兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

（原兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金转型）

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:兴业基金管理有限公司

基金托管人:长江证券股份有限公司

送出日期:2026 年 08 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。

基金托管人长江证券股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年08月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年01月01日起至06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 6
2.1 基金基本情况 6
2.2 基金产品说明 7
2.3 基金管理人和基金托管人 10
2.4 信息披露方式 10
2.5 其他相关资料 10
§3 主要财务指标和基金净值表现(转型后) 10
3.1 主要会计数据和财务指标 10
3.2 基金净值表现 12
§3 主要财务指标和基金净值表现（转型前） 14
3.1 主要会计数据和财务指标 14
3.2 基金净值表现 15
§4 管理人报告 19
4.1 基金管理人及基金经理情况 19
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 21
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 21
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 21
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 22
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 22
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 23
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 23
§5 托管人报告 23
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 23
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 23
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 23
§6 半年度财务会计报告（未经审计）(转型后) 24
6.1 资产负债表 24
6.2 利润表 25
6.3 净资产变动表 27
6.4 报表附注 28
§6 半年度财务会计报告（未经审计）(转型前) 55
6.1 资产负债表 55
6.2 利润表 57
6.3 净资产变动表 59
6.4 报表附注 61
§7 投资组合报告(转型后) 84
7.1 期末基金资产组合情况 84
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 84
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 85
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 86
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 87

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 87
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 87
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 87
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 88
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 88
7.11 本基金投资股指期货的投资政策 88
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 88
7.13 投资组合报告附注 88
§7 投资组合报告（转型前） 89
7.1 期末基金资产组合情况 89
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 90
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 90
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 92
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 93
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 94
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 94
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 94
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 94
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 94
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 94
7.12 投资组合报告附注 94
§8 基金份额持有人信息(转型后) 95
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 95
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 96
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 96
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 97
§8 基金份额持有人信息(转型前) 97
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 97
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 98
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 98
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 99
§9 开放式基金份额变动(转型后) 99
§9 开放式基金份额变动(转型前) 100
§10 重大事件揭示 100
10.1 基金份额持有人大会决议 100
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 100
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 101
10.4 基金投资策略的改变 101
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 101
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 101
转型后 101
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 101
转型前 102
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 102
10.8 其他重大事件 103
§11 影响投资者决策的其他重要信息 105

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 105
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 105
§12 备查文件目录 105
12.1 备查文件目录 105
12.2 存放地点 106
12.3 查阅方式 106

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

转型后

基金名称	兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	
基金简称	兴业中证港股通互联网ETF联接	
基金主代码	021377	
基金运作方式	契约型开放式	
基金转型合同生效日	2026年03月31日	
基金管理人	兴业基金管理有限公司	
基金托管人	长江证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	445,030,379.73份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	兴业中证港股通互联网ETF联接A	兴业中证港股通互联网ETF联接C
下属分级基金的交易代码	021377	021378
报告期末下属分级基金的份额总额	53,260,049.17份	391,770,330.56份

转型前

基金名称	兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金	
基金简称	兴业中证港股通互联网指数发起式	
基金主代码	021377	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024年05月28日	
基金管理人	兴业基金管理有限公司	
基金托管人	长江证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	581,911,987.33份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	兴业中证港股通互联网指数发起式A	兴业中证港股通互联网指数发起式C

下属分级基金的交易代码	021377	021378
报告期末下属分级基金的份额总额	50,594,741.17份	531,317,246.16份

2.1.1 目标基金基本情况

转型后

基金名称	兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	520790
基金运作方式	交易型开放式
基金转型合同生效日	2026-03-19
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2026-03-30
基金管理人名称	兴业基金管理有限公司
基金托管人名称	长江证券股份有限公司

2.2 基金产品说明

转型后

投资目标	通过主要投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为ETF联接基金，主要通过投资于目标ETF实现对标的指数的紧密跟踪。本基金力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内，年化跟踪误差控制在4%以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。 主要投资策略为目标ETF投资策略、股票投资策略、债券（除可转换债券和可交换债券）投资策略、资产支持证券的投资策略、可转换债券和可交换债券投资策略、衍生品投资策略。
业绩比较基准	中证港股通互联网指数收益率（经估值汇率调整后）×95%＋银行人民币活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为ETF联接基金，目标 ETF 为股票型基金，

	其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要通过投资于目标ETF跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的市场相似的风险收益特征。

转型前

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。 本基金在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。 由于标的指数编制方法调整、成份股及其权重发生变化（包括配送股、增发、临时调入及调出成份股等）的原因，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。 本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。 主要投资策略为大类资产配置策略、股票投资策略、债券（除可转换债券和可交换债券）投资策略、资产支持证券的投资策略、可转换债券和可交换债券投资策略、衍生品投资策略。
业绩比较基准	中证港股通互联网指数收益率（经估值汇率调整后）*95%+银行人民币活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金为指

	数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。 本基金主要投资香港证券市场，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

2.2.1 目标基金产品说明

转型后

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采用完全复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。主要投资策略包括：1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、港股通标的股票投资策略；4、存托凭证投资策略；5、债券投资策略；6、可转换债券、可交换债券投资策略；7、资产支持证券投资策略；8、衍生品投资策略；9、参与融资与转融通证券出借业务策略。
业绩比较基准	中证港股通互联网指数（经估值汇率调整后）收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债 券型基金与货币市场基金。同时本基金为交易型开放式指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金投资港股通标的股票，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市 场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险和港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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		兴业基金管理有限公司	长江证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张顺国	江何立
	联系电话	021-22211888	027-65795980
	电子邮箱	zhaoyue@cib-fund.com.cn	tgxp@cjsc.com.cn
客户服务电话		40000-95561	027-65795980
传真		021-22211997	027-85481841
注册地址		福建省福州市鼓楼区五四路137号信和广场25楼	湖北省武汉市江汉区淮海路88号
办公地址		上海市浦东新区银城路167号13、14层	湖北省武汉市江汉区淮海路88号长江证券大厦36楼
邮政编码		200120	430023
法定代表人		刘宗治	刘正斌

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.cib-fund.com.cn
基金中期报告置备地点	上海市浦东新区银城路167号13、14层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	兴业基金管理有限公司	上海市浦东新区银城路167号13、14层

§3 主要财务指标和基金净值表现(转型后)

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期

	(2026年03月31日（基金转型日）-2026年06月30日)	
	兴业中证港股通互联网ETF联接A	兴业中证港股通互联网ETF联接C
本期已实现收益	-14,914,441.35	-128,164,776.28
本期利润	-14,847,372.17	-122,246,714.92
加权平均基金份额本期利润	-0.2739	-0.2438
本期加权平均净值利润率	-23.44%	-21.22%
本期基金份额净值增长率	-21.71%	-21.73%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026年06月30日)	
期末可供分配利润	-9,488,327.22	-69,098,209.10
期末可供分配基金份额利润	-0.1782	-0.1764
期末基金资产净值	51,211,783.70	367,664,275.55
期末基金份额净值	0.9615	0.9385
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-21.71%	-21.73%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、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（为期末余额，不是当期发生数）。

4、根据公告《关于兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金变更为兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金并修改基金合同及托管协议的公告》，自2026年3月31日起，兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金正式变更为兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金，《兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》生效，原《兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金基金合同》自同日失效。

5、本基金基金合同于2026年3月31日生效，截至报告期末本基金基金合同生效未满一年。

根据本基金基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截止本报告期末本基金仍处于建仓期。

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

兴业中证港股通互联网ETF联接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
过去三个月	-20.79%	2.02%	-21.30%	2.08%	0.51%	-0.06%
自基金合同生效起至今	-21.71%	2.01%	-22.25%	2.07%	0.54%	-0.06%

注：1、根据公告《关于兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金变更为兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金并修改基金合同及托管协议的公告》，自2026年3月31日起，兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金正式变更为兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金，《兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》生效，原《兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金基金合同》自同日失效。

2、业绩比较基准:中证港股通互联网指数收益率（经估值汇率调整后）*95%+银行人民币活期存款利率（税后）*5%。

兴业中证港股通互联网ETF联接C

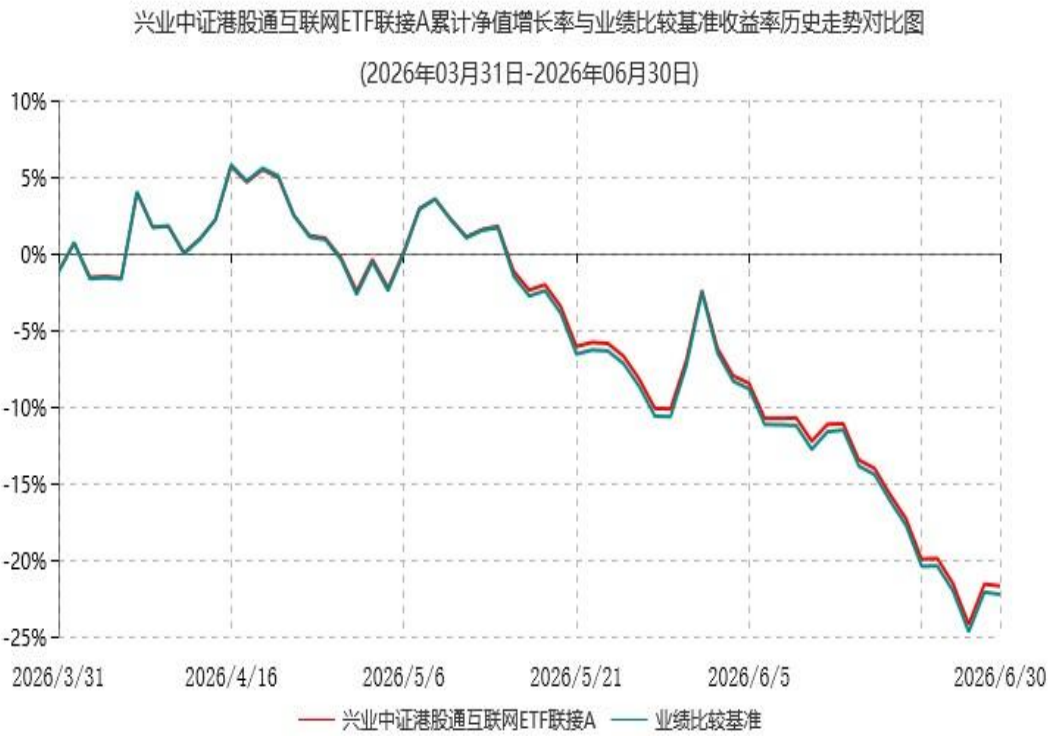
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-20.81%	2.02%	-21.30%	2.08%	0.49%	-0.06%
自基金合同生效起至今	-21.73%	2.01%	-22.25%	2.07%	0.52%	-0.06%

