

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

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。

基金托管人中国农业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 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 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                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 8         |
| 3.3 其他指标                                | 11        |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>11</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 11        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 12        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 12        |
| 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                | 13        |
| 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        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>14</b> |
| 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 | 14        |
| 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       | 14        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>15</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 15        |
| 6.2 利润表                                 | 16        |
| 6.3 净资产变动表                              | 17        |
| 6.4 报表附注                                | 20        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>49</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 49        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 50        |
| 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       | 51        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 59        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 61        |
| 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      | 61        |
| 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   | 61        |

|                                             |           |
|---------------------------------------------|-----------|
| 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 ..... | 61        |
| 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 .....    | 61        |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                   | 61        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 61        |
| 7.12 投资组合报告附注 .....                         | 62        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>63</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 63        |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人 .....                      | 64        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 64        |
| 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....      | 64        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>65</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>65</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 65        |
| 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 .....      | 65        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 66        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 66        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 66        |
| 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 .....         | 66        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 66        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 67        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>68</b> |
| 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 .....    | 68        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 68        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>68</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 68        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 68        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 69        |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

|                     |                           |                         |                         |
|---------------------|---------------------------|-------------------------|-------------------------|
| 基金名称                | 兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF） |                         |                         |
| 基金简称                | 兴全沪深 300 指数（LOF）          |                         |                         |
| 场内简称                | 兴全 300                    |                         |                         |
| 基金主代码               | 163407                    |                         |                         |
| 前端交易代码              | 163407                    |                         |                         |
| 后端交易代码              | 163408                    |                         |                         |
| 基金运作方式              | 上市契约型开放式（LOF）             |                         |                         |
| 基金合同生效日             | 2010 年 11 月 2 日           |                         |                         |
| 基金管理人               | 兴证全球基金管理有限公司              |                         |                         |
| 基金托管人               | 中国农业银行股份有限公司              |                         |                         |
| 报告期末基金份<br>额总额      | 2,764,437,916.36 份        |                         |                         |
| 基金合同存续期             | 不定期                       |                         |                         |
| 基金份额上市的<br>证券交易所    | 深圳证券交易所                   |                         |                         |
| 上市日期                | 2011 年 1 月 19 日           |                         |                         |
| 下属分级基金的基<br>金简称     | 兴全沪深 300 指数增强<br>（LOF）A   | 兴全沪深 300 指数增强<br>（LOF）C | 兴全沪深 300 指数增强<br>（LOF）Y |
| 下属分级基金的场<br>内简称     | 兴全 300                    | 无                       | —                       |
| 下属分级基金的交<br>易代码     | 163407                    | 007230                  | 022962                  |
| 下属分级基金的前<br>端交易代码   | 163407                    | —                       | —                       |
| 下属分级基金的后<br>端交易代码   | 163408                    | —                       | —                       |
| 报告期末下属分级<br>基金的份额总额 | 2,525,928,807.03 份        | 231,490,483.62 份        | 7,018,625.71 份          |

注：1、本基金 A 类份额场内扩位简称：兴全沪深 300LOF。  
2、自 2019 年 6 月 5 日起增设兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）C 类份额，仅 A 类份额上市交易。详情请见管理人网站公告。

2.2 基金产品说明

|      |                                                                                                                                                                  |
|------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 本基金采用指数复制结合相对增强的投资策略，即通过指数复制的方法拟合、跟踪沪深 300 指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的组合管理，谋求基金资产的长期增值。本基金力争日均跟踪误差不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，日均下方跟踪误差不超过 0.3%，年下方跟踪误差不超过 4.75%。 |
| 投资策略 | 本基金采用指数复制结合相对增强的投资策略，即通过指数复制的方法拟合、跟踪沪深 300 指数，并在严格控制跟踪误差和下方                                                                                                      |

|        |                                                                                                                                                                      |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | 跟踪误差的前提下进行相对增强的组合管理。（详见本基金基金合同及招募说明书）                                                                                                                                |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数×95%+同业存款利率×5%                                                                                                                                              |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型基金，预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数增强型基金，跟踪标的指数市场表现，追求接近或超越沪深 300 指数所代表的市场平均收益，是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。投资者可在二级市场买卖基金份额，受市场供需关系等各种因素的影响，投资者买卖基金份额有可能面临相应的折溢价风险。 |

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                        | 中国农业银行股份有限公司                    |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 杨卫东                                 | 任航                              |
|             | 联系电话 | 021-20398888                        | 010-66060069                    |
|             | 电子邮箱 | yangwd@xqfunds.com                  | tgxxpl@abchina.com              |
| 客户服务电话      |      | 4006780099，021-38824536             | 95599                           |
| 传真          |      | 021-20398988                        | 010-68121816                    |
| 注册地址        |      | 上海市黄浦区金陵东路 368 号                    | 北京东城区建国门内大街 69 号                |
| 办公地址        |      | 上海市浦东新区芳甸路 1155 号<br>嘉里城办公楼 28-29 楼 | 北京市西城区复兴门内大街 28<br>号凯晨世贸中心东座 F9 |
| 邮政编码        |      | 201204                              | 100031                          |
| 法定代表人       |      | 庄园芳                                 | 谷澍                              |

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 | <a href="http://www.xqfunds.com">http://www.xqfunds.com</a> |
| 基金中期报告备置地点          | 基金管理人、基金托管人的办公场所                                            |

2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称           | 办公地址                                       |
|--------|--------------|--------------------------------------------|
| 注册登记机构 | 兴证全球基金管理有限公司 | 上海市浦东新区锦康路 308<br>号陆家嘴世纪金融广场 6 号<br>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 | 报告期(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日) |                          |                          |
|---------------|-------------------------------------|--------------------------|--------------------------|
|               | 兴全沪深 300 指数增强<br>(LOF) A            | 兴全沪深 300 指数增强<br>(LOF) C | 兴全沪深 300 指数增强<br>(LOF) Y |
| 本期已实现         | 132,613,059.25                      | 11,221,162.63            | 355,244.32               |

|                       |                       |                |               |
|-----------------------|-----------------------|----------------|---------------|
| 收益                    |                       |                |               |
| 本期利润                  | -16,536,820.84        | -3,488,960.38  | 380,028.48    |
| 加权平均基金<br>份额本期<br>利润  | -0.0060               | -0.0130        | 0.0655        |
| 本期加权平<br>均净值利润<br>率   | -0.25%                | -0.56%         | 2.75%         |
| 本期基金份<br>额净值增长<br>率   | -0.06%                | -0.26%         | 0.18%         |
| 3.1.2 期<br>末数据和<br>指标 | 报告期末(2025 年 6 月 30 日) |                |               |
| 期末可供分<br>配利润          | 3,620,254,830.18      | 319,547,905.78 | 10,104,321.37 |
| 期末可供分<br>配基金份额<br>利润  | 1.4332                | 1.3804         | 1.4396        |
| 期末基金资<br>产净值          | 6,146,183,637.21      | 551,038,389.40 | 17,122,947.08 |
| 期末基金份<br>额净值          | 2.4332                | 2.3804         | 2.4396        |
| 3.1.3 累<br>计期末指<br>标  | 报告期末(2025 年 6 月 30 日) |                |               |
| 基金份额累<br>计净值增长<br>率   | 143.32%               | 29.92%         | 0.56%         |

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴全沪深 300 指数增强（LOF）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      | 2.52%    | 0.53%       | 2.37%      | 0.55%         | 0.15%   | -0.02% |
| 过去三个月      | 1.85%    | 1.00%       | 1.21%      | 1.04%         | 0.64%   | -0.04% |
| 过去六个月      | -0.06%   | 0.95%       | 0.07%      | 0.97%         | -0.13%  | -0.02% |
| 过去一年       | 12.56%   | 1.21%       | 13.12%     | 1.32%         | -0.56%  | -0.11% |
| 过去三年       | 1.84%    | 1.03%       | -11.43%    | 1.05%         | 13.27%  | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 143.32%  | 1.29%       | 14.94%     | 1.29%         | 128.38% | 0.00%  |

兴全沪深 300 指数增强（LOF）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      | 2.48%    | 0.53%       | 2.37%      | 0.55%         | 0.11%  | -0.02% |
| 过去三个月      | 1.75%    | 1.00%       | 1.21%      | 1.04%         | 0.54%  | -0.04% |
| 过去六个月      | -0.26%   | 0.95%       | 0.07%      | 0.97%         | -0.33% | -0.02% |
| 过去一年       | 12.12%   | 1.21%       | 13.12%     | 1.32%         | -1.00% | -0.11% |
| 过去三年       | 0.63%    | 1.03%       | -11.43%    | 1.05%         | 12.06% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 29.92%   | 1.13%       | 9.57%      | 1.13%         | 20.35% | 0.00%  |

兴全沪深 300 指数增强（LOF）Y

| 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 | 2.56%    | 0.53%       | 2.37%      | 0.55%         | 0.19% | -0.02% |
| 过去三个月 | 1.97%    | 1.00%       | 1.21%      | 1.04%         | 0.76% | -0.04% |

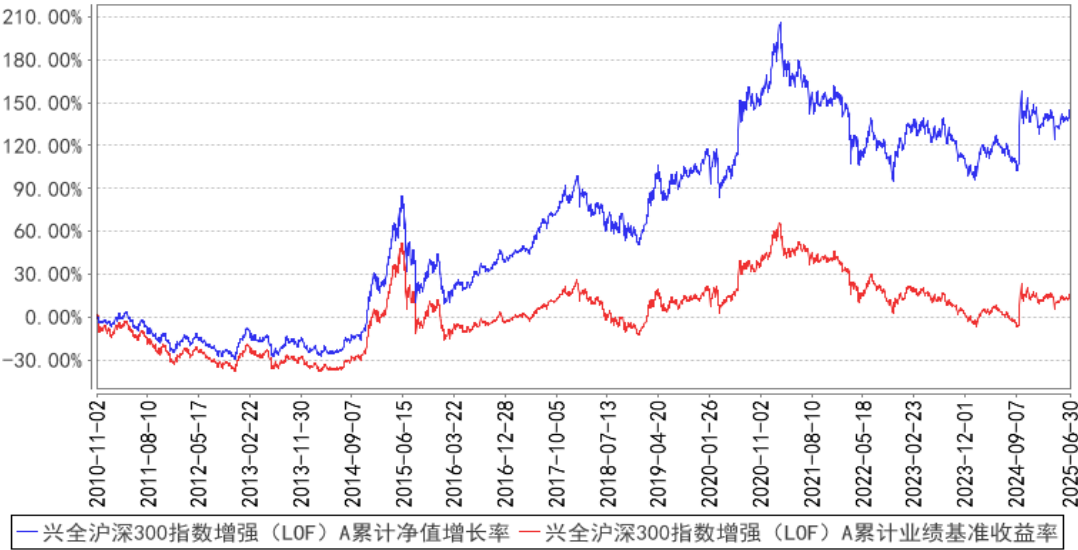
|                |       |       |       |       |        |        |
|----------------|-------|-------|-------|-------|--------|--------|
| 过去六个月          | 0.18% | 0.94% | 0.07% | 0.97% | 0.11%  | -0.03% |
| 自基金合同生效<br>起至今 | 0.56% | 0.92% | 0.63% | 0.94% | -0.07% | -0.02% |

注：1、本基金业绩比较基准为沪深 300 指数×95%+同业存款利率×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。

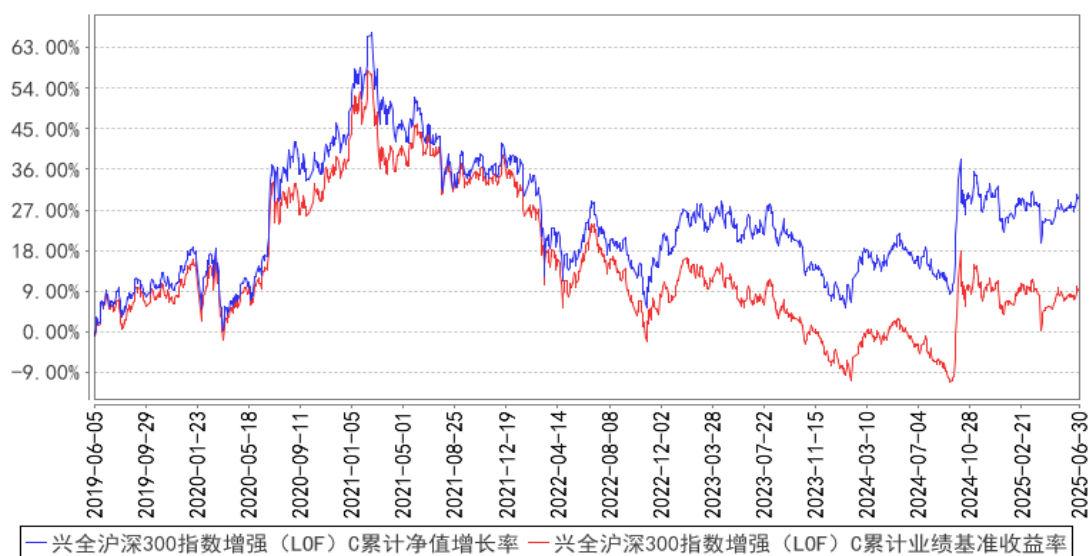
2、本基金 C 类基金份额于 2019 年 6 月 5 日开始运作，本基金 Y 类基金份额于 2024 年 12 月 17 日开始运作。

