融资产支出		890.12
6．信用减值损失	6.4.7.22	-

7．税金及附加		271.49
8．其他费用	6.4.7.23	45,846.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		15,793,650.69
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		15,793,650.69
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		15,793,650.69

6.3 净资产变动表

会计主体：兴证全球中证沪港深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 4 月 1 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 4 月 1 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	311,359,265.57	-	-	311,359,265.57
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	- 230,171,603.19	-	6,693,552.86	-223,478,050.33
（一）、综合收益总额	-	-	15,793,650.69	15,793,650.69
（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）	- 230,171,603.19	-	-9,100,097.83	-239,271,701.02
其中：1.基金申购款	26,236,579.28	-	1,917,237.38	28,153,816.66
2.基金赎回款	- 256,408,182.47	-	-11,017,335.21	-267,425,517.68
（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	81,187,662.38	-	6,693,552.86	87,881,215.24

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	庄园芳	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

兴证全球中证沪港深 300 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)，系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2024]1958 号的核准，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《兴证全球中证沪港深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)向社会公开募集，基金合同于 2025 年 4 月 1 日正式生效，首次设立募集规模为 311,359,265.57 份基金份额，其中 A 类份额 105,026,771.97 份，C 类份额 206,332,493.60 份。本基金为契约型开放式 ，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为兴证全球基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中证沪港深 300 指数的成份股及其备选成份股、其他非指数成份股(包含主板、创业板及其他国内依法发行上市的股票及存托凭证)、港股通标的股票、债券(包括国债、地方政 府债、政府支持债券、政府支持机构债券、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券(含分离交易可转债的纯债部分)、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、金融衍生工具(包括股指期货、国债期货、股票期权)、货币市场工具以及法律法规或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的相关规定)。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定，参与融资业务和转融通证券出借业务。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。

基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 80%，投资于中证

沪港深 300 指数的成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为：中证沪港深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%

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 4 月 1 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 4 月 1 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。

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。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

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。

(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 0.80%的年费率逐日计提；

(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；

(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 0.40%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；

(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。在符合法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人在与基金托管人协商一致后经履行适当程序，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整。

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和债券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。

(2)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。

(3)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 日上海交易所发布的《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳交易所发布的《关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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	1,199,265.71
等于：本金	1,199,234.68
加：应计利息	31.03
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	1,199,265.71

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		78,311,435.81	-	81,815,299.64	3,503,863.83
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	5,071,810.00	54,246.58	5,114,746.58	-11,310.00
	合计	5,071,810.00	54,246.58	5,114,746.58	-11,310.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		83,383,245.81	54,246.58	86,930,046.22	3,492,553.83

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 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	909.59
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	285.50
其中：交易所市场	-
银行间市场	285.50
应付利息	-
预提费用	42,863.14
其他	1,644.00
合计	45,702.23

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

兴证全球中证沪港深 300 指数增强 A

项目	本期 2025 年 4 月 1 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	105,026,771.97	105,026,771.97
本期申购	18,339,097.65	18,339,097.65
本期赎回（以“-”号填列）	-73,175,619.62	-73,175,619.62
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	50,190,250.00	50,190,250.00

兴证全球中证沪港深 300 指数增强 C

项目	本期 2025 年 4 月 1 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	206,332,493.60	206,332,493.60
本期申购	7,897,481.63	7,897,481.63
本期赎回（以“-”号填列）	-183,232,562.85	-183,232,562.85
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	30,997,412.38	30,997,412.38

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

兴证全球中证沪港深 300 指数增强 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	6,272,537.96	-133,793.81	6,138,744.15
本期基金份额交易产生的变动数	-435,867.95	-1,543,671.76	-1,979,539.71
其中：基金申购款	1,769,788.50	-331,854.51	1,437,933.99

基金赎回款	-2,205,656.45	-1,211,817.25	-3,417,473.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,836,670.01	-1,677,465.57	4,159,204.44

兴证全球中证沪港深 300 指数增强 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	6,028,558.90	3,626,347.64	9,654,906.54
本期基金份额交易产生的变动数	-2,459,212.07	-4,661,346.05	-7,120,558.12
其中：基金申购款	531,828.65	-52,525.26	479,303.39
基金赎回款	-2,991,040.72	-4,608,820.79	-7,599,861.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,569,346.83	-1,034,998.41	2,534,348.42