注：1、根据公告《关于兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金变更为兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金并修改基金合同及托管协议的公告》，自2026年3月31日起，兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金正式变更为兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接

基金，《兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》生效，原《兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金基金合同》自同日失效。

2、业绩比较基准:中证港股通互联网指数收益率（经估值汇率调整后）*95%+银行人民币活期存款利率（税后）*5%。

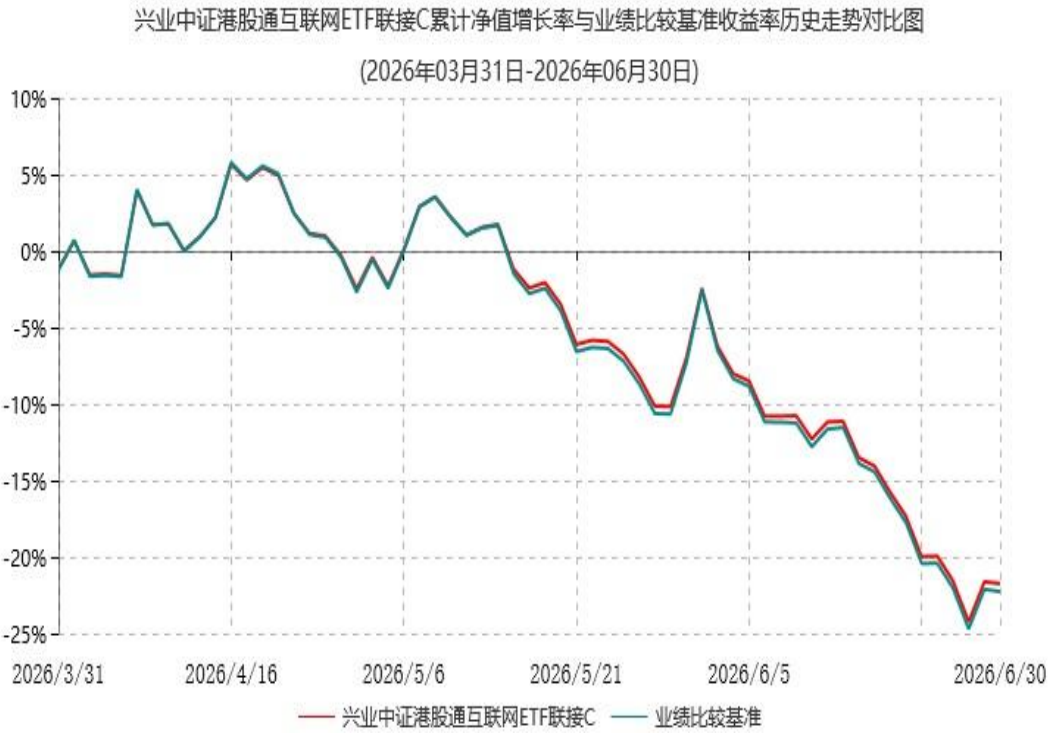
3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



1、根据公告《关于兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金变更为兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金并修改基金合同及托管协议的公告》，自2026年3月31日起，兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金正式变更为兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金，《兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》生效，原《兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金基金合同》自同日失效。

2、本基金基金合同于2026年3月31日生效，截至报告期末本基金基金合同生效未满一年。

3、根据本基金基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截止本报告期末本基金仍处于建仓期。



1、根据公告《关于兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金变更为兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金并修改基金合同及托管协议的公告》，自2026年3月31日起，兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金正式变更为兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金，《兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》生效，原《兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金基金合同》自同日失效。

2、本基金基金合同于2026年3月31日生效，截至报告期末本基金基金合同生效未满一年。

3、根据本基金基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截止本报告期末本基金仍处于建仓期。

§3 主要财务指标和基金净值表现（转型前）

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2026年01月01日-2026年03月30日)	
	兴业中证港股通互联网指数发起式A	兴业中证港股通互联网指数发起式C
本期已实现收益	-1,547,980.14	-17,277,277.23

本期利润	-13,106,871.82	-162,143,179.91
加权平均基金份额本期利润	-0.2974	-0.3294
本期加权平均净值利润率	-20.63%	-23.41%
本期基金份额净值增长率	-17.87%	-17.89%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2026年03月30日)	
期末可供分配利润	4,854,610.73	48,599,770.29
期末可供分配基金份额利润	0.0960	0.0915
期末基金资产净值	62,139,111.17	637,082,092.34
期末基金份额净值	1.2282	1.1991
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2026年03月30日)	
基金份额累计净值增长率	22.82%	19.91%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、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（为期末余额，不是当期发生数）。

4、根据公告《关于兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金变更为兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金并修改基金合同及托管协议的公告》，自2026年3月31日起，兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金正式变更为兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金，《兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》生效，原《兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金基金合同》自同日失效。

5、兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金于2026年3月31日转型，本半年度报告期自2026年1月1日至2026年3月30日止。

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

兴业中证港股通互联网指数发起式A

阶段	份额净值	份额净值	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④

	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去三个月(2025年12月31日-2026年03月30日)	-18.30%	1.85%	-18.66%	1.90%	0.36%	-0.05%
过去六个月(2025年10月01日-2026年03月30日)	-33.48%	1.66%	-33.63%	1.70%	0.15%	-0.04%
过去一年(2025年03月31日-2026年03月30日)	-20.46%	1.91%	-19.24%	1.93%	-1.22%	-0.02%
自基金合同生效起至今	22.82%	1.92%	13.79%	2.05%	9.03%	-0.13%

注：1、根据公告《关于兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金变更为兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金并修改基金合同及托管协议的公告》，自2026年3月31日起，兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金正式变更为兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金，《兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》生效，原《兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金基金合同》自同日失效。

2、业绩比较基准:中证港股通互联网指数收益率（经估值汇率调整后）*95%+银行人民币活期存款利率（税后）*5%。

兴业中证港股通互联网指数发起式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
过去三个月(2025年12月31日-2026年03	-18.31%	1.85%	-18.66%	1.90%	0.35%	-0.05%

月30日)						
过去六个月(2025年10月01日-2026年03月30日)	-33.52%	1.66%	-33.63%	1.70%	0.11%	-0.04%
过去一年(2025年03月31日-2026年03月30日)	-20.52%	1.91%	-19.24%	1.93%	-1.28%	-0.02%
自基金合同生效起至今	19.91%	1.92%	13.79%	2.05%	6.12%	-0.13%

注：1、根据公告《关于兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金变更为兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金并修改基金合同及托管协议的公告》，自2026年3月31日起，兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金正式变更为兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金，《兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》生效，原《兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金基金合同》自同日失效。

2、业绩比较基准:中证港股通互联网指数收益率（经估值汇率调整后）*95%+银行人民币活期存款利率（税后）*5%。

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



注：根据公告《关于兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金变更为兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金并修改基金合同及托管协议的公告》，自2026年3月31日起，兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金正式变更为兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金，《兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》生效，原《兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金基金合同》自同日失效。



注：根据公告《关于兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金变更为兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金并修改基金合同及托管协议的公告》，自2026年3月31日起，兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金正式变更为兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金，《兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》生效，原《兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金基金合同》自同日失效。

§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

兴业基金管理有限公司（以下简称“兴业基金”或“公司”）成立于2013年4月17日，是兴业银行控股下的全国性基金管理公司。公司注册资本人民币12亿元，其中，兴业银行股份有限公司出资10.8亿元，持股比例90%；中海集团投资有限公司出资1.2亿元，持股比例10%。公司业务范围主要包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。2015年兴业基金成功核准获批QDII资格；2017年2月，兴业基金获批受托管理保险资金资格。目前，兴业基金已设立了北京、上海、深圳、福州四个分公司，并设立基金子公司-兴业财富资产管理有限公司。截至2026年6月30日，兴业基金共管理128只公募基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

转型后

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		
楼华锋	基金经理	2026-03-31	-	16年	中国籍，上海交通大学通信与信息系统专业硕士学历，具有证券投资基金从业资格。曾就职于东方证券研究所担任金工分析师、光大证券信用业务部担任高级经理、方正证券研究所担任金融工程高级分析师；曾任银河基金管理有限公司量化与指数工作室负责人。2021年6月加入兴业基金管理有限公司，现任基金经理。

1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期，除首任基金经理外，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、证券从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

转型前

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		
楼华锋	基金经理	2024-05-28	2026-03-30	16年	中国籍，上海交通大学通信与信息系统专业硕士学历，

					具有证券投资基金从业资格。曾就职于东方证券研究所担任金工分析师、光大证券信用业务部担任高级经理、方正证券研究所担任金融工程高级分析师；曾任银河基金管理有限公司量化与指数工作室负责人。2021年6月加入兴业基金管理有限公司，现任基金经理。

1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期，除首任基金经理外，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、证券从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法律法规、基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内，本基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。

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

报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

本基金为被动指数基金，跟踪中证港股通互联网指数，根据基金产品合同复制跟踪中证港股通互联网指数成分股权重和行业配置。上半年港股市场受科技板块资金虹吸影

响，偏向价值的港股互联网板块调整幅度较大，展望下半年市场有望回归到均衡偏向价值的走势。随着科技板块拥挤度攀升至历史高位，港股互联网板块的性价比优势有望进一步凸显。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2026年3月30日，兴业中证港股通互联网ETF联接A基金份额净值为1.2282元；自2026年1月1日至2026年3月30日本基金份额净值增长率为-17.87%，同期业绩比较基准收益率为-18.22%。