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

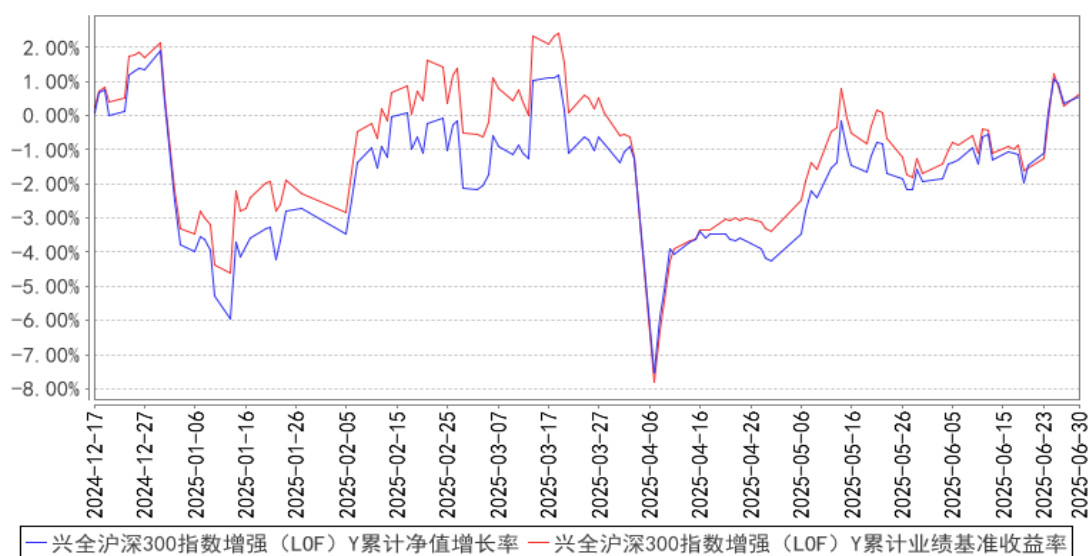
兴全沪深300指数增强（LOF）A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



兴全沪深300指数增强（LOF）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



兴全沪深300指数增强（LOF）Y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《兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》的规定，本基金建仓期为 2010 年 11 月 02 日起共计六个月。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

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

4、本基金 Y 类基金份额于 2024 年 12 月 17 日开始运作。

3.3 其他指标

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金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 |        |                                                                                                                  |
| 申庆 | 兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）、兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金基金经理 | 2010 年 11 月 2 日 | —    | 28 年   | 硕士，历任兴业证券研究发展中心研究员，兴证全球基金管理有限公司行业研究员，兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理助理、兴全全球视野股票型证券投资基金基金经理、基金管理部总监助理、兴全恒益债券型证券投资基金基金经理。 |

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

第 11 页 共 69 页

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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 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

2025 年上半年虽然仍是“强预期、弱现实”，但预期本身比往年更“强”，现实也没有那么“弱”，所以市场走得并不差。

1. 起点：去年底调整后估值回到合理区间。

2. 催化：以 DeepSeek 为代表的“AI 爆款”点燃史上最强春季躁动，A/H 共振，成交激增。

3. 冲击：突发关税事件重创风险偏好，但充裕的流动性迅速修复情绪，行情“V”型反转。

短期：估值已抬升却看不到新的显性风险；降准降息+类平准资金把尾部风险压到极低。

长期：流动性只能“投票”，最终要靠 ROE “称重”。更高的估值水平能否站稳，关键看盈利能否匹配。

在尾部风险骤降的当下，需要冷静回答三个核心问题：

1. 资本化率距离历史顶部还有多少空间？
2. 资本化率继续抬升要靠哪些路径？
3. 当前价格里包含了多少一次性重估、包含了多少对 ROE 修复的定价？

想清楚上述三点，才能对下一阶段形成清晰的投资立场。

操作上，我们维持“行业与风格总体均衡、行业和风格内做相对综合价值比较”的策略，并将价值投资做深做精，不过度追求短期波动。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，兴全沪深 300 指数增强（LOF）A 的基金份额净值为 2.4332 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.06%，同期业绩比较基准收益率为 0.07%；兴全沪深 300 指数增强（LOF）C 的基金份额净值为 2.3804 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.26%，同期业绩比较基准收益率为 0.07%；兴全沪深 300 指数增强（LOF）Y 的基金份额净值为 2.4396 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.18%，同期业绩比较基准收益率为 0.07%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

关于宏观，不做细节预测，只根据逻辑判断大致方向，并随局势应变。展望 2025 年下半年，抢出口红利退坡后，内需将成为更核心的驱动。PPI 连续 30 余月负增长后，均值回归的引力正在累积，企业利润率有望随之温和修复；叠加海外步入降息通道，国内流动性环境可继续改善。

关于市场，上半年“强预期、弱现实”的剧本基本兑现，但 DeepSeek 等催化剂显著抬升了风险偏好。当前负债结构仍显脆弱：代表长钱、理性钱的主动权益产品未见明显流入，而两融等短线博弈资金一旦过热即构成潜在波动源。我们此前判断——“无风险收益率下行+监管着力提升投资者获得感，将推动超额储蓄向权益资产再配置，为市场引入长期稳定资金”——虽然有所兑现，后续持续性与规模值得更高更久期待。

#### 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》、《兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》及其他相关法律法规的规定，本报告期内，本基金未实施利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人——兴证全球基金管理有限公司报告期内基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本托管人认为，兴证全球基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 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

本托管人认为，兴证全球基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，

未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）

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<br>2025 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|-----------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资 产：      |         |                        |                          |
| 货币资金      | 6.4.7.1 | 40,727.93              | 134,742.18               |
| 结算备付金     |         | 11,008,257.16          | 5,202,927.16             |
| 存出保证金     |         | 346,705.80             | 518,188.75               |
| 交易性金融资产   | 6.4.7.2 | 7,132,308,577.96       | 7,982,692,083.25         |
| 其中：股票投资   |         | 6,415,721,730.61       | 7,335,135,049.27         |
| 基金投资      |         | -                      | -                        |
| 债券投资      |         | 716,586,847.35         | 647,557,033.98           |
| 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     |         | 25,056,613.20          | 1,686,194.52             |
| 应收股利      |         | -                      | -                        |
| 应收申购款     |         | 3,524,501.78           | 28,412,836.97            |
| 递延所得税资产   |         | -                      | -                        |
| 其他资产      | 6.4.7.8 | -                      | -                        |
| 资产总计      |         | 7,172,285,383.83       | 8,018,646,972.83         |
| 负债和净资产    | 附注号     | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
| 负 债：      |         |                        |                          |
| 短期借款      |         | -                      | -                        |
| 交易性金融负债   |         | -                      | -                        |
| 衍生金融负债    | 6.4.7.3 | -                      | -                        |
| 卖出回购金融资产款 |         | 390,295,305.11         | 332,547,269.06           |

|          |          |                  |                  |
|----------|----------|------------------|------------------|
| 应付清算款    |          | -                | -                |
| 应付赎回款    |          | 61,813,874.03    | 34,905,428.69    |
| 应付管理人报酬  |          | 4,455,954.09     | 5,343,337.97     |
| 应付托管费    |          | 835,491.37       | 1,001,875.89     |
| 应付销售服务费  |          | 186,507.37       | 242,428.92       |
| 应付投资顾问费  |          | -                | -                |
| 应交税费     |          | 2,077.89         | 9,939.46         |
| 应付利润     |          | -                | -                |
| 递延所得税负债  |          | -                | -                |
| 其他负债     | 6.4.7.9  | 351,200.28       | 823,498.27       |
| 负债合计     |          | 457,940,410.14   | 374,873,778.26   |
| 净资产：     |          |                  |                  |
| 实收基金     | 6.4.7.10 | 2,764,437,916.36 | 3,145,466,908.10 |
| 其他综合收益   | 6.4.7.11 | -                | -                |
| 未分配利润    | 6.4.7.12 | 3,949,907,057.33 | 4,498,306,286.47 |
| 净资产合计    |          | 6,714,344,973.69 | 7,643,773,194.57 |
| 负债和净资产总计 |          | 7,172,285,383.83 | 8,018,646,972.83 |

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，兴全沪深 300 指数增强（LOF）A 基金份额净值 2.4332 元，基金份额总额 2,525,928,807.03 份；兴全沪深 300 指数增强（LOF）C 基金份额净值 2.3804 元，基金份额总额 231,490,483.62 份；兴全沪深 300 指数增强（LOF）Y 基金份额净值 2.4396 元，基金份额总额 7,018,625.71 份。兴全沪深 300 指数（LOF）份额总额合计为 2,764,437,916.36 份。

6.2 利润表

会计主体：兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                    | 附注号      | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024<br>年 6 月 30 日 |
|------------------------|----------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 一、营业总收入                |          | 18,661,527.03                            | 304,910,913.51                                |
| 1. 利息收入                |          | 52,233.72                                | 78,773.60                                     |
| 其中：存款利息收入              | 6.4.7.13 | 35,223.68                                | 73,579.79                                     |
| 债券利息收入                 |          | -                                        | -                                             |
| 资产支持证券<br>利息收入         |          | -                                        | -                                             |
| 买入返售金融<br>资产收入         |          | 17,010.04                                | 5,193.81                                      |
| 其他利息收入                 |          | -                                        | -                                             |
| 2. 投资收益（损失以<br>“-” 填列） |          | 181,288,846.84                           | 81,387,093.47                                 |
| 其中：股票投资收益              | 6.4.7.14 | 79,589,420.85                            | 3,399,604.56                                  |

|                            |            |                 |                |
|----------------------------|------------|-----------------|----------------|
| 基金投资收益                     |            | -               | -              |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.15   | 15,618,458.15   | 7,393,709.98   |
| 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   | 86,080,967.84   | 70,593,778.93  |
| 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   | -163,835,218.94 | 222,473,498.39 |
| 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   | 1,155,665.41    | 971,548.05     |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 38,307,279.77   | 31,380,476.75  |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 28,361,239.30   | 23,858,321.76  |
| 其中：暂估管理人报酬                 |            | -               | -              |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 5,317,732.44    | 4,473,435.36   |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 1,238,708.23    | 984,873.06     |
| 4. 投资顾问费                   |            | -               | -              |
| 5. 利息支出                    |            | 3,001,982.09    | 1,464,165.21   |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 3,001,982.09    | 1,464,165.21   |
| 6. 信用减值损失                  | 6.4.7.22   | -               | -              |
| 7. 税金及附加                   |            | 847.12          | 965.56         |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.23   | 386,770.59      | 598,715.80     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | -19,645,752.74  | 273,530,436.76 |
| 减：所得税费用                    |            | -               | -              |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | -19,645,752.74  | 273,530,436.76 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | -               | -              |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | -19,645,752.74  | 273,530,436.76 |

### 6.3 净资产变动表

会计主体：兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                       | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |        |                   |                   |
|------------------------------------------|---------------------------------------|--------|-------------------|-------------------|
|                                          | 实收基金                                  | 其他综合收益 | 未分配利润             | 净资产合计             |
| 一、上期期末净资产                                | 3,145,466,908.10                      | -      | 4,498,306,286.47  | 7,643,773,194.57  |
| 加：会计政策变更                                 | -                                     | -      | -                 | -                 |
| 前期差错更正                                   | -                                     | -      | -                 | -                 |
| 其他                                       | -                                     | -      | -                 | -                 |
| 二、本期期初净资产                                | 3,145,466,908.10                      | -      | 4,498,306,286.47  | 7,643,773,194.57  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -381,028,991.74                       | -      | -548,399,229.14   | -929,428,220.88   |
| （一）、综合收益总额                               | -                                     | -      | -19,645,752.74    | -19,645,752.74    |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数<br>（净资产减少以“-”号填列）  | -381,028,991.74                       | -      | -528,753,476.40   | -909,782,468.14   |
| 其中：1. 基金申购款                              | 410,152,810.71                        | -      | 554,981,116.96    | 965,133,927.67    |
| 2. 基金赎回款                                 | -791,181,802.45                       | -      | -1,083,734,593.36 | -1,874,916,395.81 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | -                                     | -      | -                 | -                 |
| （四）、其他综合收益结转留存收益                         | -                                     | -      | -                 | -                 |
| 四、本期期末净资产                                | 2,764,437,916.36                      | -      | 3,949,907,057.33  | 6,714,344,973.69  |

| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |        |                  |                   |
|------------------------------------------|--------------------------------------------|--------|------------------|-------------------|
|                                          | 实收基金                                       | 其他综合收益 | 未分配利润            | 净资产合计             |
| 一、上期期末净资产                                | 2,606,762,162.77                           | -      | 2,768,536,409.11 | 5,375,298,571.88  |
| 加：会计政策变更                                 | -                                          | -      | -                | -                 |
| 前期差错更正                                   | -                                          | -      | -                | -                 |
| 其他                                       | -                                          | -      | -                | -                 |
| 二、本期期初净资产                                | 2,606,762,162.77                           | -      | 2,768,536,409.11 | 5,375,298,571.88  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | 324,700,597.12                             | -      | 626,757,812.76   | 951,458,409.88    |
| （一）、综合收益总额                               | -                                          | -      | 273,530,436.76   | 273,530,436.76    |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）      | 324,700,597.12                             | -      | 353,227,376.00   | 677,927,973.12    |
| 其中：1. 基金申购款                              | 884,050,899.47                             | -      | 989,369,719.65   | 1,873,420,619.12  |
| 2. 基金赎回款                                 | -559,350,302.35                            | -      | -636,142,343.65  | -1,195,492,646.00 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | -                                          | -      | -                | -                 |
| （四）、其他综合收益结转留存收益                         | -                                          | -      | -                | -                 |
| 四、本期期末净资产                                | 2,931,462,759.89                           | -      | 3,395,294,221.87 | 6,326,756,981.76  |

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

兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金(LOF)(原名兴业沪深 300 指数增强型证券投资基金(LOF))，(以下简称“本基金”)，系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2010]1068 号《关于核准兴业沪深 300 指数增强型证券投资基金(LOF)募集的批复》的核准，由兴证全球基金管理有限公司作为管理人向社会公开发行募集，基金合同于 2010 年 11 月 2 日正式生效，首次设立募集规模为 2,955,476,122.49 份基金份额。本基金为契约型上市开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为兴证全球基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。本基金于 2011 年 1 月 1 日起更名为兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金(LOF)。自 2019 年 6 月 5 日起增设兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）C 类份额，仅 A 类份额上市交易。

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括投资于国内依法发行上市的股票、债券、权证以及经中国证监会批准允许本基金投资的其它金融工具。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 90%。现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-10%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券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。权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