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 4 月 1 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	4,946.16
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	16,192.70
其他	316.40
合计	21,455.26

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4月1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	11,483,711.20
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	11,483,711.20

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 4 月 1 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	185,950,300.05
减：卖出股票成本总额	174,121,967.10
减：交易费用	344,621.75
买卖股票差价收入	11,483,711.20

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 2025年4月1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	21,698.63
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-162.50
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	21,536.13

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 2025年4月1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	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-
减：应计利息总额	-
减：交易费用	162.50
买卖债券差价收入	-162.50

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 2025 年 4 月 1 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	994,527.97
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	994,527.97

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 4 月 1 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	3,492,553.83
股票投资	3,503,863.83
债券投资	-11,310.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2.衍生工具	-
权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	3,492,553.83

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 4 月 1 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	293,451.49
基金转换费收入	102.30
合计	293,553.79

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 2025 年 4 月 1 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	11,581.57
信息披露费	29,781.57
证券出借违约金	-
银行费用	2,183.12
开户费	800.00
账户维护费用	1,500.00
合计	45,846.26

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
中国建设银行股份有限公司(“建设银行”)	基金托管人
兴证全球基金管理有限公司(“兴证全球基金”)	基金管理人
兴业证券股份有限公司(“兴业证券”)	基金管理人的股东

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 2025 年 4 月 1 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
兴业证券	109,514.52	0.02

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内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 2025年4月1日（基金合同生效日）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	32.49	0.03	-	-

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 2025 年 4 月 1 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	362,697.27
其中：应支付销售机构的客户维护费	154,875.14
应支付基金管理人的净管理费	207,822.13

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.80%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×0.80%/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 4 月 1 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	68,005.73

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，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×0.15%/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 4 月 1 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		
	兴证全球中证沪港深	兴证全球中证沪港深	合计

	300 指数增强 A	300 指数增强 C	
建设银行	-	19,754.90	19,754.90
兴证全球基金	-	714.45	714.45
合计	-	20,469.35	20,469.35

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 0.40%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 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×0.40%/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 4 月 1 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	兴证全球中证沪港深 300 指数增强 A	兴证全球中证沪港深 300 指数增强 C
基金合同生效日（ 2025 年 4 月 1 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	13,836,715.87	-
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	13,836,715.87	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	17.0429%	-%

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 4 月 1 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
建设银行	1,199,265.71	4,946.16

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设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

本基金本报告期内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（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

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

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

本基金为契约型开放式基金，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 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	1,199,265.71	-	-	-	-	-	1,199,265.71

结算备付金	4,117,850.32	-	-	-	-	-	4,117,850.32
交易性金融资产	-	-	5,114,746.58	-	-	81,815,299.64	86,930,046.22
应收股利	-	-	-	-	-	113,277.82	113,277.82
应收申购款	100.00	-	-	-	-	1,206,043.73	1,206,143.73
资产总计	5,317,216.03	-	5,114,746.58	-	-	83,134,621.19	93,566,583.80
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,019,060.90	2,019,060.90
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	54,005.50	54,005.50
应付托管费	-	-	-	-	-	10,126.03	10,126.03
应付清算款	-	-	-	-	-	3,542,990.83	3,542,990.83
应付销售服务费	-	-	-	-	-	13,483.07	13,483.07
其他负债	-	-	-	-	-	45,702.23	45,702.23
负债总计	-	-	-	-	-	5,685,368.56	5,685,368.56
利率敏感度缺口	5,317,216.03	-	5,114,746.58	-	-	77,449,252.63	87,881,215.24

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%	33,999.17
	市场利率上升 1%	-33,548.38

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	-	21,304,001.07	-	21,304,001.07
资产合计	-	21,304,001.07	-	21,304,001.07
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	-	21,304,001.07	-	21,304,001.07

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保持不变	
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）
	所有外币相对人民币升值 5%	1,065,200.05
	所有外币相对人民币贬值 5%	-1,065,200.05

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	81,815,299.64	93.10
交易性金融资产－基金投资	-	-

交易性金融资产－债券投资	5,114,746.58	5.82
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	86,930,046.22	98.92

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%	8,481,748.56
	业绩比较基准下降 10%	-8,481,748.56

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	81,815,299.64
第二层次	5,114,746.58
第三层次	-
合计	86,930,046.22

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 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	81,815,299.64	87.44
	其中：股票	81,815,299.64	87.44
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,114,746.58	5.47