截至2026年3月30日，兴业中证港股通互联网ETF联接C基金份额净值为1.1991元；自2026年1月1日至2026年3月30日本基金份额净值增长率为-17.89%，同期业绩比较基准收益率为-18.22%。

截至2026年6月30日，兴业中证港股通互联网ETF联接A基金份额净值为0.9615元；自2026年3月31日至2026年6月30日本基金份额净值增长率为-21.71%，同期业绩比较基准收益率为-22.25%。

截至2026年6月30日，兴业中证港股通互联网ETF联接C基金份额净值为0.9385元；自2026年3月31日至2026年6月30日本基金份额净值增长率为-21.73%，同期业绩比较基准收益率为-22.25%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观经济预计将在政策托底与结构转型中温和复苏。财政政策持续发力新基建与民生领域，货币政策保持流动性合理充裕，旨在巩固内需修复动能。尽管外部地缘博弈与全球通胀粘性仍存扰动，但国内经济韧性有望增强，企业盈利增速或迎来边际改善。证券市场方面，A股估值处于历史相对低位，具备较高配置性价比。随着基本面预期修复及中长期资金入市，市场情绪有望回暖，呈现震荡上行格局。风格上，业绩确定性强的资产将更受青睐，市场将从单纯的主题炒作回归价值本源。港股通互联网板块前期受AI科技资金虹吸影响整体承压，预计随着市场回归业绩和估值均衡驱动，港股互联网板块有望迎来一定修复。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。

估值委员会设主任委员一名，由分管运营的公司领导担任，副主任委员一名，由分管合规的公司领导担任，专业委员若干名，由研究部、投资管理部门（视会议议题内容选择相关投资方向部门）、风险部门、监察稽核部门、基金运营部门负责人或其指定人员组成。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。

估值委员会主要工作职责如下：制定合理、公允的估值方法；对估值方法进行讨论并作出评价，在发生了影响估值公允性及合理性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用；评价现有估值方法对新投资策略或新投资品种的适用性，对新投资策略或新投资品种采用的估值方法作出决定；讨论、决定其他与估值相关的重大问题。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。

本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

会计师事务所对相关估值模型、假设及参数的适当性出具意见。

定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

本报告期没有应分配但尚未分配的利润。

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

本基金为发起式基金，且截至本报告期末，本基金基金合同生效未满三年，暂不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（原兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金转型）托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和资产管理合同的有关规定，不存在任何损害投资人利益的行为，完全尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

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

本报告期内，兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（原兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金转型）的管理人--兴业基金管理有限公司在该基金的投资运作、净值计算、费用开支等问题上，托管人未发现其存在损害投资人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对兴业基金管理有限公司编制和披露的兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（原兴业中证港股通互联网指数型发起式证

券投资基金转型）中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）(转型后)

6.1 资产负债表

会计主体：兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年06月30日
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	45,817,026.73
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	387,774,209.73
其中：股票投资		190,516,836.80
基金投资		197,257,372.93
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产		-
买入返售金融资产		-
应收清算款		14,728,203.78
应收股利		532,663.82
应收申购款		2,972,061.79
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.3	-
资产总计		451,824,165.85
负债和净资产	**附注号**	本期末 2026年06月30日

负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债		-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		32,688,931.66
应付管理人报酬		117,726.03
应付托管费		26,161.34
应付销售服务费		38,098.75
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.4	77,188.82
负债合计		32,948,106.60
净资产：		
实收基金	6.4.7.5	445,030,379.73
未分配利润	6.4.7.6	-26,154,320.48
净资产合计		418,876,059.25
负债和净资产总计		451,824,165.85

注：1、报告截止日2026年6月30日，基金份额总额445,030,379.73份，其中下属A类基金份额净值0.9615元，基金份额53,260,049.17份，下属C类基金份额净值0.9385元，基金份额391,770,330.56份。

2、本财务报表的实际编制期间为2026年3月31日(基金转型生效日)至2026年6月30日。截至报告期末本基金转型生效未满一年，本报告期不是完整报告期，本报告期按实际存续期计算，无上年度可比期间数据。

6.2 利润表

会计主体：兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

本报告期：2026年03月31日（基金转型日）至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年03月31日（基金转型日）至2026年06月30日
一、营业总收入		-136,218,591.97
1.利息收入		16,769.94
其中：存款利息收入	6.4.7.7	16,769.94
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-142,298,649.72
其中：股票投资收益	6.4.7.8	-143,855,905.13
基金投资收益	6.4.7.9	-174,835.77
债券投资收益		-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益	6.4.7.10	1,732,091.18
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.11	5,985,130.54
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.12	78,157.27
减：二、营业总支出		875,495.12
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	558,006.81
2.托管费	6.4.10.2.2	124,001.51
3.销售服务费	6.4.10.2.3	145,172.87
4.投资顾问费		-
5.利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.信用减值损失		-

7.税金及附加		110.76
8.其他费用	6.4.7.13	48,203.17
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-137,094,087.09
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-137,094,087.09
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-137,094,087.09

注：本财务报表的实际编制期间为2026年3月31日(基金转型生效日)至2026年6月30日。截至报告期末本基金转型生效未满一年，本报告期不是完整报告期，本报告期按实际存续期计算，无上年度可比期间数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

本报告期：2026年03月31日（基金转型日）至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2026年03月31日（基金转型日）至2026年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	581,911,987.33	117,309,216.18	699,221,203.51
二、本期期初净资产	581,911,987.33	117,309,216.18	699,221,203.51
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-136,881,607.60	-143,463,536.66	-280,345,144.26
（一）、综合收益总额	-	-137,094,087.09	-137,094,087.09
（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）	-136,881,607.60	-6,369,449.57	-143,251,057.17

其中：1.基金申购款	307,418,691.11	48,848,072.50	356,266,763.61
2.基金赎回款	-444,300,298.71	-55,217,522.07	-499,517,820.78
（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、本期期末净资产	445,030,379.73	-26,154,320.48	418,876,059.25

注：本财务报表的实际编制期间为2026年3月31日(基金转型生效日)至2025年6月30日。截至报告期末本基金转型生效未满一年，本报告期不是完整报告期，本报告期按实际存续期计算，无上年度可比期间数据。

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:

刘宗治	蒲延杰	楼怡斐
_____	_____	_____
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

兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(以下简称“本基金”)由兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金(以下简称“兴业中证港股通互联网指数发起式”)转型而来。兴业中证港股通互联网指数发起式系由基金管理人兴业基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定，经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2024]633号文准予募集注册。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期，首次设立募集基金份额为80,742,072.13份，经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了编号为德师报(验)字(24)第00083号的验资报告。《兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金》于2024年5月28日正式生效。本基金的基金管理人为兴业基金管理有限公司，基金托管人为长江证券股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和《兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金》的约定：“若

将来本基金管理人推出跟踪同一标的指数的交易型开放式指数基金(ETF)，则基金管理人在履行适当程序后有权决定将本基金转换为该基金的联接基金，并相应修改《兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金基金合同》。此项调整经基金管理人与基金托管人协商一致，无需召开基金份额持有人大会，在履行适当程序后及时公告。”

根据《关于兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金变更为兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金并修改基金合同及托管协议的公告》，兴业中证港股通互联网指数发起式的基金管理人经与兴业中证港股通互联网指数发起式的基金托管人协商一致后，自2026年3月31日起，兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金正式变更为兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金，《兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》(以下简称“基金合同”)生效，原《兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金基金合同》自同日起失效。

根据基金合同相关规定，本基金份额分为A类基金份额(以下简称“兴业中证港股通互联网ETF联接A”)和C类基金份额(以下简称“兴业中证港股通互联网ETF联接C”)两类份额。其中，兴业中证港股通互联网ETF联接A是指在申购时收取申购费，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额；兴业中证港股通互联网ETF联接C是指在申购时不收取申购费，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的《兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，主要投资于目标ETF基金份额、标的指数的成份股及其备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股(包含主板、创业板及其他国内依法发行上市的股票、港股通标的股票)、债券(国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、金融衍生工具(包括股指期货、国债期货)、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：中证港股通互联网指数收益率(经估值汇率调整后)×95%+银行人民币活期存款利率(税后)×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2026年6月30日的财务状况以及2026年3月31日(基金合同生效日)至2026年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2026年3月31日(基金合同生效日)至2026年6月30日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

根据本基金的业务模式和现金流量特征，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

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

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

(2)金融负债的分类

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

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

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

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

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

(1)对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

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

6.4.4.8 损益平准金

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

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1)利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

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

(2)投资收益

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

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

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

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算

的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

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

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

基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

(3)公允价值变动收益

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

(4)信用减值损失

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若基金份额持有人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金份额持有人可对A类、C类基金份额分别选择不同的分红方式；

2、基金管理人可每月对本基金相对业绩比较基准的超额收益率以及本基金的可供分配利润进行评价，收益评价日核定的基金份额净值增长率超过业绩比较基准同期增长率或者基金可供分配利润金额大于零时，基金管理人可进行收益分配。本基金可每月进行评价及收益分配，基金收益评价日、分配时间、分配方案及每次基金收益分配数额等内容，基金管理人可以根据实际情况确定并按照有关规定公告；

3、由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各类别基金份额对应的基金份额净值增长率或可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

4、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

5、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；

(2)能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；

(3)能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需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》、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]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[2021]33号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2024]8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令第826号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》、财税[2026]12号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)自2026年1月1日至2027年12月31日，公开募集证券投资基金管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，可以选择适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对公募证券投资基金(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、债券取得的收入以及金融同业往来利息收入免征增值税。

(2)对证券投资基金取得的自2025年8月8日之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税；取得的在2025年8月8日之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在2025年8月8日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

(3)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，暂不征收企业所得税。

(4)对证券投资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。

(5)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，对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。

(6)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 2026年06月30日
活期存款	41,289.24
等于：本金	41,264.45
加：应计利息	24.79
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	45,775,737.49
等于：本金	45,775,218.62
加：应计利息	518.87
减：坏账准备	-
合计	45,817,026.73