本基金的业绩基准为：沪深 300 指数×95%+同业存款利率×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

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 06 月 30 日的财务状况以及 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日上海证券交易所发布的《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<br>2025 年 6 月 30 日 |
|--------|------------------------|
| 活期存款   | 40,727.93              |
| 等于：本金  | 40,710.68              |
| 加：应计利息 | 17.25                  |
| 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             | 40,727.93 |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 |              |                  |                |
|---------------|-------|------------------------|--------------|------------------|----------------|
|               |       | 成本                     | 应计利息         | 公允价值             | 公允价值变动         |
| 股票            |       | 5,907,574,800.58       | -            | 6,415,721,730.61 | 508,146,930.03 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                      | -            | -                | -              |
| 债券            | 交易所市场 | 318,695,935.36         | 1,122,696.44 | 352,669,104.87   | 32,850,473.07  |
|               | 银行间市场 | 361,225,210.00         | 2,999,742.48 | 363,917,742.48   | -307,210.00    |
|               | 合计    | 679,921,145.36         | 4,122,438.92 | 716,586,847.35   | 32,543,263.07  |
| 资产支持证券        |       | -                      | -            | -                | -              |
| 基金            |       | -                      | -            | -                | -              |
| 其他            |       | -                      | -            | -                | -              |
| 合计            |       | 6,587,495,945.94       | 4,122,438.92 | 7,132,308,577.96 | 540,690,193.10 |

#### 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<br>2025 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | 131,701.14             |
| 应付证券出借违约金   | -                      |
| 应付交易费用      | 123,718.69             |
| 其中：交易所市场    | 110,760.42             |
| 银行间市场       | 12,958.27              |
| 应付利息        | -                      |
| 预提费用        | 95,780.45              |
| 合计          | 351,200.28             |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

兴全沪深 300 指数增强（LOF）A

| 项目            | 本期                              |                  |
|---------------|---------------------------------|------------------|
|               | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |                  |
|               | 基金份额（份）                         | 账面金额             |
| 上年度末          | 2,847,412,006.58                | 2,847,412,006.58 |
| 本期申购          | 283,669,997.48                  | 283,669,997.48   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -605,153,197.03                 | -605,153,197.03  |
| 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           | 2,525,928,807.03                | 2,525,928,807.03 |

兴全沪深 300 指数增强（LOF）C

| 项目            | 本期                              |                 |
|---------------|---------------------------------|-----------------|
|               | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |                 |
|               | 基金份额（份）                         | 账面金额            |
| 上年度末          | 295,756,341.03                  | 295,756,341.03  |
| 本期申购          | 120,963,855.00                  | 120,963,855.00  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -185,229,712.41                 | -185,229,712.41 |
| 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           | 231,490,483.62                  | 231,490,483.62  |

兴全沪深 300 指数增强（LOF）Y

| 项目            | 本期                              |              |
|---------------|---------------------------------|--------------|
|               | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |              |
|               | 基金份额（份）                         | 账面金额         |
| 上年度末          | 2,298,560.49                    | 2,298,560.49 |
| 本期申购          | 5,518,958.23                    | 5,518,958.23 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -798,893.01                     | -798,893.01  |
| 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           | 7,018,625.71                    | 7,018,625.71 |

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

兴全沪深 300 指数增强（LOF）A

| 项目             | 已实现部分            | 未实现部分           | 未分配利润合计          |
|----------------|------------------|-----------------|------------------|
| 上年度末           | 4,424,097,445.51 | -339,153,311.61 | 4,084,944,133.90 |
| 加：会计政策变更       | -                | -               | -                |
| 前期差错更正         | -                | -               | -                |
| 其他             | -                | -               | -                |
| 本期期初           | 4,424,097,445.51 | -339,153,311.61 | 4,084,944,133.90 |
| 本期利润           | 132,613,059.25   | -149,149,880.09 | -16,536,820.84   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -506,329,360.56  | 58,176,877.68   | -448,152,482.88  |
| 其中：基金申购款       | 443,472,533.61   | -55,528,282.21  | 387,944,251.40   |
| 基金赎回款          | -949,801,894.17  | 113,705,159.89  | -836,096,734.28  |
| 本期已分配利润        | -                | -               | -                |
| 本期末            | 4,050,381,144.20 | -430,126,314.02 | 3,620,254,830.18 |

## 兴全沪深 300 指数增强（LOF）C

| 项目             | 已实现部分           | 未实现部分          | 未分配利润合计         |
|----------------|-----------------|----------------|-----------------|
| 上年度末           | 418,287,770.69  | -8,224,568.51  | 410,063,202.18  |
| 加：会计政策变更       | -               | -              | -               |
| 前期差错更正         | -               | -              | -               |
| 其他             | -               | -              | -               |
| 本期期初           | 418,287,770.69  | -8,224,568.51  | 410,063,202.18  |
| 本期利润           | 11,221,162.63   | -14,710,123.01 | -3,488,960.38   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -91,900,277.48  | 4,873,941.46   | -87,026,336.02  |
| 其中：基金申购款       | 172,287,789.24  | -12,793,463.63 | 159,494,325.61  |
| 基金赎回款          | -264,188,066.72 | 17,667,405.09  | -246,520,661.63 |
| 本期已分配利润        | -               | -              | -               |
| 本期末            | 337,608,655.84  | -18,060,750.06 | 319,547,905.78  |

## 兴全沪深 300 指数增强（LOF）Y

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末           | 3,572,733.74  | -273,783.35   | 3,298,950.39  |
| 加：会计政策变更       | -             | -             | -             |
| 前期差错更正         | -             | -             | -             |
| 其他             | -             | -             | -             |
| 本期期初           | 3,572,733.74  | -273,783.35   | 3,298,950.39  |
| 本期利润           | 355,244.32    | 24,784.16     | 380,028.48    |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 7,371,196.09  | -945,853.59   | 6,425,342.50  |
| 其中：基金申购款       | 8,630,651.36  | -1,088,111.41 | 7,542,539.95  |
| 基金赎回款          | -1,259,455.27 | 142,257.82    | -1,117,197.45 |
| 本期已分配利润        | -             | -             | -             |
| 本期末            | 11,299,174.15 | -1,194,852.78 | 10,104,321.37 |

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 5,548.61                              |
| 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 | 12,276.75                             |
| 其他        | 17,398.32                             |
| 合计        | 35,223.68                             |

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<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |
|------------------|----------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 79,589,420.85              |
| 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               | 79,589,420.85              |

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<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 1,075,301,222.89                      |
| 减：卖出股票成本总额 | 994,859,311.38                        |
| 减：交易费用     | 852,490.66                            |
| 买卖股票差价收入   | 79,589,420.85                         |

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<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 5,907,528.72               |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 9,710,929.43               |
| 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             | 15,618,458.15 |

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<br>2025年1月1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   | 544,363,016.11             |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 526,474,036.91             |
| 减：应计利息总额               | 8,157,882.30               |
| 减：交易费用                 | 20,167.47                  |
| 买卖债券差价收入               | 9,710,929.43               |

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 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
| 股票投资产生的股利收益   | 86,080,967.84                   |
| 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            | 86,080,967.84                   |

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 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
| 1. 交易性金融资产             | -163,835,218.94                 |
| 股票投资                   | -178,734,348.09                 |
| 债券投资                   | 14,899,129.15                   |
| 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                     | -163,835,218.94                 |

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期                              |
|---------|---------------------------------|
|         | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
| 基金赎回费收入 | 1,027,907.26                    |
| 基金转换费收入 | 127,758.15                      |
| 合计      | 1,155,665.41                    |

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<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用    | 27,273.08                             |
| 信息披露费   | 59,507.37                             |
| 证券出借违约金 | -                                     |
| 银行费用    | 14,021.53                             |
| 账户维护费用  | 27,600.00                             |
| 指数使用费   | 258,368.61                            |
| 合计      | 386,770.59                            |

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、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）   | 基金托管人、基金销售机构        |
| 兴业证券股份有限公司（“兴业证券”）     | 基金管理人的股东、基金销售机构     |

注：下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|-------|---------------------------------------|--------------------------------------------|
|-------|---------------------------------------|--------------------------------------------|

|      | 成交金额             | 占当期股票<br>成交总额<br>的比例<br>(%) | 成交金额           | 占当期股票<br>成交总额的比例<br>(%) |
|------|------------------|-----------------------------|----------------|-------------------------|
| 兴业证券 | 1,211,288,159.44 | 100.00                      | 691,423,621.29 | 100.00                  |

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |                             | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |                      |
|-------|---------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------------------|----------------------|
|       | 成交金额                                  | 占当期债券<br>成交总额<br>的比例<br>(%) | 成交金额                                       | 占当期债券<br>成交总额的比例 (%) |
| 兴业证券  | 381,131,335.71                        | 100.00                      | 6,752,415.12                               | 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<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |                            | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |                            |
|-------|---------------------------------------|----------------------------|--------------------------------------------|----------------------------|
|       | 成交金额                                  | 占当期债券回<br>购<br>成交总额的比例 (%) | 成交金额                                       | 占当期债券回<br>购<br>成交总额的比例 (%) |
| 兴业证券  | 8,798,683,000.00                      | 100.00                     | 4,237,624,000.00                           | 100.00                     |

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日      |                    |              |                         |
|-------|--------------------------------------------|--------------------|--------------|-------------------------|
|       | 当期佣金                                       | 占当期佣金总量的<br>比例 (%) | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例<br>(%) |
| 兴业证券  | 237,709.77                                 | 100.00             | 110,760.42   | 100.00                  |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |                    |              |                         |

|      | 当期<br>佣金   | 占当期佣金总量<br>的比例（%） | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例<br>（%） |
|------|------------|-------------------|--------------|-------------------------|
| 兴业证券 | 375,848.91 | 100.00            | 191,092.03   | 100.00                  |

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<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024<br>年 6 月 30 日 |
|----------------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费       | 28,361,239.30                            | 23,858,321.76                                 |
| 其中：应支付销售机构的客户维<br>护费 | 8,591,637.08                             | 8,029,921.78                                  |
| 应支付基金管理人的净管理费        | 19,769,602.22                            | 15,828,399.98                                 |

注：兴全沪深 300 指数增强（LOF）A 的基金管理费按 A 类基金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 A 类基金管理费=A 类基金前一日基金资产净值×0.80%/当年天数。兴全沪深 300 指数增强（LOF）C 的基金管理费按 C 类基金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 C 类基金管理费=C 类基金前一日基金资产净值×0.80%/当年天数。兴全沪深 300 指数增强（LOF）Y 的基金管理费按 Y 类基金前一日基金资产净值的 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 Y 类基金管理费=Y 类基金前一日基金资产净值×0.40%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024<br>年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 5,317,732.44                             | 4,473,435.36                                  |

注：兴全沪深 300 指数增强（LOF）A 的基金托管费按 A 类基金前一日的基金资产净值的 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 A 类基金托管费=A 类基金前一日基金资产净值×0.15%/当年天数；兴全沪深 300 指数增强（LOF）C 的基金托管费按

C 类基金前一日的基金资产净值的 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 C 类基金托管费=C 类基金前一日基金资产净值×0.15%/当年天数；兴全沪深 300 指数增强（LOF）Y 的基金托管费按 Y 类基金前一日的基金资产净值的 0.075%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 Y 类基金托管费=Y 类基金前一日基金资产净值×0.075%/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<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日      |                     |                     |           |
|----------------|--------------------------------------------|---------------------|---------------------|-----------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |                     |                     |           |
|                | 兴全沪深 300 指数增强（LOF）A                        | 兴全沪深 300 指数增强（LOF）C | 兴全沪深 300 指数增强（LOF）Y | 合计        |
|                |                                            |                     |                     |           |
| 兴业证券           | -                                          | 26,347.73           | -                   | 26,347.73 |
| 兴证全球基金         | -                                          | 50,630.02           | -                   | 50,630.02 |
| 合计             | -                                          | 76,977.75           | -                   | 76,977.75 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |                     |                     |           |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |                     |                     |           |
|                | 兴全沪深 300 指数增强（LOF）A                        | 兴全沪深 300 指数增强（LOF）C | 兴全沪深 300 指数增强（LOF）Y | 合计        |
|                |                                            |                     |                     |           |
| 兴业证券           | -                                          | 11,910.00           | -                   | 11,910.00 |
| 兴证全球基金         | -                                          | 36,991.73           | -                   | 36,991.73 |
| 合计             | -                                          | 48,901.73           | -                   | 48,901.73 |

注：A 类、Y 类份额不收取销售服务费，C 类份额的基金销售服务费按 C 类基金前一日资产净值 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：本基金本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

的证券出借业务。

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金管理人本报告期末及上年度末均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月<br>30 日 |          | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |           |
|-------|------------------------------------------|----------|--------------------------------------------|-----------|
|       | 期末余额                                     | 当期利息收入   | 期末余额                                       | 当期利息收入    |
| 农业银行  | 40,727.93                                | 5,548.61 | 3,156,869.97                               | 18,301.32 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行过利润分配。

