

招商普盛全球配置证券投资基金（QDII） 2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	7
2.6 其他相关资料	7
§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	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介	12
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 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	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 净资产变动表	19
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	44
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	44
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	45
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	52
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	52
7.8 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	53

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	53
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	53
7.11 投资组合报告附注	54
§8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 盈利投资者数量占比	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	56
§9 开放式基金份额变动	57
§10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
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	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	58
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	58
10.8 其他重大事件	66
§11 备查文件目录	67
11.1 备查文件目录	67
11.2 存放地点	68
11.3 查阅方式	68

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	招商普盛全球配置证券投资基金（QDII）		
基金简称	招商普盛全球配置（QDII）		
基金主代码	007729		
交易代码	007729		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2020 年 1 月 19 日		
基金管理人	招商基金管理有限公司		
基金托管人	中国银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	438,857,311.28 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	招商普盛全球配置（QDII）人民币 A	招商普盛全球配置（QDII）人民币 C	招商普盛全球配置（QDII）人民币 D
下属分级基金的交易代码	007729	023559	025339
报告期末下属分级基金的份额总额	343,949,844.01 份	94,856,543.63 份	50,923.64 份

注：1、本基金从 2025 年 3 月 3 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2025 年 3 月 17 日起存续。

2、本基金从 2025 年 8 月 23 日起新增 D 类份额，D 类份额自 2025 年 8 月 26 日起存续。

3、招商普盛全球配置（QDII）人民币 A 含 A 类人民币份额（份额代码：007729）、美元现汇份额（份额代码：007975）及美元现钞份额（份额代码：008183），交易代码仅列示 A 类人民币份额代码。招商普盛全球配置（QDII）人民币 C 含 C 类人民币份额（份额代码：023559）。招商普盛全球配置（QDII）人民币 D 含 D 类人民币份额（份额代码：025339）。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制组合风险与保持资产流动性的基础上，通过全球化的资产配置和组合管理，实现组合资产的分散化投资，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1、资产配置策略： 在资产配置层面，基金管理人根据对全球宏观经济环境、政治环境、资本市场情况等因素的分析，并结合对各大类资产、各细分市场的深入分析，形成对股票、债券、另类资产、大宗商品和现金的大类资产配置思路，通过主要投资于境外公募基金的方式，实现对各大类资产的战略配置与战术调整。 2、国家与地区配置策略： 本基金在全球范围内进行投资，采用“自上而下”方法进行国家及地区

	的资产配置。本基金将综合运用定性和定量分析方法，分析各个国家及地区的人口结构、宏观经济形势、经济政策等，以及各个市场估值水平，并结合各市场的风险水平，动态地确定基金资产在各个国家及地区的资产配置。 3、基金投资策略： 本基金通过定量分析和定性分析相结合的方式筛选标的基金。定量分析方面，通过对基金的费率水平、历史收益、夏普比率、回撤、波动率、流动性规模等的量化分析形成综合评价，作为构建基金组合的重要指标。定性分析方面，将参考资产管理公司过去的长期绩效、操作风格、投研实力、投资决策流程、风险管控、第三方机构评级以及基金经理等因素。通过上述方法筛选出符合本基金投资思路的基金纳入基金池。再对标的基金池中的基金进行重点考察，深入研究标的基金的具体投资策略、投资业绩等，以及基金经理的投资风格、稳定性、擅长领域等进行分析，最终选择出符合本基金资产配置策略的标的基金，进而构建投资组合。 4、金融衍生品投资策略： 本基金在风险可控的前提下，谨慎参与各类金融衍生品投资，将适度投资于经中国证监会允许的各类金融衍生品，如期货、期权、权证、远期合约、掉期、结构性投资产品以及其他衍生工具。本基金投资于金融衍生品主要是为了避险、增值、管理汇率风险，以便更好地实现基金的投资目标。 5、股票投资策略： 本基金主要采取自下而上的选股策略，通过定量分析和定性分析相结合的方法挖掘优质上市公司，筛选其中安全边际较高的个股构建投资组合。使用定量分析的方法，通过财务和运营数据进行企业价值评估，初步筛选出具备优势的股票作为备选投资标的。本基金主要从盈利能力、成长能力以及估值水平等方面对股票进行考量。在定量分析的基础上，基金管理人将深入调研上市公司，并基于公司治理、公司发展战略、基本面变化、竞争优势、管理水平、估值比较和行业景气度趋势等关键因素，评估上市公司的中长期发展前景、成长性和核心竞争力，进一步优化备选投资标的。如本基金投资境外及香港市场股票还需关注相关股票市场制度与大陆股票市场存在的差异对股票投资价值的影响，比如行业分布、交易制度、市场流动性、投资者结构、市场波动性、涨跌停限制、估值与盈利回报等方面。 6、债券投资策略： 本基金将在基金合同约定的投资范围内，通过对宏观经济运行状况、国家货币政策和财政政策、国家产业政策及资本市场资金环境的研究，积极把握宏观经济发展趋势、利率走势、债券市场相对收益率、券种的流动性以及信用水平，结合定量分析方法，确定资产在不同券种之间的配置状况。 7、资产支持证券的投资策略： 资产支持类证券的定价受市场利率、流动性、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率及其它附加条款等多种因素的影响。本基金将在利率基本面分析、市场流动性分析和信用评级支持的基础上，辅以与国债、企业债等债券品种的相对价值比较，审慎投资资产支持证券类资产。
--	---

业绩比较基准	MSCI 全球权益指数（未对冲）收益率 $\times 36\%$ +彭博巴克莱全球综合债券指数（未对冲）收益率 $\times 54\%$ +中国人民银行人民币活期存款利率（税后） $\times 10\%$
风险收益特征	本基金主要投资于境外公募基金，预期风险和收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金投资于境外证券市场，因此面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。 本基金资产投资于港股通标的股票，会面临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投资风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。

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		招商基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	潘西里	许俊
	联系电话	0755-83196666	010-66596688
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-887-9555	95566
传真		0755-83196475	010-66594942
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		深圳市福田区深南大道 7088 号	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		518040	100818
法定代表人		王颖	葛海蛟

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	T. Rowe Price Associates, Inc.	JPMorgan Chase Bank, National Association
	中文	普徠仕投资公司	摩根大通银行
注册地址		100 East Pratt Street Baltimore, Maryland 21202	1111 Polaris Parkway, Columbus, OH 43240, U.S.A.
办公地址		100 East Pratt Street Baltimore, Maryland 21202	270 Park Avenue, New York, New York 10017
邮政编码		-	-

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.cmfcchina.com
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人住所

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	招商基金管理有限公司	深圳市福田区深南大道 7088 号

§ 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

1、招商普盛全球配置（QDII）人民币 A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	10,669,214.08
本期利润	23,516,238.95
加权平均基金份额本期利润	0.0707
本期加权平均净值利润率	5.19%
本期基金份额净值增长率	5.87%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-182,726,691.73
期末可供分配基金份额利润	-0.5313
期末基金资产净值	487,821,974.25
期末基金份额净值	1.4183
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	41.83%

2、招商普盛全球配置（QDII）人民币 C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	2,029,570.23
本期利润	5,203,505.60
加权平均基金份额本期利润	0.0914
本期加权平均净值利润率	6.72%
本期基金份额净值增长率	5.61%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-50,992,337.16
期末可供分配基金份额利润	-0.5376
期末基金资产净值	133,809,971.36
期末基金份额净值	1.4107

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	11.38%

3、招商普盛全球配置（QDII）人民币 D

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,282.70
本期利润	3,003.37
加权平均基金份额本期利润	0.0660
本期加权平均净值利润率	4.84%
本期基金份额净值增长率	5.87%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-27,049.36
期末可供分配基金份额利润	-0.5312
期末基金资产净值	72,229.76
期末基金份额净值	1.4184
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	6.49%

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）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；

