兴业臻选回报混合型证券投资基金

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:中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业银行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03月17日起至06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 6
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 7
3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 7
§4 管理人报告 10
4.1 基金管理人及基金经理情况 10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 13
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 13
§5 托管人报告 13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 14
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 14
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 14
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 14
6.1 资产负债表 14
6.2 利润表 16
6.3 净资产变动表 17
6.4 报表附注 19
§7 投资组合报告 44
7.1 期末基金资产组合情况 44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 45
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 46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 50
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 50
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 50
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 50
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 50
7.12 投资组合报告附注 50
§8 基金份额持有人信息 51

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 52
§9 开放式基金份额变动 53
§10 重大事件揭示 53
10.1 基金份额持有人大会决议 53
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 54
10.4 基金投资策略的改变 54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 54
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 54
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 54
10.8 其他重大事件 56
§11 影响投资者决策的其他重要信息 57
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 57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 57
§12 备查文件目录 57
12.1 备查文件目录 57
12.2 存放地点 57
12.3 查阅方式 57

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴业臻选回报混合型证券投资基金	
基金简称	兴业臻选回报混合	
基金主代码	026267	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026年03月17日	
基金管理人	兴业基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,785,149,646.88份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	兴业臻选回报混合A	兴业臻选回报混合C
下属分级基金的交易代码	026267	026268
报告期末下属分级基金的份额总额	1,067,515,513.43份	1,717,634,133.45份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金把握宏观经济和投资市场的变化趋势，动态调整投资组合比例，自上而下配置资产，有效分散风险，力求获取超额收益。 （1）大类资产配置策略；（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）债券类资产投资策略；（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）参与融资业务的投资策略
业绩比较基准	沪深300指数收益率*65%+中债综合全价指数收益率*20%+中证港股通综合指数收益率(经估值汇率调整)*15%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

	本基金若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、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		兴业基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张顺国	任航
	联系电话	021-22211888	010-66060069
	电子邮箱	zhaoyue@cib-fund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		40000-95561	95599
传真		021-22211997	010-68121816
注册地址		福建省福州市鼓楼区湖东路154号中山大厦A座5层507室	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址		上海市浦东新区银城路167号13、14层	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		200120	100031
法定代表人		刘宗治	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

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17日（基金合同生效日）-2026年06月30日)	
	兴业臻选回报混合A	兴业臻选回报混合C
本期已实现收益	10,807,595.85	14,974,193.05
本期利润	26,481,382.07	39,936,981.88
加权平均基金份额本期利润	0.0198	0.0190
本期加权平均净值利润率	1.97%	1.89%
本期基金份额净值增长率	2.22%	2.10%
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	10,554,059.47	14,963,155.18
期末可供分配基金份额利润	0.0099	0.0087
期末基金资产净值	1,091,166,891.58	1,753,652,939.23
期末基金份额净值	1.0222	1.0210
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	2.22%	2.10%

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、本基金合同生效日为2026年3月17日，本报告期不是完整报告期。

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

兴业臻选回报混合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	2.33%	0.34%	6.35%	0.94%	-4.02%	-0.60%
自基金合同生效起至今	2.22%	0.32%	2.37%	0.98%	-0.15%	-0.66%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率*65%+中债综合全价指数收益率*20%+中证港股通综合指数收益率（经估值汇率调整）*15%

兴业臻选回报混合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	2.23%	0.34%	6.35%	0.94%	-4.12%	-0.60%
自基金合同生效起至今	2.10%	0.32%	2.37%	0.98%	-0.27%	-0.66%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率*65%+中债综合全价指数收益率*20%+中证港股通综合指数收益率（经估值汇率调整）*15%

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：1、本基金基金合同于2026年03月17日生效，截至报告期末本基金基金合同生效未满一年。

2、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。



注：1、本基金基金合同于2026年03月17日生效，截至报告期末本基金基金合同生效未满一年。

2、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。

§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

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		
高圣	基金经理	2026-03-17	-	17年	中国籍，硕士学位，特许金融分析师（CFA），金融风险管理师(FRM)，具有证券投资基金从业资格。2009年4月至2012年7月在华泰证券股份有限公司研究所担任行业分析师，从事行业及公司研究。2012年7月至2017年8月在海通证券股份有限公司权益投资交易部担