6.4.12 期末（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 |
| 00133                | 信    | 202   | 6 个月 | 新      | 12.8 | 28.05  | 80       | 1,024.00 | 2,244.00 | -  |

|        |      |                       |                  |                            |       |       |           |               |               |   |
|--------|------|-----------------------|------------------|----------------------------|-------|-------|-----------|---------------|---------------|---|
| 5      | 凯科技  | 5 年<br>4 月<br>2 日     |                  | 股<br>流<br>通<br>受<br>限      | 0     |       |           |               |               |   |
| 001356 | 富岭股份 | 2025 年<br>1 月<br>16 日 | 6 个月             | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 5.30  | 14.44 | 709       | 3,757.70      | 10,237.96     | - |
| 001382 | 新亚电缆 | 2025 年<br>3 月<br>13 日 | 6 个月             | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 7.40  | 20.21 | 366       | 2,708.40      | 7,396.86      | - |
| 001388 | 信通电子 | 2025 年<br>6 月<br>24 日 | 1 个月<br>内<br>(含) | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 16.42 | 16.42 | 843       | 13,842.06     | 13,842.06     | - |
| 001388 | 信通电子 | 2025 年<br>6 月<br>24 日 | 6 个月             | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 16.42 | 16.42 | 94        | 1,543.48      | 1,543.48      | - |
| 001390 | 古麒绒材 | 2025 年<br>5 月<br>21 日 | 6 个月             | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 12.08 | 18.12 | 178       | 2,150.24      | 3,225.36      | - |
| 001395 | 亚联机械 | 2025 年<br>1 月<br>20 日 | 6 个月             | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 19.08 | 47.25 | 80        | 1,526.40      | 3,780.00      | - |
| 002044 | 美年健  | 2025 年<br>6 月         | 6 个月             | 大<br>宗<br>交                | 4.70  | 4.74  | 7,400,000 | 34,780,000.00 | 35,076,000.00 | - |

|        |      |                 |      |                                 |       |       |         |              |              |        |
|--------|------|-----------------|------|---------------------------------|-------|-------|---------|--------------|--------------|--------|
|        | 康    | 26<br>日         |      | 易<br>购<br>入<br>流<br>通<br>受<br>限 |       |       |         |              |              |        |
| 002957 | 科瑞技术 | 2025 年 3 月 6 日  | 6 个月 | 非公开发<br>行流通<br>受限               | 12.12 | 16.03 | 271,185 | 3,286,762.20 | 4,347,095.55 | -      |
| 301173 | 毓恬冠佳 | 2025 年 2 月 24 日 | 6 个月 | 新股流<br>通受限                      | 28.33 | 44.98 | 173     | 4,901.09     | 7,781.54     | -      |
| 301275 | 汉朔科技 | 2025 年 3 月 4 日  | 6 个月 | 新股流<br>通受限                      | 27.50 | 56.19 | 397     | 10,917.50    | 22,307.43    | -      |
| 301458 | 钧崑电子 | 2025 年 1 月 2 日  | 6 个月 | 新股流<br>通受限                      | 10.40 | 34.11 | 701     | 7,290.40     | 23,911.11    | -      |
| 301479 | 弘景光电 | 2025 年 3 月 6 日  | 6 个月 | 新股流<br>通受限                      | 41.90 | 77.87 | 130     | 5,447.00     | 10,123.10    | -      |
| 301479 | 弘景光电 | 2025 年 5 月 28   | 4 个月 | 新股流<br>通                        | -     | 77.87 | 52      | -            | 4,049.24     | 注<br>1 |

|        |      | 日          |     | 受<br>限<br>-<br>转<br>增 |       |        |     |          |           |    |
|--------|------|------------|-----|-----------------------|-------|--------|-----|----------|-----------|----|
| 301501 | 恒鑫生活 | 2025年3月11日 | 6个月 | 新股流通受限                | 39.92 | 45.22  | 241 | 9,620.72 | 10,898.02 | -  |
| 301501 | 恒鑫生活 | 2025年6月6日  | 3个月 | 新股流通受限-转增             | -     | 45.22  | 109 | -        | 4,928.98  | 注2 |
| 301535 | 浙江华远 | 2025年3月18日 | 6个月 | 新股流通受限                | 4.92  | 18.99  | 734 | 3,611.28 | 13,938.66 | -  |
| 301560 | 众捷汽车 | 2025年4月17日 | 6个月 | 新股流通受限                | 16.50 | 27.45  | 190 | 3,135.00 | 5,215.50  | -  |
| 301590 | 优优绿能 | 2025年5月28日 | 6个月 | 新股流通受限                | 89.60 | 139.48 | 73  | 6,540.80 | 10,182.04 | -  |
| 301595 | 太力科技 | 2025年5月12日 | 6个月 | 新股流通受限                | 17.05 | 29.10  | 196 | 3,341.80 | 5,703.60  | -  |

|        |      |                 |      |        |       |       |         |              |              |   |
|--------|------|-----------------|------|--------|-------|-------|---------|--------------|--------------|---|
| 301601 | 惠通科技 | 2025 年 1 月 8 日  | 6 个月 | 新股流通受限 | 11.80 | 33.85 | 342     | 4,035.60     | 11,576.70    | - |
| 301636 | 泽润新能 | 2025 年 4 月 30 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 33.06 | 47.46 | 128     | 4,231.68     | 6,074.88     | - |
| 301658 | 首航新能 | 2025 年 3 月 26 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 11.80 | 22.98 | 437     | 5,156.60     | 10,042.26    | - |
| 301662 | 宏工科技 | 2025 年 4 月 10 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 26.60 | 82.50 | 143     | 3,803.80     | 11,797.50    | - |
| 301665 | 泰禾股份 | 2025 年 4 月 2 日  | 6 个月 | 新股流通受限 | 10.27 | 22.39 | 393     | 4,036.11     | 8,799.27     | - |
| 301678 | 新恒汇  | 2025 年 6 月 13 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 12.80 | 44.54 | 382     | 4,889.60     | 17,014.28    | - |
| 603014 | 威高血净 | 2025 年 5 月 12 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 26.50 | 32.68 | 205     | 5,432.50     | 6,699.40     | - |
| 603019 | 中科   | 2025 年          | 6 个月 | 大宗     | 55.85 | 67.38 | 100,000 | 5,585,000.00 | 6,738,000.00 | - |

|        |      |                  |      |                      |       |       |     |          |           |   |
|--------|------|------------------|------|----------------------|-------|-------|-----|----------|-----------|---|
|        | 曙光   | 4 月 25 日         |      | 交易<br>购入<br>流通<br>受限 |       |       |     |          |           |   |
| 603072 | 天和磁材 | 2024 年 12 月 24 日 | 6 个月 | 新股<br>流通<br>受限       | 12.30 | 54.45 | 226 | 2,779.80 | 12,305.70 | - |
| 603120 | 肯特催化 | 2025 年 4 月 9 日   | 6 个月 | 新股<br>流通<br>受限       | 15.00 | 33.43 | 65  | 975.00   | 2,172.95  | - |
| 603124 | 江南新材 | 2025 年 3 月 12 日  | 6 个月 | 新股<br>流通<br>受限       | 10.54 | 46.31 | 88  | 927.52   | 4,075.28  | - |
| 603210 | 泰鸿万立 | 2025 年 4 月 1 日   | 6 个月 | 新股<br>流通<br>受限       | 8.60  | 15.61 | 286 | 2,459.60 | 4,464.46  | - |
| 603257 | 中国瑞林 | 2025 年 3 月 28 日  | 6 个月 | 新股<br>流通<br>受限       | 20.52 | 37.47 | 78  | 1,600.56 | 2,922.66  | - |
| 603271 | 永杰新材 | 2025 年 3 月 4 日   | 6 个月 | 新股<br>流通<br>受限       | 20.60 | 35.08 | 126 | 2,595.60 | 4,420.08  | - |

|        |      |                 |      |           |       |       |         |              |              |   |
|--------|------|-----------------|------|-----------|-------|-------|---------|--------------|--------------|---|
| 603382 | 海阳科技 | 2025 年 6 月 5 日  | 6 个月 | 新股流通受限    | 11.50 | 22.39 | 105     | 1,207.50     | 2,350.95     | - |
| 603400 | 华之杰  | 2025 年 6 月 12 日 | 6 个月 | 新股流通受限    | 19.88 | 43.81 | 57      | 1,133.16     | 2,497.17     | - |
| 603409 | 汇通控股 | 2025 年 2 月 25 日 | 6 个月 | 新股流通受限    | 24.18 | 33.32 | 100     | 2,418.00     | 3,332.00     | - |
| 603683 | 晶华新材 | 2025 年 5 月 23 日 | 6 个月 | 非公开发行流通受限 | 8.36  | 13.61 | 543,995 | 4,547,798.20 | 7,403,771.95 | - |
| 688411 | 海博思创 | 2025 年 1 月 20 日 | 6 个月 | 新股流通受限    | 19.38 | 83.49 | 560     | 10,852.80    | 46,754.40    | - |
| 688545 | 兴福电子 | 2025 年 1 月 15 日 | 6 个月 | 新股流通受限    | 11.68 | 26.95 | 994     | 11,609.92    | 26,788.30    | - |
| 688583 | 思看科技 | 2025 年 1 月 8 日  | 6 个月 | 新股流通受限    | 33.46 | 79.68 | 175     | 5,855.50     | 13,944.00    | - |

|        |      |                 |      |             |       |        |     |           |           |     |
|--------|------|-----------------|------|-------------|-------|--------|-----|-----------|-----------|-----|
|        |      |                 |      | 限           |       |        |     |           |           |     |
| 688583 | 思看科技 | 2025 年 6 月 19 日 | 1 个月 | 新股流通受限 - 转增 | -     | 79.68  | 52  | -         | 4,143.36  | 注 3 |
| 688755 | 汉邦科技 | 2025 年 5 月 9 日  | 6 个月 | 新股流通受限      | 22.77 | 39.33  | 203 | 4,622.31  | 7,983.99  | -   |
| 688757 | 胜科纳米 | 2025 年 3 月 18 日 | 6 个月 | 新股流通受限      | 9.08  | 25.94  | 536 | 4,866.88  | 13,903.84 | -   |
| 688758 | 赛分科技 | 2025 年 1 月 2 日  | 6 个月 | 新股流通受限      | 4.32  | 16.97  | 777 | 3,356.64  | 13,185.69 | -   |
| 688775 | 影石创新 | 2025 年 6 月 4 日  | 6 个月 | 新股流通受限      | 47.27 | 124.16 | 573 | 27,085.71 | 71,143.68 | -   |

注：1、本基金持有的新股流通受限股票弘景光电，于 2025 年 5 月 28 日实施 2024 年年度权益分配方案，每股派发现金红利 1.50 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 52 股。

2、本基金持有的新股流通受限股票恒鑫生活，于 2025 年 6 月 6 日实施 2024 年年度权益分配方案，每股派发现金红利 0.50 元（含税），以资本公积金向全体股东每股转增 0.45 股。本基金新增 109 股。

3、本基金持有的新股流通受限股票思看科技，于 2025 年 6 月 19 日实施 2024 年年度权益分配方

案，每股派发现金红利 0.55 元（含税），以资本公积金向全体股东每股转增 0.30 股。本基金新增 52 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

截至本报告期末 2025 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 209,958,789.41 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码   | 债券名称     | 回购到期日          | 期末估值单价 | 数量（张）     | 期末估值总额         |
|--------|----------|----------------|--------|-----------|----------------|
| 150218 | 15 国开 18 | 2025 年 7 月 2 日 | 103.46 | 200,000   | 20,692,498.63  |
| 220207 | 22 国开 07 | 2025 年 7 月 2 日 | 102.01 | 100,000   | 10,200,547.95  |
| 230303 | 23 进出 03 | 2025 年 7 月 2 日 | 101.47 | 200,000   | 20,294,832.88  |
| 230404 | 23 农发 04 | 2025 年 7 月 2 日 | 101.67 | 200,000   | 20,333,473.97  |
| 240309 | 24 进出 09 | 2025 年 7 月 2 日 | 101.24 | 300,000   | 30,371,260.27  |
| 250301 | 25 进出 01 | 2025 年 7 月 2 日 | 100.46 | 30,000    | 3,013,763.01   |
| 220406 | 22 农发 06 | 2025 年 7 月 3 日 | 102.35 | 20,000    | 2,047,095.34   |
| 230405 | 23 农发 05 | 2025 年 7 月 3 日 | 101.27 | 200,000   | 20,253,260.27  |
| 240308 | 24 进出 08 | 2025 年 7 月 3 日 | 101.40 | 100,000   | 10,139,542.47  |
| 250206 | 25 国开 06 | 2025 年 7 月 3 日 | 100.43 | 300,000   | 30,128,917.81  |
| 250401 | 25 农发 01 | 2025 年 7 月 3 日 | 100.39 | 300,000   | 30,118,208.22  |
| 250421 | 25 农发 21 | 2025 年 7 月 3 日 | 100.08 | 200,000   | 20,015,282.19  |
| 合计     |          |                |        | 2,150,000 | 217,608,683.01 |

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 06 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 180,336,515.70 元，于 2025 年 7 月 1 日、2025 年 7 月 4 日先后到期。该类交易要求

本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。本基金管理人制定了政策和程序以识别及分析相关风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、风险管理部和审计部及合规管理部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的信用债。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA    | 319,568,686.08         | 241,933,106.22           |

|        |                |                |
|--------|----------------|----------------|
| AAA 以下 | 33,100,418.79  | 8,753,225.41   |
| 未评级    | —              | —              |
| 合计     | 352,669,104.87 | 250,686,331.63 |

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

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金为上市契约型开放式（LOF）基金，投资者可在合同规定的交易日进行基金申购与赎回业务，本基金管理人针对基金特定的运作方式，建立了相应的流动性风险监控与预警机制。本基金管理人每日预测基金的流动性需求，通过独立的风险管理部门设置流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，并按照基金类型建立并定期开展专项的流动性压力测试工作，对流动性风险进行预警。本基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款及强制赎回费条款，同时控制每日确认的净赎回申请不超过本基金投资组合 7 个工作日可变现资产的可变现价值，减少赎回业务对本基金的流动性冲击，从而控制流动性风险。此外，本基金通过预留一定的现金头寸，并且可在需要时通过卖出回购金融资产方式借入短期资金，以缓解流动性风险。

本基金所持的证券在证券交易所上市或可于银行间同业市场交易。截止本报告期末，单一投资者持有基金份额比例未超过基金总份额 50%。本报告期末，除完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合以外，本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的 30%，