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

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。

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

招商普盛全球配置（QDII）人民币 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	9.48%	0.92%	5.68%	0.47%	3.80%	0.45%
过去六个月	5.87%	0.79%	3.89%	0.45%	1.98%	0.34%
过去一年	8.62%	0.60%	8.48%	0.36%	0.14%	0.24%
过去三年	19.20%	0.50%	32.20%	0.42%	-13.00%	0.08%
过去五年	16.06%	0.57%	23.98%	0.50%	-7.92%	0.07%
自基金合同 生效起至今	41.83%	0.69%	45.80%	0.60%	-3.97%	0.09%

招商普盛全球配置（QDII）人民币 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	9.35%	0.92%	5.68%	0.47%	3.67%	0.45%
过去六个月	5.61%	0.79%	3.89%	0.45%	1.72%	0.34%
过去一年	8.11%	0.60%	8.48%	0.36%	-0.37%	0.24%
自基金合同 生效起至今	11.38%	0.61%	15.55%	0.42%	-4.17%	0.19%

招商普盛全球配置（QDII）人民币 D

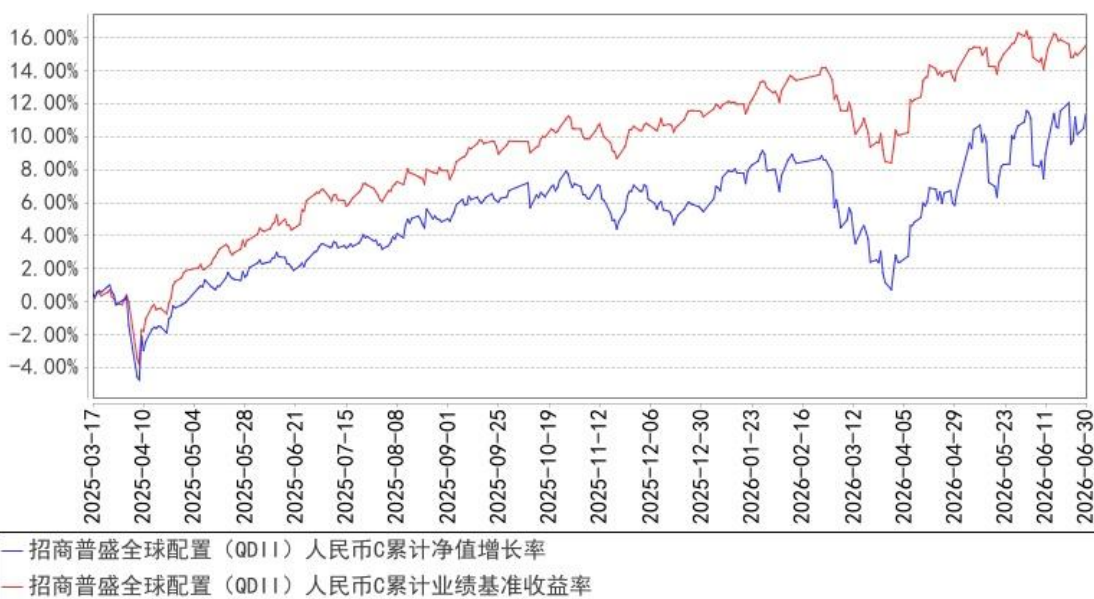
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	9.48%	0.92%	5.68%	0.47%	3.80%	0.45%
过去六个月	5.87%	0.79%	3.89%	0.45%	1.98%	0.34%
自基金合同 生效起至今	6.49%	0.65%	7.14%	0.38%	-0.65%	0.27%

3.2.2 自基金合同生效/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

招商普盛全球配置（QDII）人民币A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史
走势对比图



招商普盛全球配置（QDII）人民币C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



招商普盛全球配置（QDII）人民币D累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金从 2025 年 3 月 3 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2025 年 3 月 17 日起存续；
2、本基金从 2025 年 8 月 23 日起新增 D 类份额，D 类份额自 2025 年 8 月 26 日起存续。

§ 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

招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会【2002】100 号文批准设立。目前，公司注册资本金为人民币 13.1 亿元，招商银行股份有限公司持有公司全部股权的 55%，招商证券股份有限公司持有公司全部股权的 45%。

招商基金管理有限公司拥有公开募集证券投资基金管理、基金销售、全国社会保障基金境内委托管理、企业年金和职业年金基金投资管理、合格境内机构投资者、特定客户资产管理、保险资金投资管理、基本养老保险基金投资管理、公募基金投资顾问业务试点资格。

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		
范刚强	本基金基金经理	2023 年 5 月 23 日	-	14	男，硕士。2011 年起先后任职于中证鹏元资信评估股份有限公司及华夏银行股份有限公司深圳分行南山支行，2012 年 3 月再次加入中证鹏元资信评估股份有限公司，历任信用评级分析师、证券评级部总经理助理、评审委员会委员、技术政策委员会委员，2016 年 6 月加入招商基金管理有限公司，曾任国际业务部高级研究员，招商招华纯债债券型证券投资基金、招商招旺纯债债券型证券投资基金、招商招兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、招商招裕纯债债券型证券投资基金基金经理，现任招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金、招商 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商普盛全球配置证券投资基金（QDII）基金经理。
谢今	本基金基金经理	2025 年 3 月 14 日	-	13	男，学士。2012 年 9 月至 2017 年 10 月在 PINE RIVER CAPITAL MANAGEMENT (HK) LIMITED 工作，任研究员兼交易员；2017 年 12 月至 2021 年 2 月在香港五矿明道资产管理公司工作，任分析员兼交易员；2021 年 3 月加入招商基金管理有限公司国际业务部。现任招商普盛全球配置证券投资基金（QDII）基金经理。

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任 职务	证券从业年限	说明
Robert Sharps	Sharps 先生是 T.Rowe Price Group, Inc. 的首席执行官兼总裁，并且是公司执行委员会、管理委员会和管理层薪酬与发展委员会的主席。	29	Sharps 先生自 2022 年 1 月起担任 Price Group 的董事。他是 T. Rowe Price Group, Inc. 的首席执行官兼总裁，并且是公司执行委员会、管理委员会和管理层薪酬与发展委员会的主席。Sharps 先生自 1997 年以来一直在 T.Rowe Price Group 工作，最初是一名分析师，专门研究美国股票部门的金融服务股票，包括银行、资产管理公司和证券经纪公司。2001 年至 2016 年，他是机构大型成长股票策略的首席投资组合经理。2016 年，Sharps 先生辞去投资组合管理职务，担任全球股票联席主管的投资领导职位，并加入管理委员会。2017 年至 2021 年，他担任投资主管和集团首席投资官。2021 年 2 月，Sharps 先生成为 T.Rowe Price Group 总裁，并于 2022 年 1 月担任首席执行官。

4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

基金管理人声明：在本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则的规定以及本基金的基金合同等基金法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围以及投资运作符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人已建立较完善的研究方法和投资决策流程，确保各投资组合享有公平的投资决策机会。基金管理人建立了所有组合适用的投资对象备选库，制定明确的备选库建立、维护程序。基金管理人拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。基金管理人的相关研究成果向内部所有投资组合开放，在投资研究层面不存在各投资组合间不公平的问题。

基金管理人按照法规要求，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合间的同向交易的交易价差进行分析，相关投资组合经理也对分析中发现的价格差异次数占比超过正常范围的情况进行了合理性解释。报告期内，公司旗下投资组合同向交易价差分析中未发现异常情形。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易，基金管理人要求相关投资组合经理提供决策依据，并留存记录备查，完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合等除外。

本报告期内，本基金各项交易均严格按照相关法律法规、基金合同的有关要求执行，公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 15 次，为旗下指数及量化等组合因投资策略需要而发生反向交易。报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，全球金融市场呈现先抑后扬的走势。一季度，美、以与伊朗爆发军事冲突，伊朗封闭霍尔木兹海峡，布伦特原油价格一度飙升至 120 美元/桶以上，引发全球范

国内能源断供及二次通胀的担忧，全球金融市场的主旋律由 AI 及降息驱动下的“金发姑娘”猝然转向能源冲击下的“滞胀担忧”，风险资产普遍承压。二季度，随着军事冲突逐步降温，霍尔木兹海峡通航风险边际缓和，国际原油价格自高位显著回落，市场担忧明显缓解，在地缘风险缓和、风险偏好修复以及 AI 产业趋势重新强化的推动下，全球风险资产大幅反弹并收复失地。报告期内，MSCI 全球指数累计上涨 10.43%，MSCI 新兴市场指数累计上涨 22.68%，表现显著领先于发达市场。