	其中：债券	5,114,746.58	5.47
	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	5,317,116.03	5.68
8	其他各项资产	1,319,421.55	1.41
9	合计	93,566,583.80	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 21,304,001.07 元，占净值比例 24.24%。

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	285,668.00	0.33
B	采矿业	4,024,869.00	4.58
C	制造业	25,467,953.57	28.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,996,460.00	3.41
E	建筑业	1,714,627.00	1.95
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	2,679,049.00	3.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,411,530.00	1.61
J	金融业	18,843,266.00	21.44
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	792,050.00	0.90
M	科学研究和技术服务业	1,488,370.00	1.69
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	807,456.00	0.92

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	60,511,298.57	68.86

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

无。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	180,365.47	0.21
非日常生活消费品	4,352,159.17	4.95
日常消费品	598,038.57	0.68
能源	399,037.40	0.45
金融	7,702,662.58	8.76
医疗保健	749,987.69	0.85
工业	483,255.98	0.55
信息技术	1,519,345.19	1.73
通信服务	4,237,175.05	4.82
公用事业	207,395.67	0.24
房地产	874,578.30	1.00
合计	21,304,001.07	24.24

注：以上分类采用财汇大智慧提供的国际通用行业分类标准。

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

7.3.1 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	00700	腾讯控股	7,800	3,577,944.63	4.07
2	601398	工商银行	235,300	1,785,927.00	2.03
2	01398	工商银行	123,000	697,696.47	0.79
4	09988	阿里巴巴-W	23,500	2,353,104.59	2.68
5	300750	宁德时代	8,600	2,169,092.00	2.47
6	601318	中国平安	29,300	1,625,564.00	1.85
6	02318	中国平安	11,000	500,067.78	0.57
8	600900	长江电力	69,000	2,079,660.00	2.37
9	600519	贵州茅台	1,400	1,973,328.00	2.25
10	000333	美的集团	25,700	1,855,540.00	2.11
11	00005	汇丰控股	21,200	1,835,700.63	2.09
12	601288	农业银行	225,900	1,328,292.00	1.51
12	01288	农业银行	80,000	408,553.60	0.46
14	600036	招商银行	21,000	964,950.00	1.10

14	03968	招商银行	11,000	550,225.03	0.63
16	600919	江苏银行	124,900	1,491,306.00	1.70
17	600887	伊利股份	53,400	1,488,792.00	1.69
18	603259	药明康德	21,400	1,488,370.00	1.69
19	601899	紫金矿业	75,900	1,480,050.00	1.68
20	000725	京东方 A	346,400	1,382,136.00	1.57
21	000001	平安银行	107,700	1,299,939.00	1.48
22	601857	中国石油	143,700	1,228,635.00	1.40
22	00857	中国石油股份	4,000	24,622.65	0.03
24	601169	北京银行	182,000	1,243,060.00	1.41
25	601688	华泰证券	67,600	1,203,956.00	1.37
26	688981	中芯国际	10,200	899,334.00	1.02
26	00981	中芯国际	7,000	285,349.16	0.32
28	601919	中远海控	78,700	1,183,648.00	1.35
29	600050	中国联通	219,500	1,172,130.00	1.33
30	000100	TCL 科技	267,000	1,156,110.00	1.32
31	603993	洛阳钼业	131,500	1,107,230.00	1.26
32	002463	沪电股份	25,700	1,094,306.00	1.25
33	601989	中国重工	231,800	1,075,552.00	1.22
34	000166	申万宏源	210,100	1,054,702.00	1.20
35	01810	小米集团-W	18,800	1,027,822.37	1.17
36	600104	上汽集团	63,900	1,025,595.00	1.17
37	600703	三安光电	82,200	1,020,924.00	1.16
38	601901	方正证券	128,000	1,012,480.00	1.15
39	601319	中国人保	114,800	999,908.00	1.14
40	601766	中国中车	139,700	983,488.00	1.12
41	600039	四川路桥	99,000	980,100.00	1.12
42	000425	徐工机械	125,700	976,689.00	1.11
43	002001	新 和 成	44,791	952,704.57	1.08
44	600018	上港集团	161,100	919,881.00	1.05
45	600025	华能水电	96,000	916,800.00	1.04
46	600016	民生银行	191,700	910,575.00	1.04
47	601689	拓普集团	18,700	883,575.00	1.01
48	000895	双汇发展	36,000	878,760.00	1.00
49	600089	特变电工	73,100	872,083.00	0.99
50	600372	中航机载	71,700	864,702.00	0.98
51	600019	宝钢股份	130,200	858,018.00	0.98
52	000977	浪潮信息	16,700	849,696.00	0.97
53	300015	爱尔眼科	64,700	807,456.00	0.92
54	601009	南京银行	69,400	806,428.00	0.92
55	002027	分众传媒	108,500	792,050.00	0.90
56	03690	美团-W	6,100	697,030.74	0.79
57	00388	香港交易所	1,800	687,464.39	0.78