					任行业公司研究岗位，从事股票投资研究工作。2017年9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

2026年上半年A股市场整体震荡上涨，其中上证指数上涨3.16%、深证成指上涨19.82%、创业板指上涨35.58%，沪深300上涨7.55%。3月初受美以伊冲突导致油价大幅上涨等海外不确定因素影响，A股出现阶段性调整，4月后随着油价回落以及全球AI叙事得到更广泛的认同，A股科技板块表现突出并带动市场整体上行。但由于国内投资、消费等相关数据在二季度表现偏弱，A股顺周期方向整体一般。

本基金产品在今年3月成立后开始逐步建仓，目前产品仍处于建仓期。当前本基金主要配置于A股市场，在A股的电子、通信、非银、医药、新能源等行业均有配置，后续将逐步在市场波动中提升仓位，下一步重点配置方向将包括以下两大类：1.高景气的

AI产业链中仍具有合适估值性价比和长期发展空间的个股标的；2.非AI相关行业中，今年上半年股价在明显调整后估值已经落入合理甚至低估区间的具有长期竞争力和良好业绩的优质标的。

展望2026年下半年，我们对市场整体持偏乐观的态度，我们将在产品建仓期内逐步完成产品的建仓。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴业臻选回报混合A基金份额净值为1.0222元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.22%，同期业绩比较基准收益率为2.37%；截至报告期末兴业臻选回报混合C基金份额净值为1.0210元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.10%，同期业绩比较基准收益率为2.37%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026年上半年国内宏观经济整体平稳，新旧动能切换，二季度或为年内增长低点。2026年上半年我国生产总体平稳，出口表现强劲，财政政策节奏前置，对经济形成明显拉动。经济处于新旧动能加速转换周期：以AI、高端制造为代表的新经济，成为经济主要增长动力；地产、传统基建等旧经济对经济的贡献趋于稳定，占比持续缓慢下行。地产行业最快速下行阶段已经结束，但实现全面止跌还需要时间。

上半年国内GDP同比增速4.7%，分季度看，一季度同比5.0%，二季度回落至4.3%。进入二季度，高油价冲击叠加内需不足的问题逐步显现，消费、投资数据明显走弱：5月社会消费品零售总额增速转负，投资跌幅进一步扩大，地产维持低位震荡。受消费、投资拖累，二季度大概率是本年度经济扰动最大的阶段，或是全年GDP增速低点，预计下半年经济增速相比二季度有望修复回升。

海外环境：经济具备韧性，高油价、高利率带来不确定性。海外经济尚未快速失速，依旧保有一定韧性，油价是当前最大外部扰动，美联储政策预期反复波动。上半年全球制造业持续修复，美国经济内生动力尚可，劳动力市场维持紧平衡；但美伊冲突推高国际油价，扰动通胀预期与全球供应链。美国通胀数据韧性较强，市场由年初降息宽松预期，转而开始担忧重启加息，带动美元、美债收益率反复震荡。整体来看，海外没有出现快速衰退，但高油价、高利率带来的滞后影响仍需持续跟踪。

2026年上半年，AI产业链是全球最重要投资方向。北美企业资本开支维持高位，AI基础设施需求持续扩张。我国AI硬件产业链同时受益于两大逻辑：一是海外科技巨头资本开支扩张带来订单外溢，二是国内产业自主可控政策驱动。在全球AI供应链里，国内侧重AI基础设施及配套制造，光模块、高阶PCB、服务器组装、液冷散热等硬件深度嵌入北美主导的全球供应链；同时半导体设备、芯片等自主可控赛道也实现高速增长。受上述逻辑驱动，上半年A股资金集中抱团AI科技板块，板块行情演绎较为极致。

我们对2026年下半年的A股市场整体偏乐观，需要重点跟踪的核心变量：1. 国内宏观基本面：GDP、社零等经济数据表现，以及国内逆周期调节政策落地推进节奏；2. 全球AI产业景气度：海外AI资本开支变化、大模型商业化收入增长情况。2026年下半年我们将在以下两方面进行布局：1. AI科技赛道：持续聚焦通信、电子等AI产业链优质标的，逢低增配；2. 非AI方向：挖掘上半年股价充分调整、估值回落至合理甚至低估区间，具备长期竞争力的绩优个股进行布局。