报告期内，美国经济呈现“总量韧性、通胀抬头”的格局。就业方面，受益于退税、世界杯以及 AI 资本开支等因素的带动，劳动力市场在上半年呈现企稳态势。通胀及货币政策方面，受美伊冲突引发的能源短缺冲击影响，通胀再度大幅抬升，叠加劳动力市场企稳，引发了市场以及部分联储官员对通胀粘性的担忧，鹰派言论频出；此外，新任美联储主席沃什上任后，重申对通胀目标的坚定锚定，并刻意减少了与市场的沟通，进一步加深了市场对联储重回加息通道的顾虑。AI 层面，一季度 Anthropic 新模型在 B 端 coding 场景的成功跑通，打开了市场对 AI 商业化空间的预期天花板，投资者重新聚焦 AI 基础设施建设、算力需求、半导体供应链以及大型科技公司的盈利兑现能力，以 AI 硬件为主的资产价格快速上行，成为推动美国及全球权益市场反弹的核心力量。报告期内，MSCI 美国指数累计上涨 8.61%。

欧洲方面，美伊冲突加剧了欧洲的能源安全风险，叠加欧洲经济内生增长动能仍相对偏弱，制造业景气修复仍需观察，权益市场表现相较美国及亚洲 AI 产业链市场略显温和。报告期内，MSCI 欧洲指数累计上涨 5.92%。日本方面，高市早苗政府继续积极推行宽松财政政策，叠加企业治理改革及全球 AI 产业链需求的共同支撑，权益市场表现良好，半导体、电子设备等板块表现突出。报告期内，MSCI 日本指数累计上涨 14.58%。

新兴市场方面，虽然美伊冲突引致能源短缺担忧，美元反弹亦带来资金面逆风，但 AI 产业链相关市场受益于全球算力投资扩张，韩国、中国台湾、泰国等市场表现突出，带动新兴市场整体显著反弹。与此同时，美元维持强势、美国利率仍处高位，部分外债占比较高、经常账户脆弱的新兴经济体仍面临资金流动压力，新兴市场内部结构分化较大。报告期内，MSCI 新兴市场指数累计上涨 22.68%。

报告期内，本基金根据宏观风险与产业趋势的变化对组合进行了动态调整。随着地缘风险缓和及 AI 产业趋势重新强化，组合在权益配置上重点关注 AI 算力基础设施、半导体等中长期产业趋势明确且盈利可见度较高的方向，在区域配置上关注美国科技龙头的盈利兑现能力，同时提升对亚洲 AI 产业链和日本结构性改革机会的研究覆盖；债券资产方面，基于市场对联储加息进行了过于激进的定价，基金在久期方面进行了一定程度的超配。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为 5.87%，同期业绩基准增长率为 3.89%，C 类份额净值增长率为 5.61%，同期业绩基准增长率为 3.89%，D 类份额净值增长率为 5.87%，同期业绩基准增长率为 3.89%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年下半年，美伊冲突虽未彻底了结、距离稳态仍远，随时存在风波再起的可能，但考虑到美国即将迎来中期选举，特朗普政府的政策重心预计将重新转向国内，冲突再度大幅升级的概率有限，预计难以对通胀形成新一轮实质性冲击。就业与货币政策方面，随着上半年退税效应以及世界杯影响的退潮，劳动力市场能否持续稳固仍存在较大的不确定性，基于此，目前市场形成的加息预期可能逐步回落。产业层面，AI 产业的进展以及 B 端应用场景的拓展仍是下半年市场的重要决定性因素，当前市场的分歧主要聚焦于 AI 模型收入是否已在短期内触及天花板。我们倾向于乐观看待 AI 在 B 端商业场景的拓展空间，但不可否认的是，B 端场景的拓宽既需要时间，也有赖于更强的模型能力，在上述因素落地之前，AI 资产短期内可能会面临一段时间的逆风，但如果市场过度定价悲观情绪，将可能会提供较好的入场时机。本基金将继续围绕全球产业趋势和宏观风险变化，灵活调整权益与债券资产的配置结构，力争为持有人获取稳健的投资回报。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。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。本基金管理人设有估值委员会，估值委员会成员均具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。估值委员会负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与第三方定价服务机构签署服务协议，由其按合同约定提供相关投资品种的估值数据。

4.8 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实施利润分配，符合相关法规及基金合同的约定。

4.9 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

报告期内，本基金未发生连续二十个工作日出现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元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本托管人在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责的履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现本基金管理人存在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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、准确和完整。

§ 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：招商普盛全球配置证券投资基金（QDII）

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	53,757,453.81	43,651,736.40
结算备付金		1,595,879.06	8,838,650.82
存出保证金		13,464,111.61	10,966,725.00

交易性金融资产	6.4.7.2	538,430,793.68	444,620,549.07
其中：股票投资		83,149,881.46	45,239,940.25
基金投资		447,936,943.02	385,059,840.99
债券投资		503,240.96	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		6,840,728.24	14,320,767.83
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		19,849,320.40	-
应收股利		56,010.12	6,550.43
应收申购款		12,057,279.41	4,072,237.38
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		639,210,848.09	512,156,449.10
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		3,295,221.32	16,249,942.72
应付赎回款		13,255,609.54	7,656,130.09
应付管理人报酬		562,669.67	500,659.91
应付托管费		93,778.28	83,443.26
应付销售服务费		41,633.08	34,142.11
应付投资顾问费		-	-
应交税费		167,813.62	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	89,947.21	148,245.81
负债合计		17,506,672.72	24,672,563.90
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	438,857,311.28	364,044,728.03
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	182,846,864.09	123,439,157.17

净资产合计		621,704,175.37	487,483,885.20
负债和净资产总计		639,210,848.09	512,156,449.10

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，招商普盛全球配置（QDII）人民币 A 份额净值 1.4183 元，基金份额总额 343,949,844.01 份；招商普盛全球配置（QDII）人民币 C 份额净值 1.4107 元，基金份额总额 94,856,543.63 份；招商普盛全球配置（QDII）人民币 D 份额净值 1.4184 元，基金份额总额 50,923.64 份；总份额合计 438,857,311.28 份。

6.2 利润表

会计主体：招商普盛全球配置证券投资基金（QDII）

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		32,745,906.75	8,307,051.78
1.利息收入		77,673.24	114,842.48
其中：存款利息收入	6.4.7.9	77,673.24	114,842.48
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）		16,686,039.82	2,002,848.82
其中：股票投资收益	6.4.7.10	10,706,224.51	99,711.32
基金投资收益	6.4.7.11	-11,888,027.40	-1,296,012.09
债券投资收益	6.4.7.12	1,249.12	-
资产支持证券投资	6.4.7.13	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	14,582,928.59	-
股利收益	6.4.7.16	3,195,667.04	3,199,149.59
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		87,997.96	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	16,022,680.91	8,323,536.87
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-755,545.05	-2,448,063.38

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	715,057.83	313,886.99
减：二、营业总支出		4,023,158.83	2,058,454.67
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	3,160,367.94	1,693,174.03
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.10.2.2	526,727.95	282,195.67
3.销售服务费	6.4.10.2.3	192,691.79	6.62
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	6.4.7.19	-	-
7.税金及附加		44,617.60	4,357.65
8.其他费用	6.4.7.20	98,753.55	78,720.70
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		28,722,747.92	6,248,597.11
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		28,722,747.92	6,248,597.11
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		28,722,747.92	6,248,597.11

6.3 净资产变动表

会计主体：招商普盛全球配置证券投资基金（QDII）

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	364,044,728.03	-	123,439,157.17	487,483,885.20
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	364,044,728.03	-	123,439,157.17	487,483,885.20
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	74,812,583.25	-	59,407,706.92	134,220,290.17
（一）、综合收益总额	-	-	28,722,747.92	28,722,747.92