本基金投资未违背法律法规对流通受限资产的相关比例要求。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为货币资金、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2025 年 6 月<br>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                      | 40,727.93      | -             | -              | -              | -        | -                | 40,727.93        |
| 结算备付金                     | 11,008,257.16  | -             | -              | -              | -        | -                | 11,008,257.16    |
| 存出保证金                     | 346,705.80     | -             | -              | -              | -        | -                | 346,705.80       |
| 交易性金融资产                   | 148,609,266.27 | 61,264,306.85 | 284,177,101.31 | 222,534,750.16 | 1,422.76 | 6,415,721.730.61 | 7,132,308.577.96 |
| 应收申购款                     | 104,371.36     | -             | -              | -              | -        | 3,420,130.42     | 3,524,501.78     |
| 应收清算款                     | -              | -             | -              | -              | -        | 25,056,613.20    | 25,056,613.20    |
| 资产总计                      | 160,109,328.52 | 61,264,306.85 | 284,177,101.31 | 222,534,750.16 | 1,422.76 | 6,444,198.474.23 | 7,172,285.383.83 |
| 负债                        |                |               |                |                |          |                  |                  |
| 应付赎回款                     | -              | -             | -              | -              | -        | 61,813,874.03    | 61,813,874.03    |
| 应付管理人报酬                   | -              | -             | -              | -              | -        | 4,455,954.09     | 4,455,954.09     |
| 应付托管费                     | -              | -             | -              | -              | -        | 835,491.37       | 835,491.37       |
| 卖出回购金融资产款                 | 390,295,305.11 | -             | -              | -              | -        | -                | 390,295,305.11   |
| 应付销售服务费                   | -              | -             | -              | -              | -        | 186,507.37       | 186,507.37       |
| 应交税费                      | -              | -             | -              | -              | -        | 2,077.89         | 2,077.89         |
| 其他负债                      | -              | -             | -              | -              | -        | 351,200.28       | 351,200.28       |
| 负债总计                      | 390,295,305.11 | -             | -              | -              | -        | 67,645,105.03    | 457,940,410.14   |
| 利率敏感度缺                    | -              | 61,264,306.85 | 284,177,101.31 | 222,534,750.16 | 1,422.76 | 6,376,553.76     | 6,714,344.97     |

|                             |                |               |                |                |       |                  |                  |
|-----------------------------|----------------|---------------|----------------|----------------|-------|------------------|------------------|
| 口                           | 230,185,976.59 | 5             | 31             | 16             |       | 369.20           | 3.69             |
| 上年度末<br>2024 年 12 月<br>31 日 | 1 个月以内         | 1-3 个月        | 3 个月-1 年       | 1-5 年          | 5 年以上 | 不计息              | 合计               |
| 资产                          |                |               |                |                |       |                  |                  |
| 货币资金                        | 134,742.18     | -             | -              | -              | -     | -                | 134,742.18       |
| 结算备付金                       | 5,202,927.16   | -             | -              | -              | -     | -                | 5,202,927.16     |
| 存出保证金                       | 518,188.75     | -             | -              | -              | -     | -                | 518,188.75       |
| 交易性金融资产                     |                | 58,525,308.01 | 399,779,863.01 | 189,251,862.96 |       | 7,335,135.049.27 | 7,982,692,083.25 |
| 应收申购款                       | 20,092,780.28  | -             | -              | -              | -     | 8,320,056.69     | 28,412,836.97    |
| 应收清算款                       |                | -             | -              | -              | -     | 1,686,194.52     | 1,686,194.52     |
| 资产总计                        | 25,948,638.37  | 58,525,308.01 | 399,779,863.01 | 189,251,862.96 |       | 7,345,141,300.48 | 8,018,646,972.83 |
| 负债                          |                |               |                |                |       |                  |                  |
| 应付赎回款                       |                | -             | -              | -              | -     | 34,905,428.69    | 34,905,428.69    |
| 应付管理人报酬                     |                | -             | -              | -              | -     | 5,343,337.97     | 5,343,337.97     |
| 应付托管费                       |                | -             | -              | -              | -     | 1,001,875.89     | 1,001,875.89     |
| 卖出回购金融资产款                   | 332,547,269.06 | -             | -              | -              | -     | -                | 332,547,269.06   |
| 应付销售服务费                     |                | -             | -              | -              | -     | 242,428.92       | 242,428.92       |
| 应交税费                        |                | -             | -              | -              | -     | 9,939.46         | 9,939.46         |
| 其他负债                        |                | -             | -              | -              | -     | 823,498.27       | 823,498.27       |
| 负债总计                        | 332,547,269.06 | -             | -              | -              | -     | 42,326,509.20    | 374,873,778.26   |
| 利率敏感度缺口                     | 306,598,630.69 | 58,525,308.01 | 399,779,863.01 | 189,251,862.96 |       | 7,302,814,791.28 | 7,643,773,194.57 |

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                       | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |

|  | 动         | 本期末（2025 年 6 月 30 日） | 上年度末（2024 年 12 月 31 日） |
|--|-----------|----------------------|------------------------|
|  | 市场利率下降 1% | 2,161,784.35         | 1,695,092.36           |
|  | 市场利率上升 1% | -2,131,282.15        | -1,679,137.22          |

注：上表反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对净资产产生的影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险，主要是基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 |                  | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |                  |
|---------------|------------------------|------------------|--------------------------|------------------|
|               | 公允价值                   | 占基金资产净值<br>比例（%） | 公允价值                     | 占基金资产净值<br>比例（%） |
| 交易性金融资产—股票投资  | 6,415,721,730.61       | 95.55            | 7,335,135,049.27         | 95.96            |
| 交易性金融资产—基金投资  | —                      | —                | —                        | —                |
| 交易性金融资产—债券投资  | 716,586,847.35         | 10.67            | 647,557,033.98           | 8.47             |
| 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            | 7,132,308,577.96       | 106.22           | 7,982,692,083.25         | 104.43           |

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）        | 上年度末（2024 年 12 月 31 日） |
|    | 业绩比较基准上升 10%                                    | 629,913,972.77              | 710,768,627.29         |
|    | 业绩比较基准下降 10%                                    | -629,913,972.77             | -710,768,627.29        |

注：本基金管理人运用 CAPM 模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对净资产产生的影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

|                                                                                                                                                                                     |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：<br><br>第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；<br><br>第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；<br><br>第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。 |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | 6,709,176,830.48       | 7,317,720,221.71         |
| 第二层次          | 369,112,563.78         | 441,611,478.22           |

|      |                  |                  |
|------|------------------|------------------|
| 第三层次 | 54,019,183.70    | 223,360,383.32   |
| 合计   | 7,132,308,577.96 | 7,982,692,083.25 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2025 年 06 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。（2024 年 12 月 31 日：无。）

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、应收款项、买入返售金融资产和其他金融负债等，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<br>(%) |
|----|-------------------|------------------|------------------|
| 1  | 权益投资              | 6,415,721,730.61 | 89.45            |
|    | 其中：股票             | 6,415,721,730.61 | 89.45            |
| 2  | 基金投资              | -                | -                |
| 3  | 固定收益投资            | 716,586,847.35   | 9.99             |
|    | 其中：债券             | 716,586,847.35   | 9.99             |
|    | 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      | 11,048,985.09    | 0.15             |
| 8  | 其他各项资产            | 28,927,820.78    | 0.40             |

|   |    |                  |        |
|---|----|------------------|--------|
| 9 | 合计 | 7,172,285,383.83 | 100.00 |
|---|----|------------------|--------|

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 2,787,148.56     | 0.04         |
| B  | 采矿业              | 484,247,945.04   | 7.21         |
| C  | 制造业              | 2,601,761,962.62 | 38.75        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 290,596,494.20   | 4.33         |
| E  | 建筑业              | 168,056,109.90   | 2.50         |
| F  | 批发和零售业           | 34,295,170.04    | 0.51         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 130,159,967.09   | 1.94         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -                | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 175,619,390.98   | 2.62         |
| J  | 金融业              | 1,882,979,787.07 | 28.04        |
| K  | 房地产业             | 83,501,424.00    | 1.24         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 211,813,604.80   | 3.15         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 1,255,447.05     | 0.02         |
| 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               | 6,067,074,451.35 | 90.36        |

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

| 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      | 229,216,051.46 | 3.41         |
| 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          | 604,740.58     | 0.01 |
| 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 | 17,393,915.01  | 0.26 |
| J | 金融业             | -              | -    |
| K | 房地产业            | 14,449,870.57  | 0.22 |
| L | 租赁和商务服务业        | -              | -    |
| M | 科学研究和技术服务业      | 193,693.48     | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业   | 125,580.51     | 0.00 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业   | -              | -    |
| P | 教育              | 15,082,434.00  | 0.22 |
| Q | 卫生和社会工作         | 71,580,993.65  | 1.07 |
| R | 文化、体育和娱乐业       | -              | -    |
| S | 综合              | -              | -    |
|   | 合计              | 348,647,279.26 | 5.19 |

7.2.3 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

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  | 601318 | 中国平安 | 6,979,000  | 387,194,920.00 | 5.77         |
| 2  | 601601 | 中国太保 | 8,689,100  | 325,928,141.00 | 4.85         |
| 3  | 600519 | 贵州茅台 | 205,300    | 289,374,456.00 | 4.31         |
| 4  | 000938 | 紫光股份 | 11,729,929 | 281,400,996.71 | 4.19         |
| 5  | 000895 | 双汇发展 | 10,657,000 | 260,137,370.00 | 3.87         |
| 6  | 601888 | 中国中免 | 3,400,000  | 207,298,000.00 | 3.09         |
| 7  | 600036 | 招商银行 | 4,270,000  | 196,206,500.00 | 2.92         |
| 8  | 600741 | 华域汽车 | 11,089,000 | 195,720,850.00 | 2.91         |

|    |        |        |            |                |      |
|----|--------|--------|------------|----------------|------|
| 9  | 000100 | TCL 科技 | 41,999,980 | 181,859,913.40 | 2.71 |
| 10 | 600900 | 长江电力   | 4,170,000  | 125,683,800.00 | 1.87 |
| 11 | 601336 | 新华保险   | 2,078,000  | 121,563,000.00 | 1.81 |
| 12 | 601166 | 兴业银行   | 5,099,918  | 119,032,086.12 | 1.77 |
| 13 | 000001 | 平安银行   | 9,460,380  | 114,186,786.60 | 1.70 |
| 14 | 601088 | 中国神华   | 2,712,008  | 109,944,804.32 | 1.64 |
| 15 | 601398 | 工商银行   | 12,979,965 | 98,517,934.35  | 1.47 |
| 16 | 601225 | 陕西煤业   | 4,888,707  | 94,058,722.68  | 1.40 |
| 17 | 600028 | 中国石化   | 14,980,000 | 84,487,200.00  | 1.26 |
| 18 | 601138 | 工业富联   | 3,910,000  | 83,595,800.00  | 1.25 |
| 19 | 601117 | 中国化学   | 10,799,937 | 82,835,516.79  | 1.23 |
| 20 | 000983 | 山西焦煤   | 12,600,044 | 80,640,281.60  | 1.20 |
| 21 | 600690 | 海尔智家   | 3,235,000  | 80,163,300.00  | 1.19 |
| 22 | 601328 | 交通银行   | 9,568,900  | 76,551,200.00  | 1.14 |
| 23 | 000157 | 中联重科   | 10,299,998 | 74,468,985.54  | 1.11 |
| 24 | 601169 | 北京银行   | 9,599,983  | 65,567,883.89  | 0.98 |
| 25 | 000858 | 五 粮 液  | 550,000    | 65,395,000.00  | 0.97 |
| 26 | 600674 | 川投能源   | 3,839,925  | 61,592,397.00  | 0.92 |
| 27 | 601360 | 三六零    | 5,799,900  | 59,158,980.00  | 0.88 |
| 28 | 601006 | 大秦铁路   | 8,789,999  | 58,013,993.40  | 0.86 |
| 29 | 001979 | 招商蛇口   | 6,577,800  | 57,687,306.00  | 0.86 |
| 30 | 300124 | 汇川技术   | 889,800    | 57,454,386.00  | 0.86 |
| 31 | 601899 | 紫金矿业   | 2,816,480  | 54,921,360.00  | 0.82 |
| 32 | 601728 | 中国电信   | 7,033,500  | 54,509,625.00  | 0.81 |
| 33 | 002938 | 鹏鼎控股   | 1,578,600  | 50,562,558.00  | 0.75 |
| 34 | 000800 | 一汽解放   | 7,311,700  | 50,158,262.00  | 0.75 |
| 35 | 601988 | 中国银行   | 8,903,800  | 50,039,356.00  | 0.75 |
| 36 | 601985 | 中国核电   | 5,269,935  | 49,115,794.20  | 0.73 |
| 37 | 600309 | 万华化学   | 878,859    | 47,686,889.34  | 0.71 |
| 38 | 601668 | 中国建筑   | 8,159,900  | 47,082,623.00  | 0.70 |
| 39 | 600760 | 中航沈飞   | 789,900    | 46,303,938.00  | 0.69 |
| 40 | 000333 | 美的集团   | 630,500    | 45,522,100.00  | 0.68 |
| 41 | 600000 | 浦发银行   | 3,279,300  | 45,516,684.00  | 0.68 |
| 42 | 000651 | 格力电器   | 939,991    | 42,224,395.72  | 0.63 |
| 43 | 601916 | 浙商银行   | 12,151,900 | 41,194,941.00  | 0.61 |
| 44 | 600161 | 天坛生物   | 2,118,732  | 40,658,467.08  | 0.61 |
| 45 | 000725 | 京东方 A  | 10,179,970 | 40,618,080.30  | 0.60 |
| 46 | 601229 | 上海银行   | 3,819,736  | 40,527,398.96  | 0.60 |
| 47 | 002252 | 上海莱士   | 5,875,600  | 40,365,372.00  | 0.60 |
| 48 | 600019 | 宝钢股份   | 5,979,000  | 39,401,610.00  | 0.59 |
| 49 | 600406 | 国电南瑞   | 1,735,907  | 38,901,675.87  | 0.58 |
| 50 | 600584 | 长电科技   | 1,151,200  | 38,783,928.00  | 0.58 |
| 51 | 000063 | 中兴通讯   | 1,184,500  | 38,484,405.00  | 0.57 |