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		327,384,084.37	-	190,516,836.80	-136,867,247.57
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		251,106,695.95	-	197,257,372.93	-53,849,323.02
其他		-	-	-	-
合计		578,490,780.32	-	387,774,209.73	-190,716,570.59

6.4.7.3 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.4 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	76,863.46
应付转出补差费	325.36
合计	77,188.82

6.4.7.5 实收基金

6.4.7.5.1 兴业中证港股通互联网ETF联接A

金额单位：人民币元

项目(兴业中证港股通互联网ETF联接A)	本期 2026年03月31日（基金转型日）至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	50,594,741.17	50,594,741.17
本期申购	16,462,187.68	16,462,187.68
本期赎回（以“-”号填列）	-13,796,879.68	-13,796,879.68
本期末	53,260,049.17	53,260,049.17

6.4.7.5.2 兴业中证港股通互联网ETF联接C

金额单位：人民币元

项目(兴业中证港股通互联网ETF联接C)	本期 2026年03月31日（基金转型日）至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	531,317,246.16	531,317,246.16
本期申购	290,956,503.43	290,956,503.43
本期赎回（以“-”号填列）	-430,503,419.03	-430,503,419.03
本期末	391,770,330.56	391,770,330.56

注：申购份额含红利再投、转换入及分级份额调增份额；赎回份额含转换出及分级份额调减份额。

6.4.7.6 未分配利润

6.4.7.6.1 兴业中证港股通互联网ETF联接A

单位：人民币元

项目 (兴业中证港股通互联网ETF联接A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,854,610.73	6,689,759.27	11,544,370.00
基金合同生效日	4,854,610.73	6,689,759.27	11,544,370.00
本期利润	-14,914,441.35	67,069.18	-14,847,372.17
本期基金份额交易产生的变动数	571,503.40	683,233.30	1,254,736.70
其中：基金申购款	67,469.37	3,074,321.07	3,141,790.44
基金赎回款	504,034.03	-2,391,087.77	-1,887,053.74
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-9,488,327.22	7,440,061.75	-2,048,265.47

6.4.7.6.2 兴业中证港股通互联网ETF联接C

单位：人民币元

项目 (兴业中证港股通互联网ETF联接C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	48,599,770.29	57,165,075.89	105,764,846.18
基金合同生效日	48,599,770.29	57,165,075.89	105,764,846.18
本期利润	-128,164,776.28	5,918,061.36	-122,246,714.92
本期基金份额交易产生的变动数	10,466,796.89	-18,090,983.16	-7,624,186.27
其中：基金申购款	352,326.57	45,353,955.49	45,706,282.06
基金赎回款	10,114,470.32	-63,444,938.65	-53,330,468.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-69,098,209.10	44,992,154.09	-24,106,055.01

6.4.7.7 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年03月31日（基金转型日）至2026年06月30日
活期存款利息收入	10,438.25
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	6,331.69
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	16,769.94

6.4.7.8 股票投资收益

6.4.7.8.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年03月31日（基金转型日）至2026年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-143,855,905.13
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-143,855,905.13

6.4.7.8.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年03月31日（基金转型日）至2026年06月30日
卖出股票成交总额	363,901,045.06
减：卖出股票成本总额	507,249,889.33
减：交易费用	507,060.86
买卖股票差价收入	-143,855,905.13

6.4.7.9 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年03月31日（基金转型日）至2026年06月30日
卖出/赎回基金成交总额	2,963,222.40
减：卖出/赎回基金成本总额	3,123,133.36
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	923.01
减：交易费用	14,001.80
基金投资收益	-174,835.77

6.4.7.10 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年03月31日（基金转型日）至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,732,091.18
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,732,091.18

6.4.7.11 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年03月31日（基金转型日）至2026年06月30日
1.交易性金融资产	5,985,130.54
——股票投资	59,834,453.56
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-53,849,323.02
——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	5,985,130.54

6.4.7.12 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年03月31日（基金转型日）至2026年06月30日
基金赎回费收入	77,999.11
转换费收入	158.16
合计	78,157.27

6.4.7.13 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年03月31日（基金转型日）至2026年06月30日
审计费用	8,821.88
信息披露费	30,246.84
证券组合费	9,134.45
合计	48,203.17

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期间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
兴业基金管理有限公司(以下简称"兴业基金")	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
长江证券股份有限公司(以下简称"长江证券")	基金托管人、基金销售机构
兴业银行股份有限公司(以下简称"兴业银行")	基金管理人的控股股东、基金销售机构
中海集团投资有限公司(以下简称"中海集团")	基金管理人的股东
兴业财富资产管理有限公司(以下简称"兴业财富")	基金管理人控制的公司

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年03月31日（基金转型日）至2026年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
长江证券股份有限公司(以下简称"长江证券")	363,901,045.06	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年03月31日（基金转型日）至2026年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
长江证券股份有限公司(以下简称"长江证券")	90,975.36	100.00%	-	-

注：1、 上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金率由协议签订方参考市场价格确定。2、该类佣金协议的服务范围符合《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（中国证券监督管理委员会公告〔2024〕3 号）相关规定。《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》生效后，被动股票型基金不再通过股票交易佣金支付研究服务等其他费用，其他类型基金可以通过股票交易佣金支付研究服务费用。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年03月31日（基金转型日）至2026年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	558,006.81
其中：应支付销售机构的客户维护费	339,938.64
应支付基金管理人的净管理费	218,068.17

注：本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取管理费。支付基金管理人兴业基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF基金份额部分对应的基金资产净值后的余额（若为负数，则取0）的0.45%年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬＝（前一日基金资产净值-前一日所持有目标ETF基金份额部分对应的基金资产）×0.45%÷当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年03月31日（基金转型日）至2026年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	124,001.51

注：本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取托管费。支付基金托管人中信证券的基金托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF基金份额部分对应的基金资产净值后的余额（若为负数，则取 0）的0.10%年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金托管费＝（前一日基金资产净值-前一日所持有目标ETF基金份额部分对应的基金资产）×0.10%÷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 2026年03月31日（基金转型日）至2026年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴业中证港股通互联网ETF联接A	兴业中证港股通互联网ETF联接C	合计
兴业基金	0.00	1,436.67	1,436.67
兴业银行	0.00	6,422.59	6,422.59
长江证券	0.00	625.99	625.99
合计	0.00	8,485.25	8,485.25

注：本基金实行销售服务费分级收费方式，分设A、C两类基金份额。本基金A类基金份额不收取销售服务费；C类基金的销售服务费按前一日C类基金份额对应的资产净值的

年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：销售服务费=前一日C类基金份额对应的资产净值×0.10%÷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

本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生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 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

兴业中证港股通互联网ETF联接A

份额单位：份

项目	本期 2026年03月31日（基金转型日）至2026年06月30日
基金合同生效日（2026年03月31日）持有的基金份额	5,000,222.27
报告期初持有的基金份额	5,000,222.27
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	5,000,222.27
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	9.39%

兴业中证港股通互联网ETF联接C

份额单位：份

项目	本期 2026年03月31日（基金转型日）至2026年06月30日
基金合同生效日（2026年03月31日）持有的基金份额	5,000,222.22
报告期初持有的基金份额	5,000,222.22
报告期间申购/买入总份额	-

报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	5,000,222.22
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.28%

注：关联方投资本基金采用公允费率，即按照基金法律文件条款执行。

6.4.10.4.2 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

本基金本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年03月31日（基金转型日）至2026年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
长江证券股份有限公司	41,289.24	10,438.25

注：本基金的活期银行存款存放在基金托管人长江证券在兴业银行开立的托管账户中。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026年06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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

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

本基金在日常经营活动中面临的与本基金所投资金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金基金管理人从事风险管理的主要目标是在有效控制上述风险的前提下，通过对各类市场影响因素分析以及投资组合积极主动管理，力争获得超过业绩比较基准的长期稳定收益，使本基金在风险和收益之间取得最佳平衡。

本基金基金管理人按照"自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工"的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。本基金基金管理人建立的风险管理体系由三层风险防范等级构成：

一级风险防范是指公司董事会层面对公司的风险进行的预防和控制。董事会下设审计与风险管理委员会，负责公司审计风险的控制、管理、监督和评价；对公司经营的合法、合规性进行监控和检查，对经营活动进行审计。

二级风险防范是指公司内部控制与风险管理委员会、投资决策委员会和风险管理部层次对公司风险进行的预防和控制。管理层下设内部控制与风险管理委员会，对公司在经营管理和基金运作中的风险进行研究、分析与评估，制定相应风险控制制度并监督其执行，全面、及时、有效地防范公司经营过程中可能面临的各类风险。

三级风险防范是指公司各部门对自身业务工作风险进行的自我检查和控制。公司各部门根据经营计划、业务规则及部门具体情况，制定本部门业务流程及风险控制措施。

针对金融工具所面临的相关风险，本基金基金管理人主要通过定性与定量分析相结合的方法进行管理，即依据定性分析以判断风险损失的严重程度及同类风险损失的发生频度，凭借定量分析以确定风险损失的限度及相应的置信程度，进而及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，以确保将风险控制在可承受范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金所投资证券的发行人出现违约或拒绝支付到期利息、本金，或基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任等，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金基金管理人建立了较为完善的信用风险管理流程，通过对信用债券发行人基本面调研分析，结合流动性、信用利差、信用评级、违约风险等方面的综合评估结果，选取具有价格优势和套利机会的优质信用债券产品进行投资。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。本基金通过对银行间同业市场交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，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基金管理人旗下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%。本基金的交易所交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手，并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。

除国债、央行票据、政策性金融债外，本基金报告期末未持有按信用评级列示的债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易相对不活跃导致基金投资资产无法以适当价格及时变现，进而无法应对债务到期偿付或投资者赎回款按时支付的风险。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本报告期内，基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理。本基金所持大部分证券在证券交易所上市或银行间同业市场交易，不存在具有重大流动性风险的投资品种。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度，对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