我们将以进取的心态，进行积极踏实的研究、审慎严谨的投资，我们也将勤勉尽责，在市场波动中保持定力，努力去争取为投资人创造更好的正回报。

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

根据法律法规的规定和本基金基金合同的约定，以及本基金实际运作情况，本基金本报告期未进行利润分配，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

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国农业银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）在本基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对本基金的投资运作情况进行了必要的监督，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了复核，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

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

本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，以自身能够获取的数据和信息为限，对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、投资组合报告等内容进行核查，以上内容真实、准确、完整。

§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：兴业臻选回报混合型证券投资基金

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	2,433,260,417.49
结算备付金		25,471,082.45
存出保证金		606,514.62
交易性金融资产	6.4.7.2	513,106,999.20
其中：股票投资		513,106,999.20
基金投资		-

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	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收清算款		11,365,860.32
应收股利		-
应收申购款		147,715.99
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		2,983,958,590.07
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	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		5,845,022.27
应付赎回款		122,875,181.93
应付管理人报酬		2,758,028.26
应付托管费		543,809.79
应付销售服务费		666,909.58
应付投资顾问费		-
应交税费		4,844.04
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	6,444,963.39
负债合计		139,138,759.26

净资产：		
实收基金	6.4.7.7	2,785,149,646.88
未分配利润	6.4.7.8	59,670,183.93
净资产合计		2,844,819,830.81
负债和净资产总计		2,983,958,590.07

注：1、报告截止日2026年06月30日，基金份额总额2,785,149,646.88份，其中下属A类基金份额净值1.0222元，基金份额1,067,515,513.43份，下属C类基金份额净值1.0210元，基金份额1,717,634,133.45份。

2、本基金基金合同于2026年03月17日生效，本期财务报表的实际编制期间为2026年03月17日（基金合同生效日）至2026年06月30日。

6.2 利润表

会计主体：兴业臻选回报混合型证券投资基金

本报告期：2026年03月17日（基金合同生效日）至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年03月17日（基金合同生效日）至2026年06月30日
一、营业总收入		82,831,154.55
1.利息收入		4,771,622.94
其中：存款利息收入	6.4.7.9	2,526,931.11
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		2,244,691.83
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		33,787,376.56
其中：股票投资收益	6.4.7.10	31,982,665.82
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
贵金属投资收益		-

衍生工具收益	6.4.7.13	-
股利收益	6.4.7.14	1,804,710.74
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	40,636,575.05
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	3,635,580.00
减：二、营业总支出		16,412,790.60
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	7,088,329.74
2.托管费	6.4.10.2.2	1,987,243.66
3.销售服务费	6.4.10.2.3	2,429,632.99
4.投资顾问费		-
5.利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.信用减值损失	6.4.7.17	-
7.税金及附加		8,080.88
8.其他费用	6.4.7.18	4,899,503.33
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		66,418,363.95
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		66,418,363.95
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		66,418,363.95

注：本基金合同生效日为2026年3月17日，本报告期不是完整报告期，无上年度科比期间数据。根据基金合同，本基金或有管理费按前一日基金资产净值的 0.60% 年费率每日计提，或有管理费的确定方法详见6.4.10.2.1 基金管理费。本期或有管理费形成的费用和负债分别列示在“其他费用”和“其他负债”项目。

6.3 净资产变动表

会计主体：兴业臻选回报混合型证券投资基金

本报告期：2026年03月17日（基金合同生效日）至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2026年03月17日（基金合同生效日）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	-	-	-
二、本期期初净资产	3,498,834,222.78	-	3,498,834,222.78
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-713,684,575.90	59,670,183.93	-654,014,391.97
（一）、综合收益总额	-	66,418,363.95	66,418,363.95
（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）	-713,684,575.90	-6,748,180.02	-720,432,755.92
其中：1.基金申购款	5,954,989.62	68,423.04	6,023,412.66
2.基金赎回款	-719,639,565.52	-6,816,603.06	-726,456,168.58
（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	2,785,149,646.88	59,670,183.93	2,844,819,830.81