58	601881	中国银河	39,400	675,710.00	0.77
59	600015	华夏银行	83,900	663,649.00	0.76
60	01299	友邦保险	10,200	654,853.06	0.75
61	600160	巨化股份	22,400	642,432.00	0.73
62	600958	东方证券	63,800	617,584.00	0.70
63	605499	东鹏饮料	1,900	596,695.00	0.68
64	00941	中国移动	7,500	595,731.34	0.68
65	01211	比亚迪股份	4,000	446,855.50	0.51
65	002594	比亚迪	400	132,764.00	0.15
67	601006	大秦铁路	87,200	575,520.00	0.65
68	03988	中国银行	128,000	532,286.98	0.61
69	601186	中国铁建	64,400	515,844.00	0.59
70	000063	中兴通讯	14,400	467,856.00	0.53
71	601336	新华保险	7,700	450,450.00	0.51
72	02888	渣打集团	3,650	435,716.03	0.50
73	601166	兴业银行	17,200	401,448.00	0.46
74	06160	百济神州	2,500	336,965.53	0.38
75	002714	牧原股份	6,800	285,668.00	0.33
76	03328	交通银行	39,000	259,632.17	0.30
77	02628	中国人寿	15,000	257,717.07	0.29
78	09987	百胜中国	800	256,367.38	0.29
79	01801	信达生物	3,500	250,239.08	0.28
80	00011	恒生银行	2,300	246,664.24	0.28
81	002230	科大讯飞	5,000	239,400.00	0.27
82	00267	中信股份	23,000	226,108.88	0.26
83	02328	中国财险	16,000	221,786.24	0.25
84	601668	中国建筑	37,900	218,683.00	0.25
85	01109	华润置地	9,000	218,320.83	0.25
86	00998	中信银行	32,000	218,284.35	0.25
87	09633	农夫山泉	5,800	212,101.33	0.24
88	601898	中煤能源	19,100	208,954.00	0.24
89	00992	联想集团	24,000	206,173.66	0.23
90	00288	万洲国际	29,000	199,671.45	0.23
91	06690	海尔智家	9,600	196,543.46	0.22
92	02057	中通快递-W	1,550	195,772.87	0.22
93	00883	中国海洋石油	12,000	193,917.05	0.22
94	00688	中国海外发展	15,000	186,311.39	0.21
95	06618	京东健康	4,750	186,265.79	0.21
96	01088	中国神华	6,500	180,497.70	0.21
97	01378	中国宏桥	11,000	180,365.47	0.21
98	02688	新奥能源	3,100	177,255.72	0.20
99	601818	光大银行	42,100	174,715.00	0.20
100	00083	信和置业	22,000	167,525.22	0.19

101	01658	邮储银行	33,000	164,917.04	0.19
102	03692	翰森制药	6,000	162,783.08	0.19
103	01929	周大福	12,800	156,651.12	0.18
104	01209	华润万象生活	4,400	152,277.41	0.17
105	01972	太古地产	8,400	150,143.45	0.17
106	000768	中航西飞	4,500	123,030.00	0.14
107	600010	包钢股份	57,500	102,925.00	0.12
108	09992	泡泡玛特	400	97,250.35	0.11
109	000776	广发证券	5,000	84,050.00	0.10
110	00175	吉利汽车	5,000	72,773.61	0.08
111	01024	快手-W	1,100	63,499.08	0.07
112	300059	东方财富	2,100	48,573.00	0.06
113	600989	宝丰能源	2,900	46,806.00	0.05
114	600660	福耀玻璃	800	45,608.00	0.05
115	00669	创科实业	500	39,350.64	0.04
116	02015	理想汽车-W	400	39,031.46	0.04
117	300014	亿纬锂能	800	36,648.00	0.04
118	02388	中银香港	1,000	31,097.50	0.04
119	00002	中电控股	500	30,139.95	0.03
120	00001	长和	500	22,023.59	0.03
121	09868	小鹏汽车-W	300	19,315.10	0.02
122	02020	安踏体育	200	17,235.86	0.02
123	603501	豪威集团	100	12,765.00	0.01