（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）	74,812,583.25	-	30,684,959.00	105,497,542.25
其中：1.基金申购款	263,208,855.16	-	99,623,466.15	362,832,321.31
2.基金赎回款	-188,396,271.91	-	-68,938,507.15	-257,334,779.06
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	438,857,311.28	-	182,846,864.09	621,704,175.37
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	147,531,355.23	-	39,520,297.43	187,051,652.66
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	147,531,355.23	-	39,520,297.43	187,051,652.66
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	33,775,190.20	-	15,915,941.02	49,691,131.22
（一）、综合收益总额	-	-	6,248,597.11	6,248,597.11
（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）	33,775,190.20	-	9,667,343.91	43,442,534.11
其中：1.基金申购款	139,445,769.18	-	38,044,873.87	177,490,643.05
2.基金赎回款	-105,670,578.98	-	-28,377,529.96	-134,048,108.94
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收	-	-	-	-

益结转留存收益				
四、本期期末净资产	181,306,545.43	-	55,436,238.45	236,742,783.88

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：

钟文岳

欧志明

何剑萍

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

招商普盛全球配置证券投资基金(QDII)(以下简称“本基金”)系由基金管理人招商基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《招商普盛全球配置证券投资基金(QDII)基金合同》及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]1242号文准予公开募集注册。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期。本基金根据认购、申购、赎回所使用货币的不同,将基金份额分为人民币份额和美元份额。本基金首次设立募集基金份额为210,430,713.37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(19)第000618号验资报告。《招商普盛全球配置证券投资基金(QDII)基金合同》(以下简称“基金合同”)于2020年1月19日正式生效。本基金的基金管理人为招商基金管理有限公司,基金境内托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”),境外托管人为摩根大通银行。

根据《招商基金管理有限公司关于招商普盛全球配置证券投资基金(QDII)增加人民币C类基金份额并修改基金合同和托管协议的公告》的有关规定,本基金自2025年3月3日起增设人民币C类基金份额,人民币C类基金份额在投资者申购基金份额时不收取申购费用、赎回时收取赎回费用,同时从本类别基金资产中计提销售服务费。根据《招商基金管理有限公司关于招商普盛全球配置证券投资基金(QDII)增加人民币D类基金份额并修改基金合同和托管协议的公告》的有关规定,本基金自2025年8月23日起增设人民币D类基金份额,人民币D类基金份额在投资者申购基金份额时收取申购费用、赎回时收取赎回费用,本基金人民币D类基金份额不收取销售服务费。

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《招商普盛全球配置证券投资基金(QDII)招募说明书》的有关规定,本基金可投资境内境外市场:针对境外市场,本基金的投资范围包括法律法规允许的、已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金(包括开放式基金和交易型开放式指数基金(ETF);已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场公开发行人和挂牌交易的普通股、优先股、存托凭证、房地产信托凭证;政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券及经中国证监会认可的国际金融组织发行的

证券；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生工具。针对境内市场，本基金的投资范围包括境内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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、股指期货、国债期货、国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、现金以及法律法规或中国证监会许可的其他金融工具。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：本基金投资于基金的比例不低于基金资产的 80%；投资于权益类资产（包括股票、股票型基金）的比例为基金资产的 30-80%；投资于股票、债券、货币市场工具等金融资产的比例不超过基金资产的 20%，其中港股通标的股票投资比例不超过本基金股票资产的 15%；每个交易日日终在扣除应缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或者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。

本基金投资于香港股票市场可通过合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度和港股通机制。基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，基金资产并非必然投资港股通标的股票。如法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制的，基金管理人在与基金托管人协商一致并履行相关程序后，可相应调整本基金的投资比例规定。本基金的业绩比较基准为：MSCI 全球权益指数（未对冲）收益率×36%+彭博巴克莱全球综合债券指数（未对冲）收益率×54%+中国人民银行人民币活期存款利率（税后）×10%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2026 年 1 月 1 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

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

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内未发生重大会计估计变更。

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[2021]33 号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2024]8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、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 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,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)基金在境外证券交易所进行交易或取得的源自境外证券市场的收益,其涉及的税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

(7)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 6 月 30 日
活期存款	53,757,453.81
等于: 本金	53,755,941.33
加: 应计利息	1,512.48

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	53,757,453.81

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		66,451,027.48	-	83,149,881.46	16,698,853.98
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	500,235.00	2,790.96	503,240.96	215.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	500,235.00	2,790.96	503,240.96	215.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		447,062,094.71	-	447,936,943.02	874,848.31
其他		6,824,297.96	-	6,840,728.24	16,430.28
合计		520,837,655.15	2,790.96	538,430,793.68	17,590,347.57

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日		
		合同/名义金额	公允价值	
			资产	负债
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-538,543,760.00	-	-	-
其中：外汇期货投资	-538,543,760.00	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-

合计	-538,543,760.00	-	-	-
----	-----------------	---	---	---

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
UC2609	UC2609	-800.00	-540,504,000.00	-1,960,240.00
合计				-1,960,240.00
减：可抵销期货暂收款				-1,960,240.00
净额				-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

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

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	17,271.63
应付证券出借违约金	-
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	72,675.58
合计	89,947.21

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

招商普盛全球配置（QDII）人民币 A		
项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	304,284,636.80	304,284,636.80

本期申购	168,270,151.11	168,270,151.11
本期赎回（以“-”号填列）	-128,604,943.90	-128,604,943.90
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	343,949,844.01	343,949,844.01

招商普盛全球配置（QDII）人民币 C		
项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	59,733,378.57	59,733,378.57
本期申购	94,903,783.86	94,903,783.86
本期赎回（以“-”号填列）	-59,780,618.80	-59,780,618.80
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	94,856,543.63	94,856,543.63

招商普盛全球配置（QDII）人民币 D		
项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	26,712.66	26,712.66
本期申购	34,920.19	34,920.19
本期赎回（以“-”号填列）	-10,709.21	-10,709.21
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	50,923.64	50,923.64

注：本期申购含红利再投、转换入份（金）额，本期赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

招商普盛全球配置（QDII）人民币 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-171,826,015.38	275,198,261.74	103,372,246.36
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-171,826,015.38	275,198,261.74	103,372,246.36
本期利润	10,669,214.08	12,847,024.87	23,516,238.95
本期基金份额交易产生的变动数	-21,569,890.43	38,553,535.36	16,983,644.93
其中：基金申购款	-92,701,752.13	156,217,113.83	63,515,361.70
基金赎回款	71,131,861.70	-117,663,578.47	-46,531,716.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-182,726,691.73	326,598,821.97	143,872,130.24

招商普盛全球配置（QDII）人民币 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	-33,899,294.56	53,957,128.37	20,057,833.81
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-33,899,294.56	53,957,128.37	20,057,833.81
本期利润	2,029,570.23	3,173,935.37	5,203,505.60
本期基金份额交易产生的变动数	-19,122,612.83	32,814,701.15	13,692,088.32
其中：基金申购款	-52,456,604.91	88,551,317.53	36,094,712.62
基金赎回款	33,333,992.08	-55,736,616.38	-22,402,624.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-50,992,337.16	89,945,764.89	38,953,427.73

招商普盛全球配置（QDII）人民币 D			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-15,082.02	24,159.02	9,077.00
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-15,082.02	24,159.02	9,077.00
本期利润	1,282.70	1,720.67	3,003.37
本期基金份额交易产生的变动数	-13,250.04	22,475.79	9,225.75
其中：基金申购款	-19,271.49	32,663.32	13,391.83
基金赎回款	6,021.45	-10,187.53	-4,166.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-27,049.36	48,355.48	21,306.12

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	77,565.14
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	0.60
其他	107.50
合计	77,673.24

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	10,706,224.51

股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	10,706,224.51

6.4.7.10.2 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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	99,984,435.38
减：卖出股票成本总额	88,950,025.77
减：交易费用	328,185.10
买卖股票差价收入	10,706,224.51

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无股票赎回差价收入。

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

6.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无证券出借差价收入。

6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	359,116,629.43
减：卖出/赎回基金成本总额	370,821,699.61
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-102,622.34
减：交易费用	285,579.56
基金投资收益	-11,888,027.40

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	1,249.12
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	1,249.12

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无买卖债券差价收入。

6.4.7.12.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.12.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券赎回差价收入。