截止本报告期末，本基金无重大流动性风险。

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银行存款、存出保证金及债券投资等。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金基金管理人主要通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2026年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	45,817,026.73	-	-	-	45,817,026.73
交易性金融资产	-	-	-	387,774,209.73	387,774,209.73
应收清算款	-	-	-	14,728,203.78	14,728,203.78
应收股利	-	-	-	532,663.82	532,663.82
应收申购款	-	-	-	2,972,061.79	2,972,061.79
资产总计	45,817,026.73	-	-	406,007,139.12	451,824,165.85
负债					
应付赎回款	-	-	-	32,688,931.66	32,688,931.66
应付管理人报酬	-	-	-	117,726.03	117,726.03

应付托管费	-	-	-	26,161.34	26,161.34
应付销售服务费	-	-	-	38,098.75	38,098.75
其他负债	-	-	-	77,188.82	77,188.82
负债总计	-	-	-	32,948,106.60	32,948,106.60
利率敏感度缺口	45,817,026.73	-	-	373,059,032.52	418,876,059.25

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末未持有债券投资及资产支持证券，因此市场利率变动而导致的利率敏感性资产的公允价值变动对基金资产净值影响不重大。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的投资范围包含港股通标的股票，如果港币资产相对人民币贬值，将对基金收益产生不利影响，港币兑人民币汇率的大幅波动也会加大基金净值的波动。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	190,516,836.80	-	190,516,836.80
应收股利	-	532,663.82	-	532,663.82
资产合计	-	191,049,500.62	-	191,049,500.62

以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	191,049,500.62	-	191,049,500.62

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除市场汇率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2026年06月30日
	港币兑人民币汇率贬值5%	-9,552,475.03
	港币兑人民币汇率升值5%	9,552,475.03

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格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。本基金主要投资于内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票、证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险可来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项，也可来源于市场整体波动。

本基金基金管理人在构建和管理投资组合过程中，通过对宏观经济情况及政策分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金基金管理人定期结合宏观及微观环境变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行动态修正，以主动应对可能发生的其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，基金管理人对本基金所持仓证券价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量，以测试本基金所面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日

	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产－股票投资	190,516,836.80	45.48
交易性金融资产－基金投资	197,257,372.93	47.09
交易性金融资产－债券投资	-	-
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	387,774,209.73	92.57

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除基金比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2026年06月30日
	基金业绩比较基准上升5%	20,353,187.72
	基金业绩比较基准下降5%	-20,353,187.72

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年06月30日
第一层次	387,774,209.73
第二层次	-
第三层次	-
合计	387,774,209.73

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可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关股票和可转换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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

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货币资金、应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相等。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）(转型前)

6.1 资产负债表

会计主体：兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2026年03月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年03月30日	上年度末 2025年12月31日

资 产：			
货币资金	6.4.7.1	55,577,504.58	36,985,727.99
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	637,932,272.57	470,769,580.88
其中：股票投资		637,932,272.57	468,749,388.00
基金投资		-	-
债券投资		-	2,020,192.88
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收清算款		15,134,248.45	13,881,541.12
应收股利		-	-
应收申购款		2,395,153.46	4,174,068.01
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.3	-	-
资产总计		711,039,179.06	525,810,918.00
负债和净资产	**附注号**	本期末 2026年03月30日	上年度末 2025年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		11,374,540.80	18,439,307.15
应付管理人报酬		272,266.89	199,603.49
应付托管费		60,503.75	44,356.30
应付销售服务费		55,368.81	39,700.04

应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.4	55,295.30	85,010.86
负债合计		11,817,975.55	18,807,977.84
净资产：			
实收基金	6.4.7.5	581,911,987.33	346,330,887.56
未分配利润	6.4.7.6	117,309,216.18	160,672,052.60
净资产合计		699,221,203.51	507,002,940.16
负债和净资产总计		711,039,179.06	525,810,918.00

注：1、报告截止日2026年3月30日，基金份额总额581,911,987.33份，其中下属A类基金份额净值1.2282元，基金份额50,594,741.17份，下属C类基金份额净值1.1991元，基金份额531,317,246.16份。

2、本期财务报表的实际编制期间为2026年1月1日至2026年3月30日(基金合同失效日前)，本报告期不是完整报告期，本报告期按实际存续期计算。

6.2 利润表

会计主体：兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年03月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年01月01日至 2026年03月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
一、营业总收入		-174,015,633.72	7,287,993.19
1.利息收入		11,512.64	11,498.08
其中：存款利息收入	6.4.7.7	11,512.64	11,498.08
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-

其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-17,806,545.08	3,517,374.66
其中：股票投资收益	6.4.7.8	-17,812,145.90	2,823,330.20
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.9	5,600.82	11,000.05
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	683,044.41
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.10	-156,424,794.36	3,638,886.05
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.11	204,193.08	120,234.40
减：二、营业总支出		1,234,418.01	440,320.34
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	829,819.60	283,326.21
2.托管费	6.4.10.2.2	184,404.34	62,961.41
3.销售服务费	6.4.10.2.3	168,968.50	47,230.04
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用	6.4.7.12	51,225.57	46,802.68
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-175,250,051.73	6,847,672.85

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-175,250,051.73	6,847,672.85
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-175,250,051.73	6,847,672.85

注：本期财务报表的实际编制期间为2026年1月1日至2026年3月30日(基金合同失效日前)，本报告期不是完整报告期，本报告期按实际存续期计算。

6.3 净资产变动表

会计主体：兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年03月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2026年01月01日至2026年03月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	346,330,887.56	160,672,052.60	507,002,940.16
二、本期期初净资产	346,330,887.56	160,672,052.60	507,002,940.16
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	235,581,099.77	-43,362,836.42	192,218,263.35
（一）、综合收益总额	-	-175,250,051.73	-175,250,051.73
（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）	235,581,099.77	131,887,215.31	367,468,315.08
其中：1.基金申购款	608,069,597.55	283,653,651.56	891,723,249.11
2.基金赎回款	-372,488,497.78	-151,766,436.25	-524,254,934.03

（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、本期期末净资产	581,911,987.33	117,309,216.18	699,221,203.51
项 目	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	40,976,721.30	10,330,239.56	51,306,960.86
二、本期期初净资产	40,976,721.30	10,330,239.56	51,306,960.86
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	79,139,509.16	51,970,784.65	131,110,293.81
（一）、综合收益总额	-	6,847,672.85	6,847,672.85
（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）	79,139,509.16	45,123,111.80	124,262,620.96
其中：1.基金申购款	268,541,611.32	134,472,560.39	403,014,171.71
2.基金赎回款	-189,402,102.16	-89,349,448.59	-278,751,550.75
（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、本期期末净资	120,116,230.46	62,301,024.21	182,417,254.67

产			

注：本期财务报表的实际编制期间为2026年1月1日至2026年3月30日(基金合同失效日前)，本报告期不是完整报告期，本报告期按实际存续期计算。

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:

刘宗治	蒲延杰	楼怡斐
_____	_____	_____
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

兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人兴业基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定，经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2024]633号文准予募集注册。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期，首次设立募集基金份额为80,742,072.13份，经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了编号为德师报(验)字(24)第00083号的验资报告。基金合同于2024年5月28日正式生效。本基金的基金管理人为兴业基金管理有限公司，基金托管人为长江证券股份有限公司。

根据基金合同相关规定，本基金份额分为A类基金份额(以下简称“兴业中证港股通互联网指数发起式A”)和C类基金份额(以下简称“兴业中证港股通互联网指数发起式C”)两类份额。其中，兴业中证港股通互联网指数发起式A是指在认购/申购时收取认购/申购费，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额；兴业中证港股通互联网指数发起式C是指在认购/申购时不收取认购/申购费，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额。

根据《关于兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金变更为兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金并修改基金合同及托管协议的公告》，自2026年3月31日起，兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金正式变更为兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金，《兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》生效，原《兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金金基金合同》自同日失效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的《兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投

资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股及其备选成份股和其他非成份股(包含主板、创业板及其他国内依法发行上市的股票)、港股通标的股票、债券(国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、金融衍生工具(包括股指期货、国债期货)、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：股票资产投资比例不低于基金资产的90%，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：中证港股通互联网指数收益率(经估值汇率调整后)×95%＋银行人民币活期存款利率(税后)×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2026年3月30日(基金合同失效前日)的财务状况以及2026年1月1日至2026年3月30日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.6 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》、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]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[2021]33号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2024]8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令第826号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》、财税[2026]12号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)自2026年1月1日至2027年12月31日，公开募集证券投资基金管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，可以选择适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对公募证券投资基金(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、债券取得的收入以及金融同业往来利息收入免征增值税。

(2)对证券投资基金取得的自2025年8月8日之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税；取得的在2025年8月8日之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在2025年8月8日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

(3)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，暂不征收企业所得税。

(4)对证券投资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。

(5)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，对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。

(6)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 2026年03月30日
活期存款	1,811.85
等于：本金	1,459.60
加：应计利息	352.25
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	55,575,692.73
等于：本金	55,574,864.68
加：应计利息	828.05
减：坏账准备	-
合计	55,577,504.58

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026年03月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		834,633,973.70	-	637,932,272.57	-196,701,701.13
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		834,633,973.70	-	637,932,272.57	-196,701,701.13

6.4.7.3 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.4 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026年03月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	55,294.74
应付转出补差费	0.56
合计	55,295.30

6.4.7.5 实收基金

6.4.7.5.1 兴业中证港股通互联网指数发起式A

金额单位：人民币元

项目(兴业中证港股通互联网指数发起式A)	本期 2026年01月01日至2026年03月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	35,614,772.64	35,614,772.64
本期申购	25,122,060.51	25,122,060.51
本期赎回（以“-”号填列）	-10,142,091.98	-10,142,091.98
本期末	50,594,741.17	50,594,741.17

6.4.7.5.2 兴业中证港股通互联网指数发起式C

金额单位：人民币元

项目(兴业中证港股通互联网指数发起式C)	本期 2026年01月01日至2026年03月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	310,716,114.92	310,716,114.92
本期申购	582,947,537.04	582,947,537.04
本期赎回（以“-”号填列）	-362,346,405.80	-362,346,405.80
本期末	531,317,246.16	531,317,246.16