注：本基金合同生效日为2026年3月17日，本报告期不是完整报告期，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

兴业臻选回报混合型证券投资基金(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》、《兴业臻选回报混合型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[2025]2642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3,498,834,222.78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(26)第00080号的验资报告。基金合同于2026年3月17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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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《兴业臻选回报混合型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，包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板、科创板及其他依法发行上市的股票、存托凭证)、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、超短期融资券、短期融资券、政府支持债券、政府支持机构债券、可转换债券(含分离交易可转换债券)、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、股指期货、国债期货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。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定参与融资业务。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(含存托凭证)占基金资产的比例为60%-95%(其中港股通标的股票投资比例不超过股票资产的50%)；每个交易日日终，在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。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：沪深300指数收益率*65%+中债综合全价指数收益率*20%+中证港股通综合指数收益率(经估值汇率调整)*15%。

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06月30日的财务状况以及2026年03月17日（基金合同生效日）起至06月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

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03月17日(基金合同生效日)至2026年06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净资产的比例，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。

本基金的管理人报酬包括固定管理费、或有管理费和超额管理费。固定管理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为应由基金管理人收取的管理费。或有管理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，当投资者赎回、转出基金份额或基金合同终止的情形发生时，若该笔基金份额持有天数未达到基金合同约定的一定期限或该笔基金份额的年化收益率达到基金合同约定的条件时，则该笔基金份额持有期限内计提的或有管理费应确认为应由基金管理人收取的管理费。在其他情形下，该笔基金份额持有期限内计提的或有管理费将全额随赎回款（或清算款）一并返还给投资者。超额管理费在基金运作期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日预估计算，但不从基金资产中实际计提。在投资者赎回、转出基金份额或基金合同终止的情形发生时，当且仅当该笔基金份额持有天数达到或超过基金合同约定的一定期限，且该笔基金份额的年化收益率达到基金合同约定的条件时，将从该笔基金份额的赎回款（或清算款）中扣除该笔基金份额持有期限内预估计算的超额管理费，由基金管理人收取。

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)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；

(2)本基金收益分配仅有现金分红一种方式；

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

(4)由于基金费用的不同，各类基金份额类别对应的可供分配利润有所不同，本基金同一基金份额类别的每一基金份额享有同等分配权；

(5)法律法规或监管机关另有规定的，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[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[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。

(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。

(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	2,433,260,417.49
等于：本金	2,433,009,742.89
加：应计利息	250,674.60
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	2,433,260,417.49

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		472,470,424.15	-	513,106,999.20	40,636,575.05
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		472,470,424.15	-	513,106,999.20	40,636,575.05

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 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	1,554,583.39
其中：交易所市场	1,554,583.39
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	53,845.12
应付转出补差费	1,403.10
或有管理费	4,835,131.78
合计	6,444,963.39

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 兴业臻选回报混合A

金额单位：人民币元

项目 (兴业臻选回报混合A)	本期 2026年03月17日（基金合同生效日）至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,362,105,847.75	1,362,105,847.75
本期申购	2,439,557.42	2,439,557.42
本期赎回（以“-”号填列）	-297,029,891.74	-297,029,891.74
本期末	1,067,515,513.43	1,067,515,513.43

6.4.7.7.2 兴业臻选回报混合C

金额单位：人民币元

项目 (兴业臻选回报混合C)	本期 2026年03月17日（基金合同生效日）至2026年06月30

	日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	2,136,728,375.03	2,136,728,375.03
本期申购	3,515,432.20	3,515,432.20
本期赎回（以“-”号填列）	-422,609,673.78	-422,609,673.78
本期末	1,717,634,133.45	1,717,634,133.45

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。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 兴业臻选回报混合A

单位：人民币元

项目 (兴业臻选回报混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	10,807,595.85	15,673,786.22	26,481,382.07
本期基金份额交易产生的变动数	-253,536.38	-2,576,467.54	-2,830,003.92
其中：基金申购款	2,966.38	20,447.74	23,414.12
基金赎回款	-256,502.76	-2,596,915.28	-2,853,418.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,554,059.47	13,097,318.68	23,651,378.15