6.4.7.13.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券申购差价收入。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
外汇期货投资收益	14,582,928.59

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	98,441.58
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	3,097,225.46
合计	3,195,667.04

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	24,771,570.91
——股票投资	15,680,735.61
——债券投资	215.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	8,579,671.50
——贵金属投资	-
——其他	510,948.80
2.衍生工具	-8,748,890.00
——权证投资	-
——期货投资	-8,748,890.00
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	16,022,680.91

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	696,864.56
其他	18,193.27
合计	715,057.83

6.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
----	------------------------------------

审计费用	13,168.21
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他	26,077.97
合计	98,753.55

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

截至财务报告批准报出日，本基金无需要说明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
招商基金管理有限公司	基金管理人
中国银行股份有限公司	基金托管人
摩根大通银行	基金境外托管人
招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)	基金管理人的股东
招商证券股份有限公司(以下简称“招商证券”)	基金管理人的股东

注：基金的主要关联方包含基金管理人、基金管理人的股东及子公司、基金托管人等。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,160,367.94	1,693,174.03
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,268,895.39	692,901.96
应支付基金管理人的净管理费	1,891,472.55	1,000,272.07

注：支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×1.20%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：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	526,727.95	282,195.67

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值×0.20%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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	招商普盛全球配置（QDII）人民币 A	招商普盛全球配置（QDII）人民币 C	招商普盛全球配置（QDII）人民币 D	合计
招商基金管理有限公司	-	225.16	-	225.16
招商银行	-	123,633.48	-	123,633.48
招商证券	-	54.14	-	54.14
合计	-	123,912.78	-	123,912.78
获得销售服务费	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			

的各关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	招商普盛全球配置（QDII）人民币 A	招商普盛全球配置（QDII）人民币 C	招商普盛全球配置（QDII）人民币 D	合计
招商基金管理有限公司	-	1.11	-	1.11
招商银行	-	3.77	-	3.77
招商证券	-	-	-	-
合计	-	4.88	-	4.88

注：本基金的 C 类基金份额的年销售服务费率为 0.50%，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：

$$C \text{ 类份额日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金资产净值} \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	招商普盛全球配置（QDII）人民币 A	招商普盛全球配置（QDII）人民币 C	招商普盛全球配置（QDII）人民币 D
基金合同生效日（2020 年 1 月 19 日）持有的基金份额	-	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-	-
报告期间申购/买入	-	-	-

总份额			
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	-	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	-

项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	招商普盛全球配置（QDII）人民币 A	招商普盛全球配置（QDII）人民币 C	招商普盛全球配置（QDII）人民币 D
基金合同生效日 （2020 年 1 月 19 日） 持有的基金份额	-	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-	-
报告期间申购/买入总份额	7,918,910.35	-	-
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	7,918,910.35	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.37%	-	-

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	招商普盛全球配置（QDII）人民币 A			
	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
招商证券股份有限公司	3,748,781.40	1.09%	-	-

注：表格中的比例为四舍五入的结果。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
摩根大通-活期	38,865,469.93	59,071.70	14,607,924.39	104,423.21
中国银行-活期	14,891,983.88	18,493.44	5,552,717.40	10,084.94

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司和摩根大通银行保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 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 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是提升本基金风险调整后收益水平，保证本基金的基金资产安全，维护基金份额持有人利益。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人风险管理的基本策略是识别和分析本基金运作时本基金面临各种类型的风险，确定适当的风

险容忍度，并及时可靠地对各种风险进行监督，将风险控制在限定的范围之内。本基金目前面临的主要风险包括：市场风险、信用风险和流动性风险。

本基金的基金管理人建立了以全面、独立、互相制约以及定性和定量相结合为原则的，董事会及下设审计委员会、风险控制委员会、督察长、风险管理委员会、监察稽核部门和风险管理部门等多层次的风险管理组织架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要存在于银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资、资产支持证券投资及其他。

本基金的银行存款存放于本基金的基金托管人，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在证券交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式，以控制相应的信用风险。

对于与债券投资、资产支持证券投资等投资品种相关的信用风险，本基金的基金管理人通过对投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象，并限制单个投资品种的持有比例来管理信用风险。附注 6.4.13.2.1 至 6.4.13.2.6 列示了本基金所持有的债券投资及资产支持证券投资的信用评级，该信用评级不包括本基金所持有的国债、央行票据、政策性金融债。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金流动性风险来源于基金约定开放日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持有的金融资产分别在证券交易所以及银行间同业市场交易，除附注 6.4.12 所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。除卖出回购金融资产外，本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

此外，针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在基金合同中约定了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

日常流动性风险管理中，本基金的基金管理人每日监控和预测本基金的流动性指标，通过对投资品种的流动性指标来持续地评估、选择、跟踪和控制基金投资的流动性风险。同时，本基金通过预留一定的现金头寸，并且在需要时可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金，以缓解流动性风险。

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

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的基金管理人日常通过对利率水平的预测、分析收益率曲线及优化利率重新定价日组合等方法对上述利率风险进行管理。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 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	53,757,453.81	-	-	-	53,757,453.81
结算备付金	1,595,879.06	-	-	-	1,595,879.06
存出保证金	111.61	-	-	13,464,000.00	13,464,111.61
交易性金融资产	503,240.96	-	-	537,927,552.72	538,430,793.68
衍生金融资产	-	-	-	-	-

买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	56,010.12	56,010.12
应收申购款	-	-	-	12,057,279.41	12,057,279.41
应收清算款	-	-	-	19,849,320.40	19,849,320.40
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	55,856,685.44	-	-	583,354,162.65	639,210,848.09
负债					
应付赎回款	-	-	-	13,255,609.54	13,255,609.54
应付管理人报酬	-	-	-	562,669.67	562,669.67
应付托管费	-	-	-	93,778.28	93,778.28
应付清算款	-	-	-	3,295,221.32	3,295,221.32
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	41,633.08	41,633.08
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	167,813.62	167,813.62
其他负债	-	-	-	89,947.21	89,947.21
负债总计	-	-	-	17,506,672.72	17,506,672.72
利率敏感度缺口	55,856,685.44	-	-	565,847,489.93	621,704,175.37
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	43,651,736.40	-	-	-	43,651,736.40
结算备付金	8,838,650.82	-	-	-	8,838,650.82
存出保证金	-	-	-	10,966,725.00	10,966,725.00
交易性金融资产	-	-	-	444,620,549.07	444,620,549.07
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	6,550.43	6,550.43
应收申购款	-	-	-	4,072,237.38	4,072,237.38
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	52,490,387.22	-	-	459,666,061.88	512,156,449.10
负债					
应付赎回款	-	-	-	7,656,130.09	7,656,130.09
应付管理人报酬	-	-	-	500,659.91	500,659.91
应付托管费	-	-	-	83,443.26	83,443.26
应付清算款	-	-	-	16,249,942.72	16,249,942.72

卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	34,142.11	34,142.11
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	148,245.81	148,245.81
负债总计	-	-	-	24,672,563.90	24,672,563.90
利率敏感度缺口	52,490,387.22	-	-	434,993,497.98	487,483,885.20

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1.若市场利率平行上升或下降 50 个基点		
	2.其他市场变量保持不变		
	3.仅存在公允价值变动对基金资产净值的影响		
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 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2025 年 12 月 31 日 ）
	1. 市场利率平行上升 50 个基点	-1,355.15	-
	2. 市场利率平行下降 50 个基点	1,360.34	-

6.4.13.4.2 外汇风险

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 6 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				
货币资金	13,545,795.92	3,401,682.08	1,352,560.50	18,300,038.50
结算备付金	678,450.00	-	-	678,450.00
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	476,686,036.04	43,804,657.24	17,436,859.44	537,927,552.72
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	9,871.51	46,138.61	-	56,010.12
应收申购款	1,122,939.24	-	-	1,122,939.24
应收清算款	19,849,320.40	-	-	19,849,320.40
其他资产	-	-	-	-
资产合计	511,892,413.11	47,252,477.93	18,789,419.94	577,934,310.98
以外币计价的负债				
应付清算款	-	2,536,220.59	759,000.73	3,295,221.32