注：申购份额含红利再投、转换入及分级份额调增份额；赎回份额含转换出及分级份额调减份额。

6.4.7.6 未分配利润

6.4.7.6.1 兴业中证港股通互联网指数发起式A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,603,952.43	13,044,612.36	17,648,564.79
本期期初	4,603,952.43	13,044,612.36	17,648,564.79
本期利润	-1,547,980.14	-11,558,891.68	-13,106,871.82
本期基金份额交易产生的变动数	1,798,638.44	5,204,038.59	7,002,677.03
其中：基金申购款	3,016,526.76	8,719,427.63	11,735,954.39

基金赎回款	-1,217,888.32	-3,515,389.04	-4,733,277.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,854,610.73	6,689,759.27	11,544,370.00

6.4.7.6.2 兴业中证港股通互联网指数发起式C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	38,628,983.54	104,394,504.27	143,023,487.81
本期期初	38,628,983.54	104,394,504.27	143,023,487.81
本期利润	-17,277,277.23	-144,865,902.68	-162,143,179.91
本期基金份额交易产生的变动数	27,248,063.98	97,636,474.30	124,884,538.28
其中：基金申购款	68,951,719.71	202,965,977.46	271,917,697.17
基金赎回款	-41,703,655.73	-105,329,503.16	-147,033,158.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	48,599,770.29	57,165,075.89	105,764,846.18

6.4.7.7 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年03月30日
活期存款利息收入	2,807.31
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	8,705.33
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	11,512.64

6.4.7.8 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年03月30日

卖出股票成交总额	120,745,071.47
减：卖出股票成本总额	137,745,534.28
减：交易费用	811,683.09
买卖股票差价收入	-17,812,145.90

6.4.7.9 债券投资收益

6.4.7.9.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年03月30日
债券投资收益——利息收入	6,380.82
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-780.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	5,600.82

6.4.7.9.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年03月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,025,953.70
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,000,760.00
减：应计利息总额	25,973.70
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-780.00

6.4.7.10 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年01月01日至2026年03月30日
1.交易性金融资产	-156,424,794.36
——股票投资	-156,424,954.36
——债券投资	160.00
——资产支持证券投资	-
——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	-156,424,794.36

6.4.7.11 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年03月30日
基金赎回费收入	201,064.27
转换费收入	3,128.81
合计	204,193.08

6.4.7.12 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年03月30日
审计费用	8,534.21
信息披露费	29,260.53

证券组合费	13,430.83
合计	51,225.57

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期间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
兴业基金管理有限公司(以下简称"兴业基金")	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
长江证券股份有限公司(以下简称"长江证券")	基金托管人、基金销售机构
兴业银行股份有限公司(以下简称"兴业银行")	基金管理人的控股股东、基金销售机构
中海集团投资有限公司(以下简称"中海集团")	基金管理人的股东
兴业财富资产管理有限公司(以下简称"兴业财富")	基金管理人控制的公司

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	上年度可比期间

	2026年01月01日至2026年03月30日		2025年01月01日至2025年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
长江证券股份有限公司(以下简称"长江证券")	584,098,444.68	100.00%	266,317,684.57	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年03月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
长江证券	-	-	13,474,020.31	100.00%

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年03月30日			
	当期	占当期	期末应	占期末应

	佣金	佣金总量的比例	付佣金余额	付佣金总额的比例
长江证券股份有限公司(以下简称"长江证券")	146,023.93	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
长江证券	66,578.48	100.00%	-	-

注:1、上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金率由协议签订方参考市场价格确定。
2、该类佣金协议的服务范围符合《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（中国证券监督管理委员会公告〔2024〕3号）相关规定。《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》生效后，被动股票型基金不再通过股票交易佣金支付研究服务等其他费用，其他类型基金可以通过股票交易佣金支付研究服务费用。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年03月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	829,819.60	283,326.21
其中：应支付销售机构的客户维护费	402,429.75	115,918.71
应支付基金管理人的净管理费	427,389.85	167,407.50

注：支付基金管理人兴业基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.45%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.45%÷当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年03月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	184,404.34	62,961.41

注：支付基金托管人长江证券的基金托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷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 2026年01月01日至2026年03月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴业中证港股通互联网指数发起式A	兴业中证港股通互联网指数发起式C	合计
兴业银行	0.00	8,488.71	8,488.71
长江证券	0.00	466.68	466.68
兴业基金	0.00	1,726.08	1,726.08
合计	0.00	10,681.47	10,681.47
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴业中证港股通互联网指数发起式A	兴业中证港股通互联网指数发起式C	合计
兴业银行	0.00	2,088.51	2,088.51

长江证券	0.00	541.08	541.08
合计	0.00	2,629.59	2,629.59

注：本基金实行销售服务费分级收费方式，分设A、C两类基金份额。本基金A类基金份额不收取销售服务费；C类基金的销售服务费按前一日C类基金份额对应的资产净值的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：销售服务费=前一日C类基金份额对应的资产净值×0.10%÷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

本基金本报告期内未发生与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)交易的情况。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

兴业中证港股通互联网指数发起式A

份额单位：份

项目	本期 2026年01月01日至 2026年03月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至 2025年06月30日
报告期初持有的基金份额	5,000,222.27	5,000,222.27
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	5,000,222.27	5,000,222.27
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	9.88%	19.62%

兴业中证港股通互联网指数发起式C

份额单位：份

项目	本期 2026年01月01日至 2026年03月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至 2025年06月30日
报告期初持有的基金份额	5,000,222.22	5,000,222.22
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-

减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	5,000,222.22	5,000,222.22
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.94%	5.28%

注：关联方投资本基金采用公允费率，即按照基金法律文件条款执行。

6.4.10.4.2 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

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年03月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
长江证券股份有限公司	1,811.85	2,807.31	474,670.60	6,415.42

注：本基金的活期银行存款存放在基金托管人长江证券在兴业银行开立的托管账户中。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026年03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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

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

本基金在日常经营活动中面临的与本基金所投资金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金基金管理人从事风险管理的主要目标是在有效控制上述风险的前提下，通过对各类市场影响因素分析以及投资组合积极主动管理，力争获得超过业绩比较基准的长期稳定收益，使本基金在风险和收益之间取得最佳平衡。

本基金基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。本基金基金管理人建立的风险管理体系由三层风险防范等级构成：

一级风险防范是指公司董事会层面对公司的风险进行的预防和控制。董事会下设审计与风险管理委员会，负责公司审计风险的控制、管理、监督和评价；对公司经营的合法、合规性进行监控和检查，对经营活动进行审计。

二级风险防范是指公司内部控制与风险管理委员会、投资决策委员会和风险管理部层次对公司风险进行的预防和控制。管理层下设内部控制与风险管理委员会，对公司在经营管理和基金运作中的风险进行研究、分析与评估，制定相应风险控制制度并监督其执行，全面、及时、有效地防范公司经营过程中可能面临的各类风险。

三级风险防范是指公司各部门对自身业务工作风险进行的自我检查和控制。公司各部门根据经营计划、业务规则及部门具体情况，制定本部门业务流程及风险控制措施。

针对金融工具所面临的相关风险，本基金基金管理人主要通过定性与定量分析相结合的方法进行管理，即依据定性分析以判断风险损失的严重程度及同类风险损失的发生频度，凭借定量分析以确定风险损失的限度及相应的置信程度，进而及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，以确保将风险控制在可承受范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金所投资证券的发行人出现违约或拒绝支付到期利息、本金，或基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任等，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金基金管理人建立了较为完善的信用风险管理流程，通过对信用债券发行人基本面调研分析，结合流动性、信用利差、信用评级、违约风险等方面的综合评估结果，选取具有价格优势和套利机会的优质信用债券产品进行投资。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。本基金通过对银行间同业市场交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，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基金管理人旗下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%。本基金的交易所交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手，并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。

除国债、央行票据、政策性金融债外，本基金报告期末及上年度末未持有按信用评级列示的债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易相对不活跃导致基金投资资产无法以适当价格及时变现，进而无法应对债务到期偿付或投资者赎回款按时支付的风险。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本报告期内，基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理。本基金所持大部分证券在证券交易所上市或银行间同业市场交易，不存在具有重大流动性风险的投资品种。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度，按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

截止本报告期末及上年度末，本基金无重大流动性风险。

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银行存款、结算备付金及债券投资等。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金基金管理人主要通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2026年03月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	55,577,504.58	-	-	-	55,577,504.58
交易性金融资产	-	-	-	637,932,272.57	637,932,272.57
应收清算款	-	-	-	15,134,248.45	15,134,248.45
应收申购款	-	-	-	2,395,153.46	2,395,153.46
资产总计	55,577,504.58	-	-	655,461,674.48	711,039,179.06
负债					
应付赎回款	-	-	-	11,374,540.80	11,374,540.80
应付管理人报酬	-	-	-	272,266.89	272,266.89
应付托管费	-	-	-	60,503.75	60,503.75

应付销售服务费	-	-	-	55,368.81	55,368.81
其他负债	-	-	-	55,295.30	55,295.30
负债总计	-	-	-	11,817,975.55	11,817,975.55
利率敏感度缺口	55,577,504.58	-	-	643,643,698.93	699,221,203.51
上年度末2025年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	36,985,727.99	-	-	-	36,985,727.99
交易性金融资产	2,020,192.88	-	-	468,749,388.00	470,769,580.88
应收清算款	-	-	-	13,881,541.12	13,881,541.12
应收申购款	-	-	-	4,174,068.01	4,174,068.01
资产总计	39,005,920.87	-	-	486,804,997.13	525,810,918.00
负债					
应付赎回款	-	-	-	18,439,307.15	18,439,307.15
应付管理人报酬	-	-	-	199,603.49	199,603.49
应付托管费	-	-	-	44,356.30	44,356.30
应付销售服务费	-	-	-	39,700.04	39,700.04

其他负债	-	-	-	85,010.86	85,010.86
负债总计	-	-	-	18,807,977.84	18,807,977.84
利率敏感度缺口	39,005,920.87	-	-	467,997,019.29	507,002,940.16

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
假设	利率曲线平行移动		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2026年03月30日	上年度末 2025年12月31日
	市场利率上升25个基点	-	-1,446.43
	市场利率下降25个基点	-	1,448.51