6.4.7.8.2 兴业臻选回报混合C

单位：人民币元

项目 (兴业臻选回报混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	14,974,193.05	24,962,788.83	39,936,981.88
本期基金份额交易产	-11,037.87	-3,907,138.23	-3,918,176.10

生的变动数			
其中：基金申购款	1,698.57	43,310.35	45,008.92
基金赎回款	-12,736.44	-3,950,448.58	-3,963,185.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,963,155.18	21,055,650.60	36,018,805.78

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年03月17日（基金合同生效日）至2026年06月30日
活期存款利息收入	2,501,590.91
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	25,036.00
其他	304.20
合计	2,526,931.11

6.4.7.10 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17日（基金合同生效日）至2026年06月30日
卖出股票成交总额	2,037,351,963.32
减：卖出股票成本总额	2,002,284,104.05
减：交易费用	3,085,193.45
买卖股票差价收入	31,982,665.82

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益--买卖权证差价收入。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益--其他投资收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年03月17日（基金合同生效日）至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,804,710.74
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,804,710.74

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年03月17日（基金合同生效日）至2026年06月30日
1.交易性金融资产	40,636,575.05
——股票投资	40,636,575.05
——债券投资	-
——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	40,636,575.05

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年03月17日（基金合同生效日）至2026年06月30日
基金赎回费收入	3,607,091.01
转换费收入	28,488.99
合计	3,635,580.00

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期内未发生信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年03月17日（基金合同生效日）至2026年06月30日
审计费用	12,793.14
信息披露费	36,551.98
汇划手续费	10,022.81
帐户维护费	4,500.00
开户费	400.00
或有管理费	4,835,131.78
证券组合费	103.62
合计	4,899,503.33

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

本报告期内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
中国农业银行股份有限公司（以下简称"中国农业银行"）	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

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

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 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 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年03月17日（基金合同生效日）至2026年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	7,088,329.74
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,950,835.93
应支付基金管理人的净管理费	4,137,493.81

注：1、支付基金管理人的固定管理费按前一日基金资产净值×0.6%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：日固定管理费＝前一日基金资产净值×0.6%÷当年天数。

2.本基金的或有管理费按前一日基金资产净值0.60%的年费率计提，逐日累计。其计算公式为：日或有管理费＝前一日基金资产净值×0.60%/当年天数。投资者赎回、转出基金份额或基金合同终止的情形发生时，若该笔基金份额持有天数达到或超过365天，且该笔基金份额持有期间相对业绩比较基准的年化超额收益率在-3%及以下，或有管理费为0，则该笔基金份额持有期内计提的或有管理费将全额随赎回款(或清算款)一并返还给投资者；在其他情形下，该笔基金份额持有期内计提的或有管理费应确认为应由管理人收取的管理费。

3、本基金每日预估计算并记录每笔基金份额的超额管理费，基金超额管理费的预估计算方法如下：日预估计算的超额管理费=前一日基金资产净值×0.30%/当年天数。每笔基金份额的超额管理费每日预估计算，但不从基金资产中实际计提，逐日累计。投资者赎回、转出基金份额或基金合同终止的情形发生时，当且仅当该笔基金份额持有天数达到或超过365天，且该笔基金份额持有期间相对业绩比较基准的年化超额收益率大于6%，同时该笔基金份额持有期间的年化收益率为正时，将从该笔基金份额的赎回款(或清算款)中扣除0.30%年费率的超额管理费，并随已计提的或有管理费一同确认为应由管理人收取的管理费。

4、本基金合同于2026年03月17日生效，无上年度可比期间。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年03月17日（基金合同生效日）至2026年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,987,243.66

注：1、支付基金托管人中国农业银行的基金托管费按前一日基金资产净值×0.2%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： 日基金托管费=前一日基金资产净值×0.2%÷当年天数。

2、本基金合同于2026年03月17日生效，无上年度可比期间。

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17日（基金合同生效日）至2026年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴业臻选回报混合A	兴业臻选回报混合C	合计
兴业银行	0.00	1,938,778.85	1,938,778.85
中国农业银行	0.00	468,818.82	468,818.82
合计	0.00	2,407,597.67	2,407,597.67