应付赎回款	643,606.64	-	-	643,606.64
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
其他负债	1,107.10	-	-	1,107.10
负债合计	644,713.74	2,536,220.59	759,000.73	3,939,935.06
资产负债表外汇风险敞口净额	511,247,699.37	44,716,257.34	18,030,419.21	573,994,375.92

项目	上年度末 2025 年 12 月 31 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				
货币资金	31,488,589.98	3,788,048.27	158,459.78	35,435,098.03
结算备付金	16,725.82	-	-	16,725.82
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	394,981,840.72	32,855,443.79	16,783,264.56	444,620,549.07
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	3,585.71	2,964.72	-	6,550.43
应收申购款	423,195.72	-	-	423,195.72
应收清算款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	426,913,937.95	36,646,456.78	16,941,724.34	480,502,119.07
以外币计价的负债				
应付清算款	13,984,800.00	2,265,142.72	-	16,249,942.72
应付赎回款	95,222.50	-	-	95,222.50
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
其他负债	4.34	-	-	4.34
负债合计	14,080,026.84	2,265,142.72	-	16,345,169.56
资产负债表外汇风险敞口净额	412,833,911.11	34,381,314.06	16,941,724.34	464,156,949.51

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 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2025 年 12 月 31 日 ）

	1. 所有外币相对人民币升值 5%	28,699,718.80	23,207,847.48
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-28,699,718.80	-23,207,847.48

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。

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债券和股票，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金在构建资产配置和基金资产投资组合的基础上，通过建立事前和事后跟踪误差的方式，对基金资产的市场价格风险进行管理。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 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	83,149,881.46	13.37	45,239,940.25	9.28
交易性金融资产-基金投资	447,936,943.02	72.05	385,059,840.99	78.99
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	6,840,728.24	1.10	14,320,767.83	2.94
合计	537,927,552.72	86.52	444,620,549.07	91.21

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.若对市场价格敏感的权益性投资的市场价格上升或下降 5%		
	2.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 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2025 年 12 月 31 日 ）
	1. 权益性投资的市场价格上升 5%	26,896,377.64	22,231,027.45
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-26,896,377.64	-22,231,027.45

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 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	537,927,552.72	444,620,549.07
第二层次	503,240.96	-
第三层次	-	-
合计	538,430,793.68	444,620,549.07

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度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工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

§ 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	83,149,881.46	13.01
	其中：普通股	79,429,623.95	12.43
	存托凭证	3,720,257.51	0.58
2	基金投资	447,936,943.02	70.08
3	固定收益投资	503,240.96	0.08
	其中：债券	503,240.96	0.08
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的 买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	6,840,728.24	1.07
7	银行存款和结算备付 金合计	55,353,332.87	8.66
8	其他各项资产	45,426,721.54	7.11
9	合计	639,210,848.09	100.00

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
美国	45,755,164.84	7.36
中国香港	35,035,740.00	5.64
日本	2,358,976.62	0.38
合计	83,149,881.46	13.37

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
通信服务	1,341,830.27	0.22
非日常生活消费品	2,767,449.60	0.45
日常消费品	-	-
能源	2,005,143.78	0.32
金融	1,702,923.17	0.27
医疗保健	-	-
工业	3,743,849.97	0.60
信息技术	67,453,256.24	10.85

原材料	4,135,428.43	0.67
房地产	-	-
公用事业	-	-
合计	83,149,881.46	13.37

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	Sandisk Corp	闪迪公司/特拉华州	SNDK	纳斯达克证券交易所	美国	680	10,489,762.41	1.69
2	Kingboard Laminates Holdings Ltd	建滔积层板控股有限公司	01888	香港联合交易所	中国香港	82,000	7,033,359.92	1.13
3	Micron Technology Inc	美光科技股份有限公司	MU	纳斯达克证券交易所	美国	740	5,795,147.57	0.93
4	Intel Corp	英特尔公司	INTC	纳斯达克证券交易所	美国	4,900	4,641,866.70	0.75
5	Marvell Technology Inc	美满电子科技公司	MRVL	纳斯达克证券交易所	美国	2,200	4,446,276.35	0.72
6	Hua Hong Grace Semiconductor Ltd	华虹宏力半导体有限公司	01347	香港联合交易所	中国香港	23,600	4,393,499.10	0.71
7	Advanced Micro Devices Inc	-	AMD	纳斯达克证券交易所	美国	1,000	3,941,183.90	0.63

8	Lam Research Corp	泛林集团	LRCX	纳斯达克证券交易所	美国	850	2,498,938.28	0.40
9	Taiyo Yuden Co Ltd	太阳诱电株式会社	6976	东京证券交易所	日本	2,800	2,358,976.62	0.38
10	Montage Technology Co Ltd	澜起科技股份有限公司	06809	香港联合交易所	中国香港	5,800	2,331,113.77	0.37
11	ARM Holdings PLC	-	ARM	纳斯达克证券交易所	美国	900	2,165,022.15	0.35
12	ASMPT Ltd	-	00522	香港联合交易所	中国香港	10,000	2,065,811.04	0.33
13	Yangtze Optical Fibre& Cable Joint Stock Ltd Co	长飞光纤光缆股份有限公司	06869	香港联合交易所	中国香港	8,500	1,878,002.17	0.30
14	CrowdStrike Holdings Inc	-	CRWD	纳斯达克证券交易所	美国	360	1,863,908.40	0.30
15	Dajin Heavy Industry Co Ltd	大金重工股份有限公司	01081	香港联合交易所	中国香港	33,000	1,814,202.52	0.29
16	GigaDevice Semiconductor Inc	兆易创新科技股份有限公司	03986	香港联合交易所	中国香港	1,700	1,747,115.57	0.28
16	Shanghai Biren Technology Co Ltd	上海壁仞科技股份有限公司	06082	香港联合交易所	中国香港	33,000	1,747,115.57	0.28
17	QUALCOMM	高通公司	QCOM	纳斯达克证券交易所	美国	1,375	1,723,848.16	0.28

	Inc			交易所				
18	Shanghai Iluvatar CoreX Semiconductor Co Ltd	上海天 数智芯 半导体 股份有 限公司	09903	香港联 合交易 所	中国香 港	2,600	1,718,394.91	0.28
19	Lument um Holding s Inc	-	LITE	纳斯达 克证券 交易所	美国	280	1,630,022.26	0.26
20	Taiwan Semico nductor Manufa cturing Co Ltd	台湾积 体电路 制造股 份有限 公司	TSM	美国纽 约证券 交易所	美国	480	1,555,235.36	0.25
21	Amazon .com Inc	亚马逊 公司	AMZN	纳斯达 克证券 交易所	美国	960	1,552,337.02	0.25
22	MMG Ltd	五矿资 源有限 公司	01208	香港联 合交易 所	中国香 港	240,000	1,440,877.25	0.23
23	COSCO SHIPPI NG Energy Transpo rtation Co Ltd	中远海 运能源 运输股 份有限 公司	01138	香港联 合交易 所	中国香 港	120,000	1,435,686.77	0.23
24	Lingbao Gold Group Co Ltd	灵宝黄 金集团 股份有 限公司	03330	香港联 合交易 所	中国香 港	120,000	1,275,819.98	0.21
25	Alphabe t Inc	谷歌 (Alphab et)	GOOG L	纳斯达 克证券 交易所	美国	500	1,212,288.38	0.19
26	Trip.co m Group Ltd	携程集 团有限 公司	09961	香港联 合交易 所	中国香 港	3,600	970,412.14	0.16
27	Hangzh ou SF	杭州顺 丰同城	09699	香港联 合交易	中国香 港	150,000	947,262.60	0.15