注：上表中股票名称以报告期末名称为准。

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

7.3.2 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所有股票投资明细

注：上表中股票名称以报告期末名称为准。

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

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	00700	腾讯控股	12,348,277.83	14.05
2	09988	阿里巴巴-W	9,726,674.41	11.07
3	00005	汇丰控股	6,237,443.84	7.10
4	601899	紫金矿业	3,879,433.00	4.41
4	02899	紫金矿业	1,038,493.76	1.18
5	000333	美的集团	4,805,497.00	5.47
6	002594	比亚迪	3,279,127.00	3.73

6	01211	比亚迪股份	981,176.01	1.12
7	601398	工商银行	2,730,827.00	3.11
7	01398	工商银行	1,431,224.56	1.63
8	300750	宁德时代	3,598,532.20	4.09
9	03690	美团-W	3,557,534.78	4.05
10	603259	药明康德	3,555,933.00	4.05
11	600519	贵州茅台	3,500,646.00	3.98
12	01810	小米集团-W	3,418,205.88	3.89
13	01299	友邦保险	3,368,337.47	3.83
14	601857	中国石油	2,133,854.00	2.43
14	00857	中国石油股份	1,114,696.91	1.27
15	601318	中国平安	2,071,529.00	2.36
15	02318	中国平安	911,269.52	1.04
16	600050	中国联通	2,719,717.00	3.09
17	601288	农业银行	1,752,992.00	1.99
17	01288	农业银行	904,746.26	1.03
18	000725	京东方 A	2,629,742.00	2.99
19	600900	长江电力	2,574,565.00	2.93
20	600039	四川路桥	2,564,615.00	2.92
21	300059	东方财富	2,550,211.00	2.90
22	300308	中际旭创	2,460,028.00	2.80
23	600036	招商银行	1,362,127.00	1.55
23	03968	招商银行	1,068,804.08	1.22
24	601728	中国电信	2,140,841.00	2.44
24	00728	中国电信	248,479.39	0.28
25	000100	TCL 科技	2,331,249.00	2.65
26	601919	中远海控	2,286,026.00	2.60
27	600887	伊利股份	2,266,240.00	2.58
28	600015	华夏银行	2,255,649.00	2.57
29	600919	江苏银行	2,245,444.00	2.56
30	00941	中国移动	2,198,090.53	2.50
31	603501	豪威集团	2,166,042.00	2.46
32	300015	爱尔眼科	2,153,129.00	2.45
33	601688	华泰证券	2,106,840.00	2.40
34	600926	杭州银行	2,069,811.00	2.36
35	601998	中信银行	1,422,972.00	1.62
35	00998	中信银行	617,417.72	0.70
36	000166	申万宏源	2,006,505.00	2.28
37	601169	北京银行	1,961,704.00	2.23
38	600025	华能水电	1,955,560.00	2.23
39	000776	广发证券	1,893,834.00	2.15
40	002001	新 和 成	1,890,201.00	2.15
41	600031	三一重工	1,883,073.00	2.14

42	601211	XD 国泰海	1,807,449.00	2.06
43	03988	中国银行	1,805,100.44	2.05
44	000617	中油资本	1,768,418.00	2.01

注：1. “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。

2. 对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算累计买入金额参与排序，并按照不同股票分别披露。