|    |        |      |           |               |      |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 52 | 600276 | 恒瑞医药 | 716,819   | 37,202,906.10 | 0.55 |
| 53 | 000538 | 云南白药 | 662,272   | 36,948,154.88 | 0.55 |
| 54 | 603799 | 华友钴业 | 984,850   | 36,459,147.00 | 0.54 |
| 55 | 603993 | 洛阳钼业 | 4,292,300 | 36,141,166.00 | 0.54 |
| 56 | 600795 | 国电电力 | 7,019,900 | 33,976,316.00 | 0.51 |
| 57 | 601607 | 上海医药 | 1,827,998 | 32,684,604.24 | 0.49 |
| 58 | 601600 | 中国铝业 | 4,604,100 | 32,412,864.00 | 0.48 |
| 59 | 601009 | 南京银行 | 2,750,000 | 31,955,000.00 | 0.48 |
| 60 | 601818 | 光大银行 | 7,599,800 | 31,539,170.00 | 0.47 |
| 61 | 600372 | 中航机载 | 2,439,994 | 29,426,327.64 | 0.44 |
| 62 | 600009 | 上海机场 | 922,400   | 29,304,648.00 | 0.44 |
| 63 | 600893 | 航发动力 | 760,302   | 29,302,039.08 | 0.44 |
| 64 | 002352 | 顺丰控股 | 588,636   | 28,701,891.36 | 0.43 |
| 65 | 601939 | 建设银行 | 2,989,900 | 28,224,656.00 | 0.42 |
| 66 | 601390 | 中国中铁 | 4,988,800 | 27,987,168.00 | 0.42 |
| 67 | 601658 | 邮储银行 | 5,050,000 | 27,623,500.00 | 0.41 |
| 68 | 600104 | 上汽集团 | 1,680,000 | 26,964,000.00 | 0.40 |
| 69 | 002142 | 宁波银行 | 971,300   | 26,574,768.00 | 0.40 |
| 70 | 600332 | 白云山  | 917,200   | 24,177,392.00 | 0.36 |
| 71 | 600016 | 民生银行 | 4,971,133 | 23,612,881.75 | 0.35 |
| 72 | 000568 | 泸州老窖 | 200,400   | 22,725,360.00 | 0.34 |
| 73 | 600660 | 福耀玻璃 | 397,900   | 22,684,279.00 | 0.34 |
| 74 | 600196 | 复星医药 | 831,100   | 20,852,299.00 | 0.31 |
| 75 | 000768 | 中航西飞 | 739,900   | 20,228,866.00 | 0.30 |
| 76 | 300413 | 芒果超媒 | 902,348   | 19,689,233.36 | 0.29 |
| 77 | 000338 | 潍柴动力 | 1,270,000 | 19,532,600.00 | 0.29 |
| 78 | 601898 | 中煤能源 | 1,690,500 | 18,494,070.00 | 0.28 |
| 79 | 600362 | 江西铜业 | 783,313   | 18,353,023.59 | 0.27 |
| 80 | 601628 | 中国人寿 | 438,078   | 18,044,432.82 | 0.27 |
| 81 | 600436 | 片仔癀  | 69,613    | 13,923,296.13 | 0.21 |
| 82 | 600025 | 华能水电 | 1,379,900 | 13,178,045.00 | 0.20 |
| 83 | 600585 | 海螺水泥 | 605,373   | 12,997,358.31 | 0.19 |
| 84 | 600048 | 保利发展 | 1,365,400 | 11,059,740.00 | 0.16 |
| 85 | 002601 | 龙佰集团 | 645,352   | 10,461,155.92 | 0.16 |
| 86 | 600482 | 中国动力 | 449,600   | 10,372,272.00 | 0.15 |
| 87 | 601186 | 中国铁建 | 1,162,211 | 9,309,310.11  | 0.14 |
| 88 | 688009 | 中国通号 | 1,597,600 | 8,211,664.00  | 0.12 |
| 89 | 688036 | 传音控股 | 98,000    | 7,810,600.00  | 0.12 |
| 90 | 600515 | 海南机场 | 2,097,000 | 7,423,380.00  | 0.11 |
| 91 | 000002 | 万科 A | 1,141,900 | 7,330,998.00  | 0.11 |
| 92 | 600886 | 国投电力 | 478,300   | 7,050,142.00  | 0.11 |
| 93 | 601877 | 正泰电器 | 299,624   | 6,792,476.08  | 0.10 |
| 94 | 603019 | 中科曙光 | 100,000   | 6,738,000.00  | 0.10 |

|     |        |       |           |              |      |
|-----|--------|-------|-----------|--------------|------|
| 95  | 601012 | 隆基绿能  | 434,826   | 6,531,086.52 | 0.10 |
| 96  | 600018 | 上港集团  | 1,118,000 | 6,383,780.00 | 0.10 |
| 97  | 002415 | 海康威视  | 228,600   | 6,339,078.00 | 0.09 |
| 98  | 600085 | 同仁堂   | 165,700   | 5,975,142.00 | 0.09 |
| 99  | 601688 | 华泰证券  | 281,500   | 5,013,515.00 | 0.07 |
| 100 | 601021 | 春秋航空  | 85,787    | 4,774,046.55 | 0.07 |
| 101 | 300408 | 三环集团  | 135,285   | 4,518,519.00 | 0.07 |
| 102 | 002027 | 分众传媒  | 618,576   | 4,515,604.80 | 0.07 |
| 103 | 002241 | 歌尔股份  | 191,899   | 4,475,084.68 | 0.07 |
| 104 | 601766 | 中国中车  | 597,500   | 4,206,400.00 | 0.06 |
| 105 | 688303 | 大全能源  | 182,035   | 3,880,986.20 | 0.06 |
| 106 | 002001 | 新 和 成 | 166,700   | 3,545,709.00 | 0.05 |
| 107 | 603986 | 兆易创新  | 27,000    | 3,416,310.00 | 0.05 |
| 108 | 601111 | 中国国航  | 373,900   | 2,950,071.00 | 0.04 |
| 109 | 300498 | 温氏股份  | 163,182   | 2,787,148.56 | 0.04 |
| 110 | 600938 | 中国海油  | 98,004    | 2,558,884.44 | 0.04 |
| 111 | 601998 | 中信银行  | 300,000   | 2,550,000.00 | 0.04 |
| 112 | 601808 | 中海油服  | 175,600   | 2,416,256.00 | 0.04 |
| 113 | 688472 | 阿特斯   | 262,008   | 2,397,373.20 | 0.04 |
| 114 | 000776 | 广发证券  | 132,300   | 2,223,963.00 | 0.03 |
| 115 | 002179 | 中航光电  | 49,522    | 1,998,707.92 | 0.03 |
| 116 | 603833 | 欧派家居  | 34,974    | 1,974,282.30 | 0.03 |
| 117 | 600999 | 招商证券  | 96,242    | 1,692,896.78 | 0.03 |
| 118 | 000963 | 华东医药  | 39,905    | 1,610,565.80 | 0.02 |
| 119 | 000792 | 盐湖股份  | 91,000    | 1,554,280.00 | 0.02 |
| 120 | 600030 | 中信证券  | 50,000    | 1,381,000.00 | 0.02 |
| 121 | 600570 | 恒生电子  | 39,000    | 1,308,060.00 | 0.02 |
| 122 | 603259 | 药明康德  | 18,051    | 1,255,447.05 | 0.02 |
| 123 | 600941 | 中国移动  | 11,000    | 1,238,050.00 | 0.02 |
| 124 | 600111 | 北方稀土  | 49,600    | 1,235,040.00 | 0.02 |
| 125 | 300760 | 迈瑞医疗  | 4,800     | 1,078,800.00 | 0.02 |
| 126 | 600150 | 中国船舶  | 33,000    | 1,073,820.00 | 0.02 |
| 127 | 002236 | 大华股份  | 51,416    | 816,486.08   | 0.01 |
| 128 | 603296 | 华勤技术  | 8,295     | 669,240.60   | 0.01 |
| 129 | 600588 | 用友网络  | 50,043    | 669,074.91   | 0.01 |
| 130 | 600489 | 中金黄金  | 40,000    | 585,200.00   | 0.01 |
| 131 | 601669 | 中国电建  | 111,600   | 543,492.00   | 0.01 |
| 132 | 600031 | 三一重工  | 29,241    | 524,875.95   | 0.01 |
| 133 | 300122 | 智飞生物  | 21,000    | 411,390.00   | 0.01 |
| 134 | 601878 | 浙商证券  | 28,980    | 316,171.80   | 0.00 |
| 135 | 601618 | 中国中冶  | 100,000   | 298,000.00   | 0.00 |
| 136 | 601838 | 成都银行  | 10,000    | 201,000.00   | 0.00 |
| 137 | 600438 | 通威股份  | 10,000    | 167,500.00   | 0.00 |

|     |        |      |       |            |      |
|-----|--------|------|-------|------------|------|
| 138 | 301269 | 华大九天 | 1,168 | 144,691.84 | 0.00 |
| 139 | 688599 | 天合光能 | 3,154 | 45,827.62  | 0.00 |
| 140 | 001391 | 国货航  | 4,686 | 31,536.78  | 0.00 |
| 141 | 300433 | 蓝思科技 | 287   | 6,400.10   | 0.00 |
| 142 | 002916 | 深南电路 | 23    | 2,479.63   | 0.00 |

注：上表中股票名称以报告期末名称为准。

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

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  | 002044 | 美年健康  | 14,497,808 | 71,558,733.12 | 1.07         |
| 2  | 002841 | 视源股份  | 2,028,893  | 70,199,697.80 | 1.05         |
| 3  | 002773 | 康弘药业  | 2,111,900  | 61,181,743.00 | 0.91         |
| 4  | 300353 | 东土科技  | 1,548,880  | 33,068,588.00 | 0.49         |
| 5  | 002728 | 特一药业  | 1,920,201  | 16,148,890.41 | 0.24         |
| 6  | 002607 | 中公教育  | 4,928,900  | 15,082,434.00 | 0.22         |
| 7  | 000069 | 华侨城 A | 5,295,300  | 11,914,425.00 | 0.18         |
| 8  | 000066 | 中国长城  | 589,800    | 8,729,040.00  | 0.13         |
| 9  | 300659 | 中孚信息  | 552,105    | 8,027,606.70  | 0.12         |
| 10 | 603683 | 晶华新材  | 543,995    | 7,403,771.95  | 0.11         |
| 11 | 003005 | 竞业达   | 328,176    | 6,632,436.96  | 0.10         |
| 12 | 002957 | 科瑞技术  | 271,185    | 4,347,095.55  | 0.06         |
| 13 | 000510 | 新金路   | 782,580    | 3,983,332.20  | 0.06         |
| 14 | 300601 | 康泰生物  | 244,200    | 3,709,398.00  | 0.06         |
| 15 | 600195 | 中牧股份  | 440,000    | 3,225,200.00  | 0.05         |
| 16 | 300695 | 兆丰股份  | 39,440     | 3,075,925.60  | 0.05         |
| 17 | 300142 | 沃森生物  | 235,900    | 2,594,900.00  | 0.04         |
| 18 | 600383 | 金地集团  | 668,983    | 2,535,445.57  | 0.04         |
| 19 | 603031 | 安孚科技  | 78,336     | 2,317,962.24  | 0.03         |
| 20 | 300454 | 深信服   | 15,800     | 1,488,044.00  | 0.02         |
| 21 | 300450 | 先导智能  | 49,900     | 1,240,015.00  | 0.02         |
| 22 | 300507 | 苏奥传感  | 153,300    | 1,177,344.00  | 0.02         |
| 23 | 300647 | 超频三   | 168,000    | 1,086,960.00  | 0.02         |
| 24 | 688563 | 航材股份  | 15,010     | 850,016.30    | 0.01         |
| 25 | 002821 | 凯莱英   | 8,000      | 706,000.00    | 0.01         |
| 26 | 002024 | ST 易购 | 288,077    | 576,154.00    | 0.01         |
| 27 | 603041 | 美思德   | 44,900     | 532,514.00    | 0.01         |
| 28 | 688605 | 先锋精科  | 7,433      | 465,677.45    | 0.01         |
| 29 | 688515 | 裕太微   | 4,183      | 383,162.80    | 0.01         |
| 30 | 688275 | 万润新能  | 6,511      | 264,021.05    | 0.00         |
| 31 | 301559 | 中集环科  | 13,144     | 210,566.88    | 0.00         |
| 32 | 600996 | 贵广网络  | 25,241     | 210,509.94    | 0.00         |