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的投资范围包含港股通标的股票，如果港币资产相对人民币贬值，将对基金收益产生不利影响，港币兑人民币汇率的大幅波动也会加大基金净值的波动。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026年03月30日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	637,932,272.57	-	637,932,272.57
资产合计	-	637,932,272.5	-	637,932,272.5

		7		7
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	637,932,272.57	-	637,932,272.57
项目	上年度末 2026年03月30日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	468,749,388.00	-	468,749,388.00
资产合计	-	468,749,388.00	-	468,749,388.00
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	468,749,388.00	-	468,749,388.00

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除市场汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2026年03月30日	上年度末 2025年12月31日
	港币兑人民币汇率贬值5%	-31,896,613.63	-23,437,469.40
	港币兑人民币汇率升值5%	31,896,613.63	23,437,469.40

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格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。本基金主要投资于内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票、证券交

易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险可来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项，也可来源于市场整体波动。

本基金基金管理人在构建和管理投资组合过程中，通过对宏观经济情况及政策分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金基金管理人定期结合宏观及微观环境变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行动态修正，以主动应对可能发生的其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，基金管理人对本基金所持仓证券价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量，以测试本基金所面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026年03月30日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产－股票投资	637,932,272.57	91.23	468,749,388.00	92.45
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	-	-	-	-
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	637,932,272.57	91.23	468,749,388.00	92.45

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除股票价格以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末 2026年03月30日	上年度末 2025年12月31日
	股票价格上升5%	31,896,613.63	23,437,469.40
	股票价格下降5%	-31,896,613.63	-23,437,469.40

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值;第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位:人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年03月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	637,932,272.57	468,749,388.00
第二层次	-	2,020,192.88
第三层次	-	-
合计	637,932,272.57	470,769,580.88

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可转换债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况,本基金分别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不将相关股票和可转换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,确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

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货币资金、应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相等。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告(转型后)

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	190,516,836.80	42.17
	其中：股票	190,516,836.80	42.17
2	基金投资	197,257,372.93	43.66
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	45,817,026.73	10.14
8	其他各项资产	18,232,929.39	4.04
9	合计	451,824,165.85	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例（%）
非日常生活消费品	70,315,011.27	16.79
金融	3,509,636.84	0.84
医疗保健	1,602,313.20	0.38
信息技术	53,340,015.34	12.73
通讯业务	54,536,972.78	13.02
房地产	7,212,887.37	1.72
合计	190,516,836.80	45.48

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	H00700	腾讯控股	83,600	31,208,113.24	7.45
2	H09988	阿里巴巴－W	323,000	26,048,292.20	6.22
3	H03690	美团－W	421,800	25,095,275.72	5.99
4	H01810	小米集团－W	1,262,400	23,727,340.73	5.66
5	H01024	快手－W	213,400	7,710,500.51	1.84
6	H06618	京东健康	255,850	7,297,656.11	1.74
7	H09626	哔哩哔哩－W	63,460	7,259,064.70	1.73
8	H02423	贝壳－W	221,100	7,212,887.37	1.72
9	H00020	商汤－W	5,968,000	6,945,898.58	1.66
10	H03888	金山软件	272,400	5,247,633.18	1.25
11	H00268	金蝶国际	884,000	4,545,365.34	1.09
12	H00241	阿里健康	1,654,000	4,424,671.64	1.06
13	H00780	同程旅行	358,400	3,732,346.96	0.89
14	H00136	中国儒意	2,872,000	3,716,768.64	0.89

15	H02400	心动公司	74,400	2,875,595.34	0.69
16	H01797	东方甄选	135,500	2,657,406.89	0.63
17	H06060	众安在线	336,200	2,628,058.59	0.63
18	H01357	美图公司	803,000	2,615,421.19	0.62
19	H01860	汇量科技	284,000	2,498,748.87	0.60
20	H03896	金山云	556,000	2,240,720.03	0.53
21	H00772	阅文集团	131,400	2,159,291.73	0.52
22	H09899	网易云音乐	21,400	1,912,599.21	0.46
23	H06682	范式智能	91,900	1,906,095.51	0.46
24	H01833	平安好医生	264,300	1,602,313.20	0.38
25	H01060	大麦娱乐	3,080,000	1,217,185.97	0.29
26	H02858	易鑫集团	812,000	881,578.25	0.21
27	H02556	迈富时	32,200	853,562.30	0.20
28	H00917	趣致集团	26,900	194,622.08	0.05
29	H02643	曹操出行	5,900	101,822.72	0.02

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期未卖出股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	H09988	阿里巴巴－W	63,824,081.72	15.24
2	H00700	腾讯控股	56,396,651.81	13.46
3	H01810	小米集团－W	46,933,869.80	11.20
4	H03690	美团－W	42,563,310.72	10.16
5	H02423	贝壳－W	20,495,154.52	4.89
6	H00020	商汤－W	15,593,335.68	3.72
7	H06618	京东健康	12,124,427.36	2.89

8	H01024	快手－W	11,846,224.98	2.83
9	H09626	哔哩哔哩－W	11,723,553.72	2.80
10	H00268	金蝶国际	8,345,877.02	1.99
11	H00241	阿里健康	7,690,745.82	1.84
12	H03888	金山软件	7,207,638.51	1.72
13	H00780	同程旅行	6,584,456.34	1.57
14	H03896	金山云	6,254,086.20	1.49
15	H00136	中国儒意	5,091,552.37	1.22
16	H02400	心动公司	4,983,145.74	1.19
17	H01357	美图公司	4,462,626.80	1.07
18	H09899	网易云音乐	4,447,096.48	1.06
19	H01860	汇量科技	4,440,246.71	1.06
20	H01797	东方甄选	3,759,726.80	0.90

卖出金额按卖出成交金额（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	-
卖出股票收入（成交）总额	363,901,045.06

买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

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

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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	兴业中证港股通互联网ETF	股票型	契约型开放式	兴业基金管理有限公司	197,257,372.93	47.09

7.11 本基金投资股指期货的投资政策

以套期保值为目的配置股指期货，当期货价格相对现货贴水幅度较大时增加期货多头套保额度，当期货价格相对现货贴水幅度减少时，减少期货多头套保额度。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.12.1 本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货，根据风险管理的原则，充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。

7.12.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未参与国债期货投资。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.13.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	14,728,203.78
3	应收股利	532,663.82
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,972,061.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,232,929.39

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§7 投资组合报告（转型前）

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	637,932,272.57	89.72
	其中：股票	637,932,272.57	89.72
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	55,577,504.58	7.82
8	其他各项资产	17,529,401.91	2.47
9	合计	711,039,179.06	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

本基金本报告期末未持有境内股票。

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

本基金本报告期末未持有境内股票。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例（%）
非日常生活消费品	239,094,109.43	34.19
金融	11,784,536.57	1.69
医疗保健	6,632,167.43	0.95
信息技术	185,754,637.64	26.57
通讯业务	167,891,171.53	24.01
房地产	26,775,649.97	3.83
合计	637,932,272.57	91.23

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	H09988	阿里巴巴－W	930,300	99,079,480.42	14.17
2	H00700	腾讯控股	224,200	95,432,376.52	13.65
3	H01810	小米集团－	3,131,600	89,622,443.68	12.82

		W			
4	H03690	美团－W	1,034,600	76,994,236.75	11.01
5	H02423	贝壳－W	774,800	26,775,649.97	3.83
6	H00020	商汤－W	16,129,000	26,515,146.97	3.79
7	H06618	京东健康	581,700	24,606,248.78	3.52
8	H09626	哔哩哔哩－W	148,800	22,765,314.36	3.26
9	H01024	快手－W	508,800	20,245,394.60	2.90
10	H00241	阿里健康	3,832,000	15,884,443.19	2.27
11	H00268	金蝶国际	2,097,000	15,754,006.08	2.25
12	H00780	同程旅行	831,600	13,413,774.53	1.92
13	H03888	金山软件	633,200	12,782,348.63	1.83
14	H03896	金山云	1,588,000	10,161,614.54	1.45
15	H02400	心动公司	177,400	9,877,972.61	1.41
16	H00136	中国儒意	6,876,000	9,115,925.76	1.30
17	H01860	汇量科技	644,000	7,786,559.69	1.11
18	H06060	众安在线	674,900	7,712,791.75	1.10
19	H01797	东方甄选	310,000	7,501,857.15	1.07
20	H01357	美图公司	1,940,000	7,407,286.27	1.06
21	H09899	网易云音乐	64,450	7,365,379.00	1.05
22	H00772	阅文集团	303,400	6,854,094.35	0.98
23	H01833	平安好医生	643,000	6,632,167.43	0.95
24	H06682	范式智能	191,100	6,158,160.50	0.88
25	H01060	大麦娱乐	7,190,000	4,003,530.05	0.57
26	H02858	易鑫集团	2,010,000	3,855,044.93	0.55
27	H02556	迈富时	60,100	1,752,919.87	0.25
28	H00917	趣致集团	94,200	1,347,110.04	0.19
29	H02643	曹操出行	13,900	312,294.26	0.04
30	H02562	狮腾控股	82,000	216,699.89	0.03

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

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	H09988	阿里巴巴－W	71,911,362.75	14.18
2	H00700	腾讯控股	67,378,725.75	13.29
3	H01810	小米集团－W	57,468,310.09	11.33
4	H03690	美团－W	51,892,982.33	10.24
5	H00020	商汤－W	22,260,417.26	4.39
6	H09626	哔哩哔哩－W	19,742,325.12	3.89
7	H01024	快手－W	18,959,167.01	3.74
8	H02423	贝壳－W	18,527,680.81	3.65
9	H06618	京东健康	17,837,795.78	3.52
10	H00268	金蝶国际	15,314,397.40	3.02
11	H00241	阿里健康	11,320,859.87	2.23
12	H03888	金山软件	9,046,624.07	1.78
13	H00780	同程旅行	8,933,870.39	1.76
14	H01357	美图公司	7,515,122.66	1.48
15	H00136	中国儒意	7,096,370.82	1.40
16	H02400	心动公司	6,544,185.86	1.29
17	H01860	汇量科技	5,946,293.14	1.17
18	H03896	金山云	5,899,664.42	1.16
19	H06060	众安在线	5,754,697.33	1.14
20	H06682	范式智能	5,413,746.74	1.07