注：1、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0.40%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×0.40%÷当年天数。

对于投资人通过在本基金直销机构兴业基金认(申)购的C类基金份额计提的销售服务费，在投资人赎回基金份额或基金合同终止时随赎回款或清算款一并返还给投资人。对于投资人通过其他销售机构认(申)购且持续持有期限未超过一年的C类基金份额计提的销售服务费，逐日累计至每月月末，按月支付；对于投资人通过其他销售机构认(申)购且持续持有期限超过一年的C类基金份额继续计提的销售服务费，将在投资人赎回相应基金份额或基金合同终止时随赎回款或清算款一并返还给投资人。

2、本基金合同于2026年03月17日生效，无上年度可比期间。

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

本基金本报告期间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

本基金本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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17日（基金合同生效日）至2026年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	2,433,260,417.49	2,501,590.91

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率或协议利率计息。

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，本基金本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，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，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、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	2,433,260,417.49	-	-	-	2,433,260,417.49
结算备付金	25,471,082.45	-	-	-	25,471,082.45
存出保证金	606,514.62	-	-	-	606,514.62
交易性金融资产	-	-	-	513,106,999.20	513,106,999.20
应收清算款	-	-	-	11,365,860.32	11,365,860.32
应收申购款	-	-	-	147,715.99	147,715.99
资产总计	2,459,338,014.56	-	-	524,620,575.51	2,983,958,590.07
负债					
应付清算款	-	-	-	5,845,022.27	5,845,022.27

应付赎回款	-	-	-	122,875,181.93	122,875,181.93
应付管理人报酬	-	-	-	2,758,028.26	2,758,028.26
应付托管费	-	-	-	543,809.79	543,809.79
应付销售服务费	-	-	-	666,909.58	666,909.58
应交税费	-	-	-	4,844.04	4,844.04
其他负债	-	-	-	6,444,963.39	6,444,963.39
负债总计	-	-	-	139,138,759.26	139,138,759.26
利率敏感度缺口	2,459,338,014.56	-	-	385,481,816.25	2,844,819,830.81

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	-	2,741,143.80	-	2,741,143.80
资产合计	-	2,741,143.80	-	2,741,143.80
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	-	2,741,143.80	-	2,741,143.80

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变	
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%	-137,057.19
	港币兑人民币汇率升值5%	137,057.19

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	513,106,999.20	18.04
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	513,106,999.20	18.04

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06月30日
	股票价格上升5%	25,655,349.96
	股票价格下降5%	-25,655,349.96

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	513,106,999.20
第二层次	-
第三层次	-
合计	513,106,999.20

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

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	513,106,999.20	17.20
	其中：股票	513,106,999.20	17.20

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	2,458,731,499.94	82.40
8	其他各项资产	12,120,090.93	0.41
9	合计	2,983,958,590.07	100.00

注：本报告期末，本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为2,741,143.80元，占基金净值的比例0.1%。

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

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	5,750,976.00	0.20
B	采矿业	20,412,495.00	0.72
C	制造业	367,268,828.78	12.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	11,623,094.00	0.41
I	信息传输、软件和信息技术服务业	44,309,658.32	1.56
J	金融业	61,000,803.30	2.14
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	510,365,855.40	17.94

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（%）
信息技术	2,741,143.80	0.10
合计	2,741,143.80	0.10

注：以上分类采用国际通用的具有权威性的行业分类标准。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	688981	中芯国际	417,268	66,270,503.76	2.33
2	600276	恒瑞医药	1,022,200	53,195,288.00	1.87
3	688041	海光信息	114,310	42,328,993.00	1.49
4	300750	宁德时代	98,595	38,748,820.95	1.36
5	601211	国泰海通	2,056,400	37,426,480.00	1.32
6	688256	寒武纪	18,375	29,318,231.25	1.03
7	300223	北京君正	110,700	27,553,230.00	0.97
8	002475	立讯精密	351,800	24,766,720.00	0.87
9	300661	圣邦股份	170,748	24,498,923.04	0.86
10	300308	中际旭创	12,119	15,391,130.00	0.54
11	300548	长芯博创	41,100	11,425,800.00	0.40
12	601665	齐鲁银行	1,800,000	10,386,000.00	0.37