|    |        |       |       |            |      |
|----|--------|-------|-------|------------|------|
| 33 | 688353 | 华盛锂电  | 6,319 | 209,032.52 | 0.00 |
| 34 | 688061 | 灿瑞科技  | 5,918 | 194,110.40 | 0.00 |
| 35 | 301365 | 矩阵股份  | 7,740 | 132,663.60 | 0.00 |
| 36 | 688489 | 三未信安  | 2,953 | 120,128.04 | 0.00 |
| 37 | 688623 | 二元科技  | 1,776 | 111,479.52 | 0.00 |
| 38 | 688610 | 埃科光电  | 2,747 | 108,946.02 | 0.00 |
| 39 | 301626 | 苏州天脉  | 957   | 100,867.80 | 0.00 |
| 40 | 688132 | 邦彦技术  | 4,844 | 98,333.20  | 0.00 |
| 41 | 688143 | 长盈通   | 2,519 | 98,241.00  | 0.00 |
| 42 | 301395 | 仁信新材  | 7,274 | 98,126.26  | 0.00 |
| 43 | 688391 | 钜泉科技  | 2,938 | 87,229.22  | 0.00 |
| 44 | 688370 | 丛麟科技  | 4,230 | 80,835.30  | 0.00 |
| 45 | 688775 | 影石创新  | 573   | 71,143.68  | 0.00 |
| 46 | 688361 | 中科飞测  | 831   | 69,961.89  | 0.00 |
| 47 | 301238 | 瑞泰新材  | 3,497 | 67,212.34  | 0.00 |
| 48 | 301358 | 湖南裕能  | 2,023 | 63,097.37  | 0.00 |
| 49 | 688479 | 友车科技  | 3,318 | 62,710.20  | 0.00 |
| 50 | 688657 | 浩辰软件  | 1,472 | 62,515.84  | 0.00 |
| 51 | 688449 | 联芸科技  | 1,406 | 58,236.52  | 0.00 |
| 52 | 688692 | 达梦数据  | 261   | 58,174.29  | 0.00 |
| 53 | 688184 | ST 帕瓦 | 5,230 | 52,770.70  | 0.00 |
| 54 | 688411 | 海博思创  | 560   | 46,754.40  | 0.00 |
| 55 | 301611 | 珂玛科技  | 804   | 44,228.04  | 0.00 |
| 56 | 688450 | 光格科技  | 1,662 | 43,910.04  | 0.00 |
| 57 | 688708 | 佳驰科技  | 780   | 43,126.20  | 0.00 |
| 58 | 688726 | 拉普拉斯  | 979   | 42,194.90  | 0.00 |
| 59 | 688548 | 广钢气体  | 4,048 | 40,560.96  | 0.00 |
| 60 | 603391 | 力聚热能  | 991   | 38,708.46  | 0.00 |
| 61 | 688750 | 金天钛业  | 1,685 | 36,193.80  | 0.00 |
| 62 | 301551 | 无线传媒  | 652   | 31,778.48  | 0.00 |
| 63 | 688146 | 中船特气  | 1,011 | 29,228.01  | 0.00 |
| 64 | 301522 | 上大股份  | 816   | 29,057.76  | 0.00 |
| 65 | 603276 | 恒兴新材  | 1,737 | 28,521.54  | 0.00 |
| 66 | 688545 | 兴福电子  | 994   | 26,788.30  | 0.00 |
| 67 | 301458 | 钧崴电子  | 701   | 23,911.11  | 0.00 |
| 68 | 688507 | 索辰科技  | 324   | 23,758.92  | 0.00 |
| 69 | 301556 | 托普云农  | 267   | 23,060.79  | 0.00 |
| 70 | 301327 | 华宝新能  | 441   | 22,649.76  | 0.00 |
| 71 | 301275 | 汉朔科技  | 397   | 22,307.43  | 0.00 |
| 72 | 301293 | 三博脑科  | 433   | 22,260.53  | 0.00 |
| 73 | 301613 | 新铝时代  | 414   | 22,066.20  | 0.00 |
| 74 | 301310 | 鑫宏业   | 573   | 21,052.02  | 0.00 |
| 75 | 301525 | 儒竞科技  | 266   | 20,543.18  | 0.00 |

|     |        |      |       |           |      |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 76  | 601033 | 永兴股份 | 1,258 | 19,888.98 | 0.00 |
| 77  | 301565 | 中仑新材 | 711   | 19,623.60 | 0.00 |
| 78  | 301371 | 敷尔佳  | 733   | 18,596.21 | 0.00 |
| 79  | 301121 | 紫建电子 | 406   | 18,529.84 | 0.00 |
| 80  | 301262 | 海看股份 | 692   | 18,241.12 | 0.00 |
| 81  | 301571 | 国科天成 | 350   | 18,161.50 | 0.00 |
| 82  | 688570 | 天玛智控 | 884   | 18,104.32 | 0.00 |
| 83  | 688583 | 思看科技 | 227   | 18,087.36 | 0.00 |
| 84  | 301631 | 壹连科技 | 214   | 17,676.40 | 0.00 |
| 85  | 301678 | 新恒汇  | 382   | 17,014.28 | 0.00 |
| 86  | 301501 | 恒鑫生活 | 350   | 15,827.00 | 0.00 |
| 87  | 001388 | 信通电子 | 937   | 15,385.54 | 0.00 |
| 88  | 301397 | 溯联股份 | 434   | 15,268.12 | 0.00 |
| 89  | 688581 | 安杰思  | 228   | 14,781.24 | 0.00 |
| 90  | 301348 | 蓝箭电子 | 613   | 14,423.89 | 0.00 |
| 91  | 301607 | 富特科技 | 360   | 14,371.20 | 0.00 |
| 92  | 301479 | 弘景光电 | 182   | 14,172.34 | 0.00 |
| 93  | 301508 | 中机认检 | 419   | 14,162.20 | 0.00 |
| 94  | 301535 | 浙江华远 | 734   | 13,938.66 | 0.00 |
| 95  | 688757 | 胜科纳米 | 536   | 13,903.84 | 0.00 |
| 96  | 688562 | 航天软件 | 726   | 13,605.24 | 0.00 |
| 97  | 301305 | 朗坤科技 | 753   | 13,516.35 | 0.00 |
| 98  | 301617 | 博苑股份 | 329   | 13,505.45 | 0.00 |
| 99  | 301223 | 中荣股份 | 815   | 13,471.95 | 0.00 |
| 100 | 603194 | 中力股份 | 291   | 13,208.49 | 0.00 |
| 101 | 301370 | 国科恒泰 | 1,240 | 13,206.00 | 0.00 |
| 102 | 688758 | 赛分科技 | 777   | 13,185.69 | 0.00 |
| 103 | 301558 | 三态股份 | 1,458 | 13,136.58 | 0.00 |
| 104 | 301172 | 君逸数码 | 613   | 12,658.45 | 0.00 |
| 105 | 688721 | 龙图光罩 | 279   | 12,582.90 | 0.00 |
| 106 | 603072 | 天和磁材 | 226   | 12,305.70 | 0.00 |
| 107 | 301586 | 佳力奇  | 215   | 12,255.00 | 0.00 |
| 108 | 301510 | 固高科技 | 396   | 11,899.80 | 0.00 |
| 109 | 301662 | 宏工科技 | 143   | 11,797.50 | 0.00 |
| 110 | 301603 | 乔锋智能 | 233   | 11,768.83 | 0.00 |
| 111 | 301580 | 爱迪特  | 283   | 11,724.69 | 0.00 |
| 112 | 301601 | 惠通科技 | 342   | 11,576.70 | 0.00 |
| 113 | 688710 | 益诺思  | 332   | 11,566.88 | 0.00 |
| 114 | 301332 | 德尔玛  | 1,122 | 11,489.28 | 0.00 |
| 115 | 688612 | 威迈斯  | 422   | 11,284.28 | 0.00 |
| 116 | 301566 | 达利凯普 | 576   | 10,684.80 | 0.00 |
| 117 | 001356 | 富岭股份 | 709   | 10,237.96 | 0.00 |
| 118 | 301590 | 优优绿能 | 73    | 10,182.04 | 0.00 |

|     |        |       |     |           |      |
|-----|--------|-------|-----|-----------|------|
| 119 | 301499 | 维科精密  | 371 | 10,109.75 | 0.00 |
| 120 | 301516 | 中远通   | 604 | 10,086.80 | 0.00 |
| 121 | 301658 | 首航新能  | 437 | 10,042.26 | 0.00 |
| 122 | 688592 | 司南导航  | 216 | 9,998.64  | 0.00 |
| 123 | 301456 | 盘古智能  | 407 | 9,955.22  | 0.00 |
| 124 | 603275 | 众辰科技  | 193 | 9,532.27  | 0.00 |
| 125 | 301585 | 蓝宇股份  | 273 | 9,363.90  | 0.00 |
| 126 | 301568 | 思泰克   | 246 | 9,360.30  | 0.00 |
| 127 | 301329 | 信音电子  | 458 | 8,921.84  | 0.00 |
| 128 | 301665 | 泰禾股份  | 393 | 8,799.27  | 0.00 |
| 129 | 301283 | 聚胶股份  | 235 | 8,354.25  | 0.00 |
| 130 | 301386 | 未来电器  | 378 | 8,213.94  | 0.00 |
| 131 | 688755 | 汉邦科技  | 203 | 7,983.99  | 0.00 |
| 132 | 301528 | 多浦乐   | 148 | 7,965.36  | 0.00 |
| 133 | 688512 | 慧智微   | 721 | 7,866.11  | 0.00 |
| 134 | 301173 | 毓恬冠佳  | 173 | 7,781.54  | 0.00 |
| 135 | 301552 | 科力装备  | 200 | 7,752.00  | 0.00 |
| 136 | 001382 | 新亚电缆  | 366 | 7,396.86  | 0.00 |
| 137 | 001380 | 华纬科技  | 357 | 7,311.36  | 0.00 |
| 138 | 301469 | 恒达新材  | 275 | 7,293.00  | 0.00 |
| 139 | 301157 | 华塑科技  | 150 | 7,071.00  | 0.00 |
| 140 | 301418 | 协昌科技  | 189 | 6,906.06  | 0.00 |
| 141 | 301520 | 万邦医药  | 160 | 6,897.60  | 0.00 |
| 142 | 301587 | 中瑞股份  | 306 | 6,878.88  | 0.00 |
| 143 | 301227 | 森鹰窗业  | 284 | 6,816.00  | 0.00 |
| 144 | 603395 | 红四方   | 200 | 6,746.00  | 0.00 |
| 145 | 301355 | 南王科技  | 563 | 6,722.22  | 0.00 |
| 146 | 603014 | 威高血净  | 205 | 6,699.40  | 0.00 |
| 147 | 301170 | 锡南科技  | 250 | 6,692.50  | 0.00 |
| 148 | 301539 | 宏鑫科技  | 361 | 6,685.72  | 0.00 |
| 149 | 301276 | 嘉曼服饰  | 364 | 6,621.16  | 0.00 |
| 150 | 001359 | 平安电工  | 184 | 6,417.92  | 0.00 |
| 151 | 688646 | ST 逸飞 | 219 | 6,276.54  | 0.00 |
| 152 | 301272 | 英华特   | 173 | 6,210.70  | 0.00 |
| 153 | 688651 | 盛邦安全  | 178 | 6,075.14  | 0.00 |
| 154 | 301636 | 泽润新能  | 128 | 6,074.88  | 0.00 |
| 155 | 301519 | 舜禹股份  | 442 | 6,073.08  | 0.00 |
| 156 | 603091 | 众鑫股份  | 94  | 5,947.38  | 0.00 |
| 157 | 301595 | 太力科技  | 196 | 5,703.60  | 0.00 |
| 158 | 301529 | 福赛科技  | 182 | 5,702.06  | 0.00 |
| 159 | 688530 | 欧莱新材  | 344 | 5,665.68  | 0.00 |
| 160 | 301372 | 科净源   | 231 | 5,266.80  | 0.00 |
| 161 | 301560 | 众捷汽车  | 190 | 5,215.50  | 0.00 |

|     |        |      |     |          |      |
|-----|--------|------|-----|----------|------|
| 162 | 603205 | 健尔康  | 128 | 4,944.64 | 0.00 |
| 163 | 603310 | 巍华新材 | 254 | 4,861.56 | 0.00 |
| 164 | 688671 | 碧兴物联 | 226 | 4,825.10 | 0.00 |
| 165 | 301588 | 美新科技 | 257 | 4,769.92 | 0.00 |
| 166 | 603312 | 西典新能 | 130 | 4,767.10 | 0.00 |
| 167 | 301515 | 港通医疗 | 230 | 4,675.90 | 0.00 |
| 168 | 603344 | 星德胜  | 182 | 4,630.08 | 0.00 |
| 169 | 603107 | 上海汽配 | 292 | 4,546.44 | 0.00 |
| 170 | 001378 | 德冠新材 | 205 | 4,544.85 | 0.00 |
| 171 | 603210 | 泰鸿万立 | 286 | 4,464.46 | 0.00 |
| 172 | 603271 | 永杰新材 | 126 | 4,420.08 | 0.00 |
| 173 | 603124 | 江南新材 | 88  | 4,075.28 | 0.00 |
| 174 | 603381 | 永臻股份 | 178 | 3,985.42 | 0.00 |
| 175 | 001395 | 亚联机械 | 80  | 3,780.00 | 0.00 |
| 176 | 603350 | 安乃达  | 106 | 3,713.18 | 0.00 |
| 177 | 603075 | 热威股份 | 182 | 3,638.18 | 0.00 |
| 178 | 001326 | 联域股份 | 99  | 3,369.96 | 0.00 |
| 179 | 603409 | 汇通控股 | 100 | 3,332.00 | 0.00 |
| 180 | 001390 | 古麒绒材 | 178 | 3,225.36 | 0.00 |
| 181 | 603257 | 中国瑞林 | 78  | 2,922.66 | 0.00 |
| 182 | 001358 | 兴欣新材 | 122 | 2,919.46 | 0.00 |
| 183 | 603375 | 盛景微  | 72  | 2,674.80 | 0.00 |
| 184 | 603400 | 华之杰  | 57  | 2,497.17 | 0.00 |
| 185 | 001387 | 雪祺电气 | 173 | 2,377.02 | 0.00 |
| 186 | 603382 | 海阳科技 | 105 | 2,350.95 | 0.00 |
| 187 | 001335 | 信凯科技 | 80  | 2,244.00 | 0.00 |
| 188 | 603120 | 肯特催化 | 65  | 2,172.95 | 0.00 |