	Intra-City Industrial Co Ltd	实业股份有限公司		所				
28	Goldwind Science & Technology Co Ltd	金风科技股份有限公司	02208	香港联合交易所	中国香港	100,000	910,064.16	0.15
29	Hainan Drinda New Energy Technology Co Ltd	海南钧达新能源科技股份有限公司	02865	香港联合交易所	中国香港	44,000	815,320.60	0.13
30	Huatai Securities Co Ltd	华泰证券股份有限公司	06886	香港联合交易所	中国香港	55,000	794,575.98	0.13
31	Robinhood Markets Inc	罗宾汉市场股份公司	HOOD	纳斯达克证券交易所	美国	1,080	734,777.63	0.12
32	Jiaxin International Resources Investment Ltd	佳鑫国际资源投资	03858	香港联合交易所	中国香港	13,600	672,374.78	0.11
33	Centrus Energy Corp	-	LEU	美国纽约证券交易所	美国	500	569,457.01	0.09
34	Jiangsu Lopal Tech Group Co Ltd	江苏龙蟠科技股份有限公司	02465	香港联合交易所	中国香港	42,000	409,840.30	0.07
35	Wanguo Gold Group	万国黄金集团有限公司	03939	香港联合交易所	中国香港	50,000	336,516.12	0.05

	Ltd	司						
36	Apple Inc	苹果公司	AAPL	纳斯达克证券交易所	美国	160	314,106.07	0.05
37	Coinbase Global Inc	-	COIN	纳斯达克证券交易所	美国	175	173,569.56	0.03
38	NVIDIA Corp	英伟达公司	NVDA	纳斯达克证券交易所	美国	100	135,751.06	0.02
39	Reddit Inc	-	RDDT	美国纽约证券交易所	美国	110	129,541.89	0.02
40	Pop Mart International Group Ltd	泡泡玛特国际集团有限公司	09992	香港联合交易所	中国香港	800	107,062.30	0.02
41	Alibaba Group Holding Ltd	阿里巴巴集团控股有限公司	09988	香港联合交易所	中国香港	1,000	80,322.68	0.01
42	J&T Global Express Ltd	极兔速递环球有限公司	01519	香港联合交易所	中国香港	10,000	72,320.69	0.01
43	Broadcom Inc	博通股份有限公司	AVGO	纳斯达克证券交易所	美国	25	64,071.12	0.01
44	Microsoft Corp	微软公司	MSFT	纳斯达克证券交易所	美国	24	60,738.10	0.01
45	SHARP LINK INC	-	SBET	纳斯达克证券交易所	美国	1,760	57,315.46	0.01
46	Semiconductor Manufacturing International Corp	中芯国际集成电路制造有限公司	00981	香港联合交易所	中国香港	500	38,669.08	0.01

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	Kingboard Laminates Holdings Ltd	01888	8,151,645.04	1.67
2	Sandisk Corp	SNDK	6,218,390.81	1.28
3	COSCO SHIPPING Energy Transportation Co Ltd	01138	4,829,938.49	0.99
4	Intel Corp	INTC	3,818,481.96	0.78
5	Kingboard Holdings Ltd	00148	3,519,183.90	0.72
6	Marvell Technology Inc	MRVL	3,337,598.34	0.68
7	CNOOC Ltd	00883	3,241,323.63	0.66
8	Micron Technology Inc	MU	2,913,313.23	0.60
9	Hua Hong Grace Semiconductor Ltd	01347	2,761,459.25	0.57
10	MMG Ltd	01208	2,712,620.93	0.56
11	China Shenhua Energy Co Ltd	01088	2,665,213.10	0.55
12	Yangtze Optical Fibre&Cable Joint Stock Ltd Co	06869	2,539,158.00	0.52
13	Lingbao Gold Group Co Ltd	03330	2,492,905.08	0.51
14	Taiyo Yuden Co Ltd	6976	2,420,105.05	0.50
15	ARM Holdings PLC	ARM	2,383,704.74	0.49
16	Jiaxin International Resources Investment Ltd	03858	2,337,569.98	0.48
17	QUALCOMM	QCOM	2,126,024.58	0.44

	Inc			
18	Dajin Heavy Industry Co Ltd	01081	2,064,921.33	0.42
19	China Eastern Airlines Corp Ltd	00670	2,060,993.94	0.42
20	GigaDevice Semiconductor Inc	03986	2,032,010.55	0.42

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票；

2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的，本项的“累计买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	Sandisk Corp	SNDK	7,136,400.89	1.46
2	Kingboard Laminates Holdings Ltd	01888	6,080,228.07	1.25
3	Kingboard Holdings Ltd	00148	4,306,493.43	0.88
4	Micron Technology Inc	MU	3,680,343.50	0.75
5	Wanguo Gold Group Ltd	03939	3,212,565.12	0.66
6	MMG Ltd	01208	2,976,365.12	0.61
7	China Hongqiao Group Ltd	01378	2,931,682.06	0.60
8	CNOOC Ltd	00883	2,773,997.99	0.57
9	COSCO SHIPPING Energy Transportation Co Ltd	01138	2,733,763.22	0.56
10	China Shenhua Energy Co Ltd	01088	2,497,386.73	0.51
11	Zhaojin Mining Industry Co Ltd	01818	2,350,923.92	0.48
12	China Taiping	00966	2,276,149.27	0.47

	Insurance Holdings Co Ltd			
13	Broadcom Inc	AVGO	2,081,215.94	0.43
14	ARM Holdings PLC	ARM	1,885,934.40	0.39
15	China Eastern Airlines Corp Ltd	00670	1,842,029.82	0.38
16	Ganfeng Lithium Group Co Ltd	01772	1,781,115.41	0.37
17	NVIDIA Corp	NVDA	1,766,607.73	0.36
18	Bilibili Inc	09626	1,756,513.14	0.36
19	Yangtze Optical Fibre&Cable Joint Stock Ltd Co	06869	1,691,918.41	0.35
20	Intel Corp	INTC	1,653,618.32	0.34

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的，本项“累计卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

买入成本（成交）总额	111,179,231.37
卖出收入（成交）总额	99,984,435.38

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、“买入股票成本（成交）总额”、“卖出股票收入（成交）总额”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。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

债券信用等级	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
未评级	503,240.96	0.08

注：以上债券信用等级主要采用标准普尔、穆迪等机构提供的债券信用评级信息。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例
----	------	------	-------	------------	-----------

					(%)
1	019827	26 国债 01	500,000	503,240.96	0.08

7.8 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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	期货品种_外汇	UC2609	-540,504,000.00	-86.94

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

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	T Rowe Price Funds SICAV - Global Aggregate Bond Fund	固定类	开放式	T Rowe Price Luxembourg Management Sarl	86,528,806.12	13.92
2	T. Rowe Price Global High Income Bond Fund	固定类	开放式	T Rowe Price Associates Inc	49,985,974.42	8.04
3	T. Rowe Price Emerging Markets Discovery Stock Fund	权益类	开放式	T Rowe Price Associates Inc	45,915,835.90	7.39
4	T Rowe Price Emerging Markets Local Currency	固定类	开放式	T Rowe Price Associates Inc	44,664,739.91	7.18

	Bond Fund					
5	T Rowe Price International Bond Fund	固定类	开放式	T Rowe Price Associates Inc	38,883,111.47	6.25
6	SPDR S&P BIOTECH ETF	ETF	开放式	SSgA Funds Management Inc	26,841,178.13	4.32
7	T Rowe Price US Treasury Long-Term Index Fund	固定类	开放式	T Rowe Price Associates Inc	22,823,626.41	3.67
8	ISHARES MSCI SOUTH KOREA ETF	ETF	开放式	BlackRock Fund Advisors	15,615,612.27	2.51
9	Global X Japan Semiconductor ETF	ETF	开放式	Global X Japan Co Ltd	15,077,882.82	2.43
10	ROUNDHILL MEMORY ETF	ETF	开放式	Roundhill Financial Inc	13,527,953.78	2.18

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

报告期基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

7.11.3 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	13,464,111.61

2	应收清算款	19,849,320.40
3	应收股利	56,010.12
4	应收利息	-
5	应收申购款	12,057,279.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	45,426,721.54

7.11.4 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处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资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
招商普盛全球配置（QDII）人民币 A	17,274	19,911.42	133,746,594.56	38.89%	210,203,249.45	61.11%
招商普盛全球配置（QDII）人民币 C	12,330	7,693.15	44,808,984.86	47.24%	50,047,558.77	52.76%
招商普盛全球配置（QDII）人民币 D	14	3,637.40	-	-	50,923.64	100.00%
合计	29,618	14,817.25	178,555,579.42	40.69%	260,301,731.86	59.31%