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

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	占期末基金资产净值比例(%)
1	00700	腾讯控股	10,060,524.76	11.45
2	09988	阿里巴巴-W	8,533,294.69	9.71
3	00005	汇丰控股	5,424,697.71	6.17
4	002594	比亚迪	3,439,990.00	3.91
4	01211	比亚迪股份	589,979.79	0.67
5	601899	紫金矿业	2,811,573.00	3.20
5	02899	紫金矿业	1,209,003.83	1.38
6	01810	小米集团-W	3,483,825.19	3.96
7	01299	友邦保险	3,193,490.13	3.63
8	300308	中际旭创	3,054,365.00	3.48
9	000333	美的集团	3,031,181.00	3.45
10	03690	美团-W	2,777,123.40	3.16
11	300059	东方财富	2,585,782.00	2.94
12	603259	药明康德	2,496,050.00	2.84
13	601728	中国电信	2,103,205.00	2.39
13	00728	中国电信	236,180.10	0.27
14	603501	豪威集团	2,314,810.00	2.63
15	600926	杭州银行	2,235,481.00	2.54
16	00857	中国石油股份	1,182,886.83	1.35
16	601857	中国石油	915,274.00	1.04
17	601998	中信银行	1,583,523.00	1.80
17	00998	中信银行	489,410.08	0.56
18	002736	国信证券	1,979,790.00	2.25
19	000776	广发证券	1,951,515.00	2.22
20	600031	三一重工	1,932,462.00	2.20
21	000617	中油资本	1,920,535.00	2.19
22	601398	工商银行	1,026,800.00	1.17
22	01398	工商银行	869,002.82	0.99
23	601211	XD 国泰海	1,870,953.00	2.13
24	002493	荣盛石化	1,779,667.00	2.03

注：1. “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。

2. 对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算累计卖出金额参与排序，并按照不同股票分别披露。

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	252,433,402.91
卖出股票收入（成交）总额	185,950,300.05

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	5,114,746.58	5.82
	其中：政策性金融债	5,114,746.58	5.82
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	5,114,746.58	5.82

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	210203	21 国开 03	50,000	5,114,746.58	5.82

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

基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，

参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

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 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行、南京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。

7.12.2 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

按照基金合同的约定，本基金不投资股票。

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	113,277.82
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,206,143.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,319,421.55

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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（%）
兴证全球中证沪港深 300 指数增强 A	620	80,952.02	13,836,715.87	27.57	36,353,534.13	72.43
兴证全球中证沪港深 300 指数增强 C	1,138	27,238.50	0.00	0.00	30,997,412.38	100.00
合计	1,758	46,181.83	13,836,715.87	17.04	67,350,946.51	82.96

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	兴证全球中证沪港深 300 指数增强 A	387,204.38	0.7715
	兴证全球中证沪港深 300 指数增强 C	51,433.64	0.1659
	合计	438,638.02	0.5403

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	兴证全球中证沪港深 300 指数增强 A	0
	兴证全球中证沪港深 300 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	兴证全球中证沪港深 300 指数增强 A	10~50
	兴证全球中证沪港深 300 指数增强 C	0
	合计	10~50

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	兴证全球中证沪港深 300 指数增强 A	兴证全球中证沪港深 300 指数增强 C
基金合同生效日（2025 年 4 月 1 日）基金份额总额	105,026,771.97	206,332,493.60
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	18,339,097.65	7,897,481.63
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	73,175,619.62	183,232,562.85
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	50,190,250.00	30,997,412.38

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，基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。

陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

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

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。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 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。

10.6.2 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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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(%)	
中信证券	3	438,274,188.44	99.98	93,342.52	99.97	-
兴业证券	3	109,514.52	0.02	32.49	0.03	-

注：1. 报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：新增兴业证券交易单元 3 个，新增中信证券交易单元 3 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。

10.7.2 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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
中信证券	-	-	498,000,000.00	100.00	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

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	兴证全球中证沪港深 300 指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	证券时报、指定互联网网站	2025 年 4 月 2 日
2	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	证券时报、指定互联网网站	2025 年 4 月 9 日
3	兴证全球中证沪港深 300 指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告	证券时报、指定互联网网站	2025 年 4 月 29 日
4	关于开展兴证全球中证沪港深 300 指数增强型证券投资基金网上直销申购费率优惠活动的公告	证券时报、指定互联网网站	2025 年 4 月 29 日
5	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	证券时报、指定互联网网站	2025 年 6 月 6 日
6	关于调整网上直销部分赎回转购优惠费率的公告	证券时报、指定互联网网站	2025 年 6 月 16 日
7	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	证券时报、指定互联网网站	2025 年 6 月 24 日
8	兴证全球中证沪港深 300 指数增强型证券投资基金暂停申购（含定投）、赎回、转换业务的公告	证券时报、指定互联网网站	2025 年 6 月 27 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

无

§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中证沪港深 300 指数增强型证券投资基金募集注册的文件；

2、《兴证全球中证沪港深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》；

3、《兴证全球中证沪港深 300 指数增强型证券投资基金托管协议》；

4、关于申请募集兴证全球中证沪港深 300 指数增强型证券投资基金之法律意见；

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

2025 年 8 月 29 日