注：上表中股票名称以报告期末名称为准。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称  | 本期累计买入金额      | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|-------|---------------|----------------|
| 1  | 601009 | 南京银行  | 58,670,000.00 | 0.77           |
| 2  | 601006 | 大秦铁路  | 57,642,076.41 | 0.75           |
| 3  | 002044 | 美年健康  | 34,780,000.00 | 0.46           |
| 4  | 600028 | 中国石化  | 6,422,225.00  | 0.08           |
| 5  | 600161 | 天坛生物  | 6,247,880.00  | 0.08           |
| 6  | 601916 | 浙商银行  | 6,222,000.00  | 0.08           |
| 7  | 000069 | 华侨城 A | 6,012,500.00  | 0.08           |
| 8  | 000938 | 紫光股份  | 5,671,700.00  | 0.07           |
| 9  | 603019 | 中科曙光  | 5,585,000.00  | 0.07           |

|    |        |        |              |      |
|----|--------|--------|--------------|------|
| 10 | 000895 | 双汇发展   | 4,951,125.00 | 0.06 |
| 11 | 603683 | 晶华新材   | 4,547,798.20 | 0.06 |
| 12 | 000157 | 中联重科   | 4,123,400.00 | 0.05 |
| 13 | 601318 | 中国平安   | 3,996,000.00 | 0.05 |
| 14 | 601088 | 中国神华   | 3,775,076.00 | 0.05 |
| 15 | 000100 | TCL 科技 | 3,690,674.00 | 0.05 |
| 16 | 002607 | 中公教育   | 3,399,000.00 | 0.04 |
| 17 | 002957 | 科瑞技术   | 3,286,762.20 | 0.04 |
| 18 | 601888 | 中国中免   | 2,981,601.00 | 0.04 |
| 19 | 601117 | 中国化学   | 2,976,900.00 | 0.04 |
| 20 | 600195 | 中牧股份   | 2,845,000.00 | 0.04 |

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额       | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|----------------|----------------|
| 1  | 000800 | 一汽解放 | 110,428,281.22 | 1.44           |
| 2  | 601601 | 中国太保 | 65,135,429.00  | 0.85           |
| 3  | 601336 | 新华保险 | 64,706,441.00  | 0.85           |
| 4  | 600519 | 贵州茅台 | 59,846,368.00  | 0.78           |
| 5  | 601009 | 南京银行 | 49,270,073.53  | 0.64           |
| 6  | 600926 | 杭州银行 | 39,033,142.12  | 0.51           |
| 7  | 601628 | 中国人寿 | 35,209,441.00  | 0.46           |
| 8  | 000425 | 徐工机械 | 34,327,726.00  | 0.45           |
| 9  | 300353 | 东土科技 | 33,454,165.00  | 0.44           |
| 10 | 002555 | 三七互娱 | 28,811,325.34  | 0.38           |
| 11 | 001965 | 招商公路 | 27,968,475.88  | 0.37           |
| 12 | 601728 | 中国电信 | 27,795,458.00  | 0.36           |
| 13 | 002607 | 中公教育 | 25,325,157.45  | 0.33           |
| 14 | 000895 | 双汇发展 | 22,632,428.00  | 0.30           |
| 15 | 300142 | 沃森生物 | 20,046,959.00  | 0.26           |
| 16 | 600741 | 华域汽车 | 18,469,694.88  | 0.24           |
| 17 | 002821 | 凯莱英  | 18,047,369.88  | 0.24           |
| 18 | 603019 | 中科曙光 | 17,883,046.00  | 0.23           |
| 19 | 600019 | 宝钢股份 | 17,415,260.00  | 0.23           |
| 20 | 600795 | 国电电力 | 16,906,790.00  | 0.22           |

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |                  |
|--------------|------------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 254,180,340.81   |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,075,301,222.89 |

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

第 60 页 共 69 页

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      | 363,917,742.48 | 5.42         |
|    | 其中：政策性金融债 | 363,917,742.48 | 5.42         |
| 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） | 352,669,104.87 | 5.25         |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 716,586,847.35 | 10.67        |

## 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  | 113050 | 南银转债     | 886,210 | 128,234,247.09 | 1.91         |
| 2  | 113052 | 兴业转债     | 596,710 | 74,285,327.05  | 1.11         |
| 3  | 230404 | 23 农发 04 | 600,000 | 61,000,421.92  | 0.91         |
| 4  | 113056 | 重银转债     | 362,250 | 45,626,330.34  | 0.68         |
| 5  | 250411 | 25 农发 11 | 400,000 | 40,229,304.11  | 0.60         |

## 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 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，并且未在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

7.12.3 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 | 346,705.80    |
| 2  | 应收清算款 | 25,056,613.20 |
| 3  | 应收股利  | -             |
| 4  | 应收利息  | -             |
| 5  | 应收申购款 | 3,524,501.78  |
| 6  | 其他应收款 | -             |
| 7  | 待摊费用  | -             |
| 8  | 其他    | -             |
| 9  | 合计    | 28,927,820.78 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 公允价值           | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|----------------|--------------|
| 1  | 113050 | 南银转债     | 128,234,247.09 | 1.91         |
| 2  | 113052 | 兴业转债     | 74,285,327.05  | 1.11         |
| 3  | 113056 | 重银转债     | 45,626,330.34  | 0.68         |
| 4  | 110081 | 闻泰转债     | 24,048,479.73  | 0.36         |
| 5  | 113062 | 常银转债     | 22,769,547.99  | 0.34         |
| 6  | 113049 | 长汽转债     | 15,710,084.80  | 0.23         |
| 7  | 113042 | 上银转债     | 15,016,859.51  | 0.22         |
| 8  | 113053 | 隆 22 转债  | 5,659,060.11   | 0.08         |
| 9  | 113641 | 华友转债     | 5,395,137.84   | 0.08         |
| 10 | 132026 | G 三峡 EB2 | 5,179,435.76   | 0.08         |
| 11 | 110075 | 南航转债     | 4,592,260.71   | 0.07         |
| 12 | 123144 | 裕兴转债     | 1,466,761.17   | 0.02         |
| 13 | 110062 | 烽火转债     | 1,374,308.93   | 0.02         |
| 14 | 127061 | 美锦转债     | 796,488.91     | 0.01         |
| 15 | 127085 | 韵达转债     | 788,668.41     | 0.01         |

|    |        |         |            |      |
|----|--------|---------|------------|------|
| 16 | 127049 | 希望转 2   | 596,847.86 | 0.01 |
| 17 | 127015 | 希望转债    | 524,375.93 | 0.01 |
| 18 | 127020 | 中金转债    | 453,146.13 | 0.01 |
| 19 | 113655 | 欧 22 转债 | 133,829.28 | 0.00 |
| 20 | 118031 | 天 23 转债 | 13,650.32  | 0.00 |
| 21 | 123211 | 阳谷转债    | 1,679.32   | 0.00 |
| 22 | 111010 | 立昂转债    | 1,154.92   | 0.00 |

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

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  | 002044 | 美年健康 | 35,076,000.00 | 0.52         | 大宗交易购入流通受限 |

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 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（%） |
| 兴全沪深 300 指数增强（LOF）A | 495,011  | 5,102.77  | 528,819,048.60 | 20.94     | 1,997,109,758.43 | 79.06     |
| 兴全沪深 300 指数增强（LOF）C | 72,748   | 3,182.09  | 2,839,371.70   | 1.23      | 228,651,111.92   | 98.77     |
| 兴全沪深 300 指数         | 2,439    | 2,877.67  | -              | -         | 7,018,625.71     | 100.00    |

|                |         |          |                |       |                  |       |
|----------------|---------|----------|----------------|-------|------------------|-------|
| 增 强<br>(LOF) Y |         |          |                |       |                  |       |
| 合 计            | 570,198 | 4,848.21 | 531,658,420.30 | 19.23 | 2,232,779,496.06 | 80.77 |

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 期末上市基金前十名持有人

兴全沪深 300 指数增强（LOF）A

| 序号 | 持有人名称            | 持有份额（份）      | 占上市总份额比例（%） |
|----|------------------|--------------|-------------|
| 1  | 陈周阳              | 3,000,000.00 | 4.66        |
| 2  | 陈杰               | 2,300,000.00 | 3.57        |
| 3  | 钱春香              | 1,919,101.00 | 2.98        |
| 4  | 姚新燕              | 1,750,000.00 | 2.72        |
| 5  | 王简敏              | 930,146.00   | 1.44        |
| 6  | 浙江德源智能制造科技股份有限公司 | 914,447.00   | 1.42        |
| 7  | 周丹承              | 910,954.00   | 1.41        |
| 8  | 何立新              | 600,100.00   | 0.93        |
| 9  | 郭鹏罡              | 517,272.00   | 0.80        |
| 10 | 寿平               | 500,000.00   | 0.78        |

注：上表所列持有人为本基金场内持有人。

8.3 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 | 兴全沪深 300 指数增强（LOF）A | 4,731,072.68 | 0.1873      |
|                  | 兴全沪深 300 指数增强（LOF）C | 120,660.79   | 0.0521      |
|                  | 兴全沪深 300 指数增强（LOF）Y | 58,703.48    | 0.8364      |
|                  | 合 计                 | 4,910,436.95 | 0.1776      |

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）。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                             | 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 | 兴全沪深 300 指数增强（LOF）A | 0~10              |
|                                | 兴全沪深 300 指数增强（LOF）C | 0                 |
|                                | 兴全沪深 300 指数增强       | 0                 |

|                     |                         |      |
|---------------------|-------------------------|------|
|                     | （LOF）Y                  |      |
|                     | 合计                      | 0~10 |
| 本基金基金经理持有<br>本开放式基金 | 兴全沪深 300 指数增强<br>（LOF）A | >100 |
|                     | 兴全沪深 300 指数增强<br>（LOF）C | 0    |
|                     | 兴全沪深 300 指数增强<br>（LOF）Y | 0    |
|                     | 合计                      | >100 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                                        | 兴全沪深 300 指数增强<br>（LOF）A | 兴全沪深 300 指数增强<br>（LOF）C | 兴全沪深 300 指数增强<br>（LOF）Y |
|-------------------------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|
| 基金合同生效<br>日（2010 年<br>11 月 2 日）<br>基金份额总额 | 2,955,476,122.49        | —                       | —                       |
| 本报告期期初<br>基金份额总额                          | 2,847,412,006.58        | 295,756,341.03          | 2,298,560.49            |
| 本报告期基金<br>总申购份额                           | 283,669,997.48          | 120,963,855.00          | 5,518,958.23            |
| 减：本报告期<br>基金总赎回份<br>额                     | 605,153,197.03          | 185,229,712.41          | 798,893.01              |
| 本报告期基金<br>拆分变动份额                          | —                       | —                       | —                       |
| 本报告期期末<br>基金份额总额                          | 2,525,928,807.03        | 231,490,483.62          | 7,018,625.71            |

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) 2025 年 2 月，中国农业银行总行决定陈振华任托管业务部副总裁。

2025 年 3 月，中国农业银行总行决定常佳任托管业务部副总裁。

2025 年 4 月，中国农业银行总行决定李亚红任托管业务部高级专家。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及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 (%) |    |
| 兴业证券 | 3      | 1,211,288,159.44 | 100.00           | 237,709.77 | 100.00         | -  |

注：1. 报告期内无租用证券公司交易单元变更；

2. 上表列示交易单元数量为截至本报告期末本基金租用数量，成交金额及佣金为本报告期间数；

3. 根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力、客户服务质量的基础上，选择基金专用交易席位。

#### 10.7.2 基金租用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(%) |
|------|----------------|-----------------|------------------|-------------------|------|-----------------|
| 兴业证券 | 381,131,335.71 | 100.00          | 8,798,683,000.00 | 100.00            | -    | -               |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                                          | 法定披露方式       | 法定披露日期          |
|----|---------------------------------------------------------------|--------------|-----------------|
| 1  | 关于兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）A 类份额、C 类份额暂停接受大额申购（含定投）、转换转入申请的公告 | 证券时报、指定互联网网站 | 2025 年 1 月 9 日  |
| 2  | 关于兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）暂停接受大额申购（含定投）、转换转入申请的公告            | 证券时报、指定互联网网站 | 2025 年 1 月 15 日 |
| 3  | 兴证全球基金管理有限公司关于开展部分基金申购费用优惠活动的公告                               | 证券时报、指定互联网网站 | 2025 年 2 月 26 日 |
| 4  | 关于旗下部分基金投资科瑞技术（002957）非公开发行股票的公告                              | 证券时报、指定互联网网站 | 2025 年 3 月 8 日  |
| 5  | 关于兴证全球基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告               | 证券时报、指定互联网网站 | 2025 年 3 月 20 日 |
| 6  | 兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）（兴全沪深 300 指数增强（LOF）A 份额）基金产品资料概要更新   | 证券时报、指定互联网网站 | 2025 年 3 月 20 日 |
| 7  | 兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）（兴全沪深 300 指数增强（LOF）C 份额）基金产品资料概要更新   | 证券时报、指定互联网网站 | 2025 年 3 月 20 日 |
| 8  | 兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）（兴全沪深 300 指数增强（LOF）Y 份额）基金产品资料概要更新   | 证券时报、指定互联网网站 | 2025 年 3 月 20 日 |
| 9  | 兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同                                 | 证券时报、指定互联网网站 | 2025 年 3 月 20 日 |
| 10 | 兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）托管协议                                 | 证券时报、指定互联网网站 | 2025 年 3 月 20 日 |
| 11 | 兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）更新招募说明书（2025 年 3 月 20 日更新）           | 证券时报、指定互联网网站 | 2025 年 3 月 20 日 |

|    |                                                    |              |                 |
|----|----------------------------------------------------|--------------|-----------------|
| 12 | 关于旗下部分基金投资晶华新材（603683）非公开发行股票的公告                   | 证券时报、指定互联网网站 | 2025 年 5 月 27 日 |
| 13 | 关于兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）暂停接受大额申购（含定投）、转换转入申请的公告 | 证券时报、指定互联网网站 | 2025 年 6 月 3 日  |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别                                            | 报告期内持有基金份额变化情况 |                         |      |      |      | 报告期末持有基金情况 |         |
|--------------------------------------------------|----------------|-------------------------|------|------|------|------------|---------|
|                                                  | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额       | 份额占比（%） |
| 机构                                               | -              | -                       | -    | -    | -    | -          | -       |
| 个人                                               | -              | -                       | -    | -    | -    | -          | -       |
| 产品特有风险                                           |                |                         |      |      |      |            |         |
| 本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，故不涉及本项特有风险。 |                |                         |      |      |      |            |         |

注：1、“申购金额”包含份额申购、转换转入、分红再投资等导致投资者持有份额增加的情形。

2、“赎回份额”包含份额赎回、转换转出等导致投资者持有份额减少的情形。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）募集注册的文件；
- 2、《兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 4、关于申请募集兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）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