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 07 月 01 日-2026 年 06 月 30 日）
盈利投资者数量占比	76.29%

注：盈利投资者数量占比=盈利投资者数量/投资者总数

其中，投资者指指标计算期间持有过基金份额的投资者，盈利投资者指投资者区间净收益不小于零的投资者。

投资者区间净收益=投资者区间收益-基金交易手续费（认申购费、赎回费、转换费等）。其中，区间收益=持有期末市值-持有期初市值+（赎回+转出+非交易过户出）-（认购+申购+定投+转入+非交易过户入）+现金分红

该指标计算时剔除持有期限不满 7 日的交易。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	招商普盛全球配置（QDII）人民币 A	362,453.44	0.1054%
	招商普盛全球配置（QDII）人民币 C	809.58	0.0009%
	招商普盛全球配置（QDII）人民币 D	3,697.34	7.2606%
	合计	366,960.36	0.0836%

注：分级基金机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	招商普盛全球配置（QDII）人民币 A	0
	招商普盛全球配置（QDII）人民币 C	0
	招商普盛全球配置（QDII）人民币 D	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	招商普盛全球配置（QDII）人民币 A	0~10
	招商普盛全球配置（QDII）	0

	人民币 C	
	招商普盛全球配置（QDII）	0
	人民币 D	
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	招商普盛全球配置 （QDII）人民币 A	招商普盛全球配置 （QDII）人民币 C	招商普盛全球配置 （QDII）人民币 D
基金合同生效日 (2020 年 1 月 19 日) 基金份额总额	210,430,713.37	-	-
本报告期期初基金份 额总额	304,284,636.80	59,733,378.57	26,712.66
本报告期基金总申购 份额	168,270,151.11	94,903,783.86	34,920.19
减：本报告期基金总 赎回份额	128,604,943.90	59,780,618.80	10,709.21
本报告期基金拆分变 动份额（份额减少以 “-”填列）	-	-	-
本报告期期末基金份 额总额	343,949,844.01	94,856,543.63	50,923.64

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、公募基金托管业务的重大诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

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，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，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，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及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，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及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	
CHINA INTERNA TIONAL CAPITAL CORPOR ATION HONG KONG SECURIT IES LIMITED	1	100,418,594.55	47.55%	98,247.18	22.33%	-
CLSA LIMITED	2	86,034,805.98	40.74%	75,081.06	17.07%	-

CHINA MERCHA NTS SECURIT IES(HK) CO.,LTD.	2	22,262,849.08	10.54%	264,163.04	60.04%	-
SDICS INTERNA TIONAL SECURIT IES(HON G KONG) LIMITED	1	2,479,673.59	1.17%	2,479.67	0.56%	-
DAIWA CAPITAL MARKET S HONG KONG LIMITED	2	-	-	-	-	-
北京证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	3	-	-	-	-	-
诚通证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	4	-	-	-	-	-
第一创业	3	-	-	-	-	-
东北证券	3	-	-	-	-	-
东方财富	3	-	-	-	-	-
东方证券	3	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	本报告 期减少 4 个
东兴证券	2	-	-	-	-	本报告 期减少 1 个
方正证券	3	-	-	-	-	本报告 期减少 1 个
光大证券	3	-	-	-	-	-
广发证券	6	-	-	-	-	-
国海证券	4	-	-	-	-	本报告 期新增 1 个
国金证券	1	-	-	-	-	-

国联民生	4	-	-	-	-	本报告 期减少 5 个
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰海通 证券	7	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	本报告 期减少 2 个
国新证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	3	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	2	-	-	-	-	本报告 期减少 2 个
华创证券	4	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	4	-	-	-	-	-
华泰证券	4	-	-	-	-	-
华西证券	3	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
华源证券	2	-	-	-	-	-
汇丰前海 证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	本报告 期新增
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	本报告 期减少 1 个
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	6	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	本报告 期减少 1 个
太平洋证	2	-	-	-	-	-

券						
天风证券	2	-	-	-	-	-
天府证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
甬兴证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	本报告 期减少 2 个
长江证券	4	-	-	-	-	-
招商证券	4	-	-	-	-	本报告 期减少 1 个
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	2	-	-	-	-	-
中金财富 证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	5	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投 证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	7	-	-	-	-	本报告 期减少 1 个
中银国际 证券	2	-	-	-	-	本报告 期减少 1 个
中邮证券	2	-	-	-	-	-

注：（一）选择标准

1、证券公司应财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强，并通过基金管理人的尽职调查。

2、被动股票型基金选择佣金费率相对较低，能够提供优质证券交易服务的证券公司。

3、被动股票型基金以外类型基金选择能够提供优质研究服务的证券公司。

（二）选择程序

1、基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的证券公司。

2、基金管理人与被选择的证券公司签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

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

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
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORPORATION HONG KONG SECURITIES LIMITED	-	-	-	-	-	-	11,043,730.08	2.07%
CLSA LIMITED	-	-	-	-	-	-	38,226,971.79	7.16%
CHINA MERCHANTS SECURITIES(HK) CO.,LTD.	-	-	-	-	-	-	484,745,818.73	90.77%
SDICS INTERNATIONAL SECURITIES(HONG KONG) LIMITED	-	-	-	-	-	-	-	-

D								
DAIWA CAPIT AL MARK ETS HONG KONG LIMITE D	-	-	-	-	-	-	-	-
北京证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
诚通证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
大通证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创 业	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财 富	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
东海证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-	-	-

国联民生	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
汇丰前海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-	-	-

平安证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
山西证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
上海证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-	-	-
世纪证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
天府证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
万和证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
五矿证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
湘财证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
英大证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
甬兴证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
粤开证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-	-	-

招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	500,235.00	100.00%	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于旗下部分基金 2026 年 1 月 19 日因境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-16
2	招商普盛全球配置证券投资基金（QDII）（人民币 A 类份额）基金产品资料概要更新	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-16
3	招商普盛全球配置证券投资基金（QDII）（人民币 C 类份额）基金产品资料概要更新	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-16
4	招商普盛全球配置证券投资基金（QDII）（人民币 D 类份额）基金产品资料概要更新	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-16
5	招商普盛全球配置证券投资基金（QDII）更新的招募说明书（二零二六年第一号）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-16
6	招商普盛全球配置证券投资基金（QDII）（美元现钞）基金产品资料概要更新	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-16
7	招商普盛全球配置证券投资基金（QDII）（美	基金管理人网站及中	2026-01-16

	元现汇）基金产品资料概要更新	国证监会基金电子披露网站	
8	招商基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报及基金管理人网站	2026-01-21
9	招商普盛全球配置证券投资基金（QDII）2025 年第 4 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-21
10	招商基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	中国证券报及基金管理人网站	2026-03-31
11	招商普盛全球配置证券投资基金（QDII）2025 年年度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
12	关于旗下部分基金 2026 年 4 月 3 日、2026 年 4 月 7 日因港股通非交易日及境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-02
13	招商基金管理有限公司旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报及基金管理人网站	2026-04-22
14	招商普盛全球配置证券投资基金（QDII）2026 年第 1 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-22
15	招商基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善客户身份信息的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-14
16	关于旗下部分基金 2026 年 5 月 25 日因港股通非交易日及境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-21
17	关于旗下部分基金 2026 年 7 月 1 日因港股通非交易日及境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-29

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准设立招商基金管理有限公司的文件；
- 2、中国证券监督管理委员会批准招商普盛全球配置证券投资基金（QDII）设立的文件；
- 3、《招商普盛全球配置证券投资基金（QDII）基金合同》；
- 4、《招商普盛全球配置证券投资基金（QDII）托管协议》；
- 5、《招商普盛全球配置证券投资基金（QDII）招募说明书》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

11.2 存放地点

招商基金管理有限公司

地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

11.3 查阅方式

上述文件可在招商基金管理有限公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到招商基金管理有限公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人招商基金管理有限公司。

客户服务电话：400-887-9555

网址：<http://www.cmfcchina.com>

招商基金管理有限公司

2026 年 8 月 31 日