13	601689	拓普集团	146,800	8,282,456.00	0.29
14	688521	芯原股份	22,055	8,185,492.70	0.29
15	688382	益方生物-U	412,652	7,427,736.00	0.26
16	601628	中国人寿	208,598	7,373,939.30	0.26
17	601088	中国神华	186,600	7,284,864.00	0.26
18	002020	京新药业	575,400	7,186,746.00	0.25
19	688536	思瑞浦	18,693	6,805,934.37	0.24
20	688019	安集科技	18,280	6,205,328.80	0.22
21	600258	首旅酒店	534,900	5,841,108.00	0.21
22	002966	苏州银行	835,400	5,814,384.00	0.20
23	601857	中国石油	668,600	5,803,448.00	0.20
24	600754	锦江酒店	321,400	5,781,986.00	0.20
25	300498	温氏股份	466,800	5,750,976.00	0.20
26	688037	芯源微	13,061	5,734,432.05	0.20
27	688008	澜起科技	14,734	4,566,066.60	0.16
28	601899	紫金矿业	174,600	4,389,444.00	0.15
29	688603	天承科技	18,696	3,887,833.20	0.14
30	300776	帝尔激光	16,000	3,439,360.00	0.12
31	688456	有研粉材	22,237	3,104,285.20	0.11
32	301018	申菱环境	26,100	3,017,421.00	0.11
33	600547	山东黄金	127,100	2,934,739.00	0.10
34	002837	英维克	35,800	2,848,248.00	0.10
35	H02513	智谱	1,500	2,741,143.80	0.10
36	002384	东山精密	9,100	2,387,385.00	0.08
37	300394	天孚通信	5,780	1,749,490.40	0.06
38	688012	中微公司	2,153	1,008,680.50	0.04
39	002273	水晶光电	19,285	684,231.80	0.02
40	688361	中科飞测	1,123	482,890.00	0.02
41	300502	新易盛	698	423,686.00	0.01
42	002049	紫光国微	3,200	284,000.00	0.01
43	002938	鹏鼎控股	1,900	200,222.00	0.01

44	688002	睿创微纳	1,092	168,921.48	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	688981	中芯国际	144,252,353.20	5.07
2	688012	中微公司	114,411,951.93	4.02
3	300308	中际旭创	113,643,937.12	3.99
4	002475	立讯精密	103,634,161.00	3.64
5	300502	新易盛	83,919,276.10	2.95
6	002371	北方华创	79,839,369.24	2.81
7	601899	紫金矿业	73,141,624.07	2.57
8	300750	宁德时代	68,863,847.30	2.42
9	600276	恒瑞医药	68,688,521.60	2.41
10	601628	中国人寿	58,245,141.99	2.05
11	601689	拓普集团	50,376,125.40	1.77
12	688256	寒武纪	50,070,688.08	1.76
13	601138	工业富联	49,391,019.00	1.74
14	688041	海光信息	49,285,862.71	1.73
15	601211	国泰海通	49,184,326.02	1.73
16	601688	华泰证券	47,597,858.00	1.67
17	603993	洛阳钼业	47,158,973.39	1.66
18	600031	三一重工	45,313,897.50	1.59
19	601233	桐昆股份	43,836,155.50	1.54
20	300548	长芯博创	42,940,361.25	1.51

注：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	688012	中微公司	127,126,389.53	4.47
2	300308	中际旭创	112,415,633.71	3.95
3	688981	中芯国际	102,420,192.06	3.60
4	300502	新易盛	97,151,095.40	3.42
5	002371	北方华创	90,198,684.81	3.17
6	002475	立讯精密	79,969,168.50	2.81
7	601899	紫金矿业	62,462,213.00	2.20
8	601138	工业富联	47,318,565.94	1.66
9	601628	中国人寿	46,743,545.00	1.64
10	601233	桐昆股份	45,976,811.98	1.62
11	601688	华泰证券	45,278,565.72	1.59
12	600031	三一重工	44,976,375.24	1.58
13	603993	洛阳钼业	44,415,677.00	1.56
14	601689	拓普集团	40,813,631.43	1.43
15	300274	阳光电源	34,547,258.00	1.21
16	300394	天孚通信	31,124,452.40	1.09
17	600309	万华化学	30,715,000.54	1.08
18	300548	长芯博创	30,197,694.00	1.06
19	688361	中科飞测	26,515,845.61	0.93
20	300750	宁德时代	26,282,625.00	0.92