买入金额按买入成交金额（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	H00700	腾讯控股	18,180,077.34	3.59
2	H09988	阿里巴巴－W	15,906,902.63	3.14
3	H01810	小米集团－W	14,181,311.37	2.80
4	H03690	美团－W	13,273,547.73	2.62
5	H00020	商汤－W	7,317,358.67	1.44
6	H09626	哔哩哔哩－W	6,522,773.89	1.29
7	H02423	贝壳－W	5,514,619.72	1.09
8	H01024	快手－W	4,862,795.87	0.96
9	H00268	金蝶国际	4,071,705.94	0.80
10	H06618	京东健康	3,827,236.18	0.75
11	H00241	阿里健康	2,475,180.34	0.49
12	H03896	金山云	2,388,007.38	0.47
13	H00780	同程旅行	2,140,006.26	0.42
14	H03888	金山软件	2,127,768.16	0.42
15	H01860	汇量科技	1,983,549.91	0.39
16	H06682	范式智能	1,891,697.16	0.37
17	H01357	美图公司	1,837,611.96	0.36
18	H02400	心动公司	1,653,837.12	0.33
19	H01797	东方甄选	1,619,618.61	0.32
20	H00136	中国儒意	1,582,040.71	0.31

卖出金额按卖出成交金额（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	463,353,373.21
卖出股票收入（成交）总额	120,745,071.47

买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

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

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

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

以套期保值为目的配置股指期货，当期货价格相对现货贴水幅度较大时增加期货多头套保额度，当期货价格相对现货贴水幅度减少时，减少期货多头套保额度。

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

本基金投资国债期货，根据风险管理的原则，充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未参与国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票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	-

2	应收清算款	15,134,248.45
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,395,153.46
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,529,401.91

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

§8 基金份额持有人信息(转型后)

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
兴业中证港股通互	2,465	21,606.51	5,000,222.27	9.39%	48,259,826.90	90.61%

联网ETF联接A						
兴业中证港股通互联网ETF联接C	54,701	7,162.03	5,000,232.22	1.28%	386,770,098.34	98.72%
合计	56,843	7,829.11	10,000,454.49	2.25%	435,029,925.24	97.75%

注：1、分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属两级基金，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两级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、持有人户数（户）合计数中针对同时持有各分级基金份额的持有人算为一户。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	兴业中证港股通互联网ETF联接A	637,985.38	1.20%
	兴业中证港股通互联网ETF联接C	713,509.07	0.18%
	合计	1,351,494.45	0.30%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	兴业中证港股通互联网ETF联接A	-
	兴业中证港股通互联网ETF联接C	-
	合计	-

本基金基金经理持有本开放式基金	兴业中证港股通互联网ETF联接A	-
	兴业中证港股通互联网ETF联接C	10~50
	合计	10~50

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,444.49	2.25%	10,000,444.49	2.25%	三年
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	10,000,444.49	2.25%	10,000,444.49	2.25%	三年

§8 基金份额持有人信息(转型前)

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
兴业中证港股	2,403	21,054.82	5,000,222.27	9.88%	45,594,518.90	90.12%

通互联网指数发起式A						
兴业中证港股通互联网指数发起式C	81,178	6,545.09	5,000,232.22	0.94%	526,317,013.94	99.06%
合计	83,279	6,987.50	10,000,454.49	1.72%	571,911,532.84	98.28%

注：1、分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属两级基金，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两级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、持有人户数（户）合计数中针对同时持有各分级基金份额的持有人算为一户。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	兴业中证港股通互联网指数发起式A	1,729,258.95	3.42%
	兴业中证港股通互联网指数发起式C	618,104.00	0.12%
	合计	2,347,362.95	0.40%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资	兴业中证港股通互	-

和研究部门负责人持有本开放式基金	联网指数发起式A	
	兴业中证港股通互联网指数发起式C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	兴业中证港股通互联网指数发起式A	-
	兴业中证港股通互联网指数发起式C	10~50
	合计	10~50

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,444.49	1.72%	10,000,444.49	1.72%	三年
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	10,000,444.49	1.72%	10,000,444.49	1.72%	三年

§9 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

	兴业中证港股通互联网ETF联接A	兴业中证港股通互联网ETF联接C
基金合同生效日(2026年03月31日)基金份额总额	50,594,741.17	531,317,246.16
基金合同生效日起至报告期期末	16,462,187.68	290,956,503.43

基金总申购份额		
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	13,796,879.68	430,503,419.03
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	53,260,049.17	391,770,330.56

注：申购份额含红利再投、转换入及分级份额调增份额；赎回份额含转换出及分级份额调减份额。

§9 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

	兴业中证港股通互联网指数发起式A	兴业中证港股通互联网指数发起式C
基金合同生效日(2024年05月28日)基金份额总额	69,069,972.31	11,672,099.82
本报告期期初基金份额总额	35,614,772.64	310,716,114.92
本报告期基金总申购份额	25,122,060.51	582,947,537.04
减：本报告期基金总赎回份额	10,142,091.98	362,346,405.80
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	50,594,741.17	531,317,246.16

注：申购份额含红利再投、转换入及分级份额调增份额；赎回份额含转换出及分级份额调减份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

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、2026年7月20日，黄文锋先生离任兴业基金管理有限公司副总经理。详见本公司于2026年7月21日发布的《兴业基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。

2、2026年7月20日，李辉先生离任兴业基金管理有限公司总经理，由董事长刘宗治先生代为履行总经理职务。详见本公司于2026年7月21日发布的《兴业基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。

3、2026年7月31日，周鸣女士担任兴业基金管理有限公司总经理助理。详见本公司于2026年8月3日发布的《兴业基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。

4、本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未因托管业务受到监管部门稽查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员不存在受调查或处罚等情况。

转型后

报告期2026年03月31日（基金转型日） - 2026年06月30日

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	2	363,901,045.06	100.00%	90,975.36	100.00%	-

①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择证券经纪机构的标准，即：i资力雄厚,信誉良好,注册资本不少于3亿元人民币。ii财务状况良好,经营行为规范,最近一年未因发生重大违法违规行为而受到有关管理机关处罚。iii内部管理规范、严格,具备健全的内控制度,合规风控能力较强，并能满足各产品运作高度保密的要求。iv具备各标准化产品运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理各标准化产品进行证券交易的需要,并能为各标准化产品提供全面的信息服务，交易能力较强。v研究综合实力较强。vi其他因素（例如，虽综合能力一般，但在某些特色领域或行业，其研究能力、深度和质量在行业领先）。

②基金管理人经内部适当程序，参照前述标准选择合作的证券经纪机构。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
长江证券	-	-	-	-	-	-	225,064,477.10	100.00%

转型前

报告期2026年01月01日 - 2026年03月30日

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股	佣金	占当期佣	

	单元数量		票成交总额的比例		金总量的比例	
长江证券	2	584,098,444.68	100.00%	146,023.93	100.00%	-

①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择证券经纪机构的标准，即：i资力雄厚,信誉良好,注册资本不少于3亿元人民币。ii财务状况良好,经营行为规范,最近一年未因发生重大违法违规行为而受到有关管理机关处罚。iii内部管理规范、严格,具备健全的内控制度,合规风控能力较强，并能满足各产品运作高度保密的要求。iv具备各标准化产品运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理各标准化产品进行证券交易的需要,并能为各标准化产品提供全面的信息服务，交易能力较强。v研究综合实力较强。vi其他因素（例如，虽综合能力一般，但在某些特色领域或行业，其研究能力、深度和质量在行业领先）。

②基金管理人经内部适当程序，参照前述标准选择合作的证券经纪机构。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
长江证券	1,999,980.00	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	兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金2025年第四季度报告	中国证监会规定的媒介	2026-01-22
2	兴业基金管理有限公司关于旗下部分基金2026年非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告	中国证监会规定的媒介	2026-01-30

3	兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金招募说明书更新	中国证监会规定的媒介	2026-02-13
4	兴业基金管理有限公司关于住所变更的公告	中国证监会规定的媒介	2026-03-27
5	兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金2025年年度报告	中国证监会规定的媒介	2026-03-28
6	兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金产品资料概要	中国证监会规定的媒介	2026-03-30
7	兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议	中国证监会规定的媒介	2026-03-30
8	兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同	中国证监会规定的媒介	2026-03-30
9	兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金招募说明书	中国证监会规定的媒介	2026-03-30
10	关于兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金变更为兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金并修改基金合同及托管协议的公告	中国证监会规定的媒介	2026-03-30
11	兴业基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025年度）	中国证监会规定的媒介	2026-03-31
12	兴业中证港股通互联网交易	中国证监会规定的媒介	2026-04-22

	型开放式指数证券投资基金发起式联接基金2026年第一季度报告		
13	兴业基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会规定的媒介	2026-06-16
14	兴业基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金风险评价结果及旗下部分基金风险等级调整的通知	中国证监会规定的媒介	2026-06-18
15	兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定的媒介	2026-06-23

§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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

为更好地满足投资者的投资需求，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和《基金合同》的约定：“若将来本基金管理人推出跟踪同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），则基金管理人在履行适当程序后有权决定将本基金转换为该基金的联接基金，并相应修改《基金合同》。此项调整经基金管理人与基金托管人协商一致，无需召开基金份额持有人大会，在履行适当程序后及时公告。”本公司经与本基金的基金托管人长江证券股份有限公司协商一致后，决定自2026年3月31日起，将兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金变更为兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金，并据此修订《基金合同》。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

（一）兴业中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金募集注册的文件

（二）《兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》

（三）《兴业中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》

（四）法律意见书

（五）基金管理人业务资格批件和营业执照

（六）基金托管人业务资格批件和营业执照

（七）中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的住所

12.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅 。

网站：http：//www.cib-fund.com.cn

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人兴业基金管理有限公司。

客户服务中心电话 4000095561

兴业基金管理有限公司

二〇二六年八月二十九日