注：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	2,474,754,528.20
卖出股票收入（成交）总额	2,037,351,963.32

注：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

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择、谨慎进行投资，旨在通过股指期货实现基金的套期保值。

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,将根据风险管理原则,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

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，国泰海通证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到上海证监局、深圳证券交易所的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期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。

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	606,514.62
2	应收清算款	11,365,860.32
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	147,715.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,120,090.93

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§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
兴业臻选回报	7,165	148,990.30	37,304,489.87	3.4945%	1,030,211,023.56	96.5055%

混合A						
兴业臻选回报混合C	13,572	126,557.19	4,620,906.88	0.269%	1,713,013,226.57	99.731%
合计	20,399	136,533.64	41,925,396.75	1.5053%	2,743,224,250.13	98.4947%

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	兴业臻选回报混合A	7,045.85	0.0007%
	兴业臻选回报混合C	10,116.89	0.0006%
	合计	17,162.74	0.0006%

注：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）。

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	兴业臻选回报混合A	0
	兴业臻选回报混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基	兴业臻选回报混合A	0

金	兴业臻选回报混合C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	兴业臻选回报混合A	兴业臻选回报混合C
基金合同生效日(2026年03月17日)基金份额总额	1,362,105,847.75	2,136,728,375.03
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	2,439,557.42	3,515,432.20
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	297,029,891.74	422,609,673.78
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	1,067,515,513.43	1,717,634,133.45

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，无托管人受调查或处罚等情况。

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，无基金托管人相关从业人员受调查或处罚等情况。

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	
东吴证券	2	421,466,557.67	9.34%	187,932.98	10.76%	-

华福证券	2	601,406,285.51	13.33%	268,166.31	15.35%	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	875,114,514.84	19.39%	127,680.19	7.31%	-
中信证券	2	2,614,119,133.50	57.94%	1,163,011.96	66.58%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，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）。开立交易单元原则上券商应至少已提供两个季度以上的研究服务，并且在最近一季度服务评价评分中排名在前十名。

②券商专用交易单元选择程序：i本基金管理人组织相关人员依据上述标准评估及确定选用的券商。ii 本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③在上述租用的券商交易单元中，本期新增华福证券交易单元2个、本期无剔除券商交易单元。

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
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	2,380,000,000.00	16.02%	-	-	-	-
中信建	-	-	-	-	-	-	-	-

投								
中信证券	-	-	12,480,000,000.00	83.98%	-	-	-	-

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	兴业臻选回报混合型证券投资基金基金产品资料概要	中国证监会规定的媒介	2026-01-29
2	兴业臻选回报混合型证券投资基金基金份额发售公告	中国证监会规定的媒介	2026-01-29
3	兴业臻选回报混合型证券投资基金托管协议	中国证监会规定的媒介	2026-01-29
4	兴业臻选回报混合型证券投资基金基金合同	中国证监会规定的媒介	2026-01-29
5	兴业臻选回报混合型证券投资基金招募说明书	中国证监会规定的媒介	2026-01-29
6	兴业臻选回报混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定的媒介	2026-03-18
7	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
8	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
9	兴业基金管理有限公司关于兴业臻选回报混合型证券投资基金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	2026-06-10
10	兴业臻选回报混合型证券投资基金开放日常申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会规定的媒介	2026-06-10
11	兴业基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金	中国证监会规定的媒介	2026-06-16

	销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告		
12	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
13	兴业臻选回报混合型证券投资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

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

（一）中国证监会准予兴业臻选回报混合型证券投资基金募集注册的文件

（二）《兴业臻选回报混合型证券投资基金基金合同》

（三）《兴业臻选回报混合型证券投资基金托管协议》

（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