

富国中证 A500 指数增强型证券投资基金

二 0 二六年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会、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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 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。

富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、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 2026 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	5
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	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	11
4.1	基金管理人及基金经理情况	11
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	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	半年度财务报告（未经审计）	17
6.1	资产负债表	17
6.2	利润表	18
6.3	净资产变动表	19
6.4	报表附注	20
§ 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	44
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.....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	64
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.....	64
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.....	64
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.....	64
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.....	65
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	65
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	65
7.12 投资组合报告附注	65
§ 8 基金份额持有人信息	67
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	67
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	67
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.....	67
§ 9 开放式基金份额变动	68
§ 10 重大事件揭示	69
10.1 基金份额持有人大会决议	69
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.....	69
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	69
10.4 基金投资策略的改变	69
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	69
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	69
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.....	70
10.8 其他重大事件	70
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	72
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	72
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	72
§ 12 备查文件目录	73

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国中证 A500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	富国中证 A500 指数增强	
基金主代码	022676	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 01 月 23 日	
基金管理人	富国基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	744,598,828.36 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	富国中证 A500 指数增强 A	富国中证 A500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	022676	022677
报告期末下属分级基金的份额总额	379,648,098.70 份	364,950,729.66 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型基金，在力求对中证 A500 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金以“指数化投资为主、主动性投资为辅”，在复制标的指数的基础上一定程度地调整个股，力求投资收益能够跟踪并适度超越标的指数。 本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.50%，年化跟踪误差不超过 7.75%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过正常范围的，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度和跟踪误差进一步扩大。 本基金的股票投资策略、港股通标的股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、可转换债券（含可分离交易可转债）及可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、国债期货投资策略、信用衍生品投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略详见法律文件。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数基金，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金投资港股通标的股票的，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富国基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	张姗
	联系电话	021-20361818	400-61-95555
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		95105686、4008880688	400-61-95555

传真	021-20361616	0755-83195201
注册地址	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200120	518040
法定代表人	陈戈	缪建民

2.4 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	www.fullgoal.com.cn
基金中期报告置备地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层 招商银行股份有限公司 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	富国基金管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 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

(1) 富国中证 A500 指数增强 A

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	53,978,597.93
本期利润	64,085,054.78
加权平均基金份额本期利润	0.1723
本期加权平均净值利润率	12.86%
本期基金份额净值增长率	13.28%
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	150,316,858.72
期末可供分配基金份额利润	0.3959
期末基金资产净值	542,925,800.82
期末基金份额净值	1.4301
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	43.01%

(2) 富国中证 A500 指数增强 C

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	37,981,748.89
本期利润	47,135,579.31
加权平均基金份额本期利润	0.1916
本期加权平均净值利润率	14.30%
本期基金份额净值增长率	13.17%
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	143,027,443.91
期末可供分配基金份额利润	0.3919
期末基金资产净值	520,418,102.83
期末基金份额净值	1.4260
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	42.60%

注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购费

回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

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

(1) 富国中证 A500 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	13.37%	1.31%	13.54%	1.34%	-0.17%	-0.03%
过去六个月	13.28%	1.21%	11.34%	1.22%	1.94%	-0.01%
过去一年	40.76%	1.05%	34.41%	1.09%	6.35%	-0.04%
自基金合同生效起至今	43.01%	1.04%	39.14%	1.07%	3.87%	-0.03%

(2) 富国中证 A500 指数增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	13.30%	1.31%	13.54%	1.34%	-0.24%	-0.03%
过去六个月	13.17%	1.21%	11.34%	1.22%	1.83%	-0.01%
过去一年	40.48%	1.05%	34.41%	1.09%	6.07%	-0.04%
自基金合同生效起至今	42.60%	1.04%	39.14%	1.07%	3.46%	-0.03%

注：本基金业绩比较基准根据基金合同中投资策略及资产配置比例等相关规定构建，能够较好地反映本基金的风险收益特征。本基金每个交易日对业绩比较基准依据合同约定的权重比例进行再平衡处理，并用每日连乘方式计算得到指数基准的时间序列。

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

(1) 富国中证 A500 指数增强 A



注：1、截止日期为 2026 年 6 月 30 日。

2、本基金建仓期为自基金合同生效之日起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

(2) 富国中证 A500 指数增强 C



注：1、截止日期为 2026 年 6 月 30 日。

2、本基金建仓期为自基金合同生效之日起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§ 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

富国基金管理有限公司于 1999 年 4 月 13 日获国家工商行政管理局登记注册成立，是经中国证监会批准设立的首批十家基金管理公司之一。公司于 2001 年 3 月从北京迁址上海。2003 年 9 月，加拿大蒙特利尔银行（BMO）参股富国基金管理有限公司的工商变更登记办理完毕，富国基金管理有限公司成为国内首批成立的十家基金公司中，第一家中外合资的基金管理公司。

目前，公司注册资本金 5.2 亿元人民币，股东为：国泰海通证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、加拿大蒙特利尔银行及山东省金融资产管理股份有限公司。公司在北京、成都、广州设立有分公司，并全资设有两家子公司——富国资产管理（上海）有限公司和富国资产管理（香港）有限公司。公司拥有公募基金、特定客户资产管理、QDII、社保、企业年金、基本养老保险基金等基金公司全部业务牌照。

截至 2026 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国新兴产业股票型证券投资基金、富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、富国天利增长债券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国中债-1-3 年国开行债券指数证券投资基金、富国全球科技互联网股票型证券投资基金（QDII）、富国鑫旺稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、富国富钱包货币市场基金、富国首创水务封闭式基础设施证券投资基金等 464 只公开募集证券投资基金。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐幼华	本基金现任基金经理	2025-01-23	—	21	硕士，曾任上海京华创业投资有限公司投资部经理助理；自 2006 年 7 月加入富国基金管理有限公司，历任助理数量研究员、研究员、基金经理助理、基金经理、量化与海外投资部量化投资副总监，量化与海外投资部量化投资总监；现任富国基金量化投资部副总经理，兼

					任富国基金资深定量基金经理。自 2011 年 05 月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金基金经理；自 2018 年 05 月起任富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理；自 2018 年 07 月起任富国大盘价值量化精选混合型证券投资基金基金经理；自 2018 年 12 月起任富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金基金经理；自 2024 年 04 月起任富国 MSCI 中国 A50 互联互通增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2025 年 01 月起任富国中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。
蔡卡尔	本基金现任基金经理	2025-03-10	—	13	硕士，自 2013 年 8 月加入富国基金管理有限公司，历任助理定量研究员、定量研究员、定量基金经理、量化投资部量化投资总监助理、量化投资部量化投资副总监、量化投资部量化投资总监、高级定量基金经理；现任富国基金量化投资部量化投资总监兼量化投资研究部总经理，兼任富国基金高级定量基金经理。自 2017 年 01 月起任富国中证医药主题指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理；自 2018 年 05 月起任富国港股通量化精选股票型证券投资基金基金经理；自 2021 年 09 月起任富国中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2021 年 11 月起任富国中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2022 年 01 月起任富国中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；自 2023 年 11 月起任富国中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；自 2025 年 03 月起任富国中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理；自 2025 年 12 月起任富国恒生生物科技交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2026 年 03 月起任富国中证港股通信息技术综合交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2026 年 06 月起任富国恒生科技

					指数型证券投资基金(QDII)基金经理；自 2026 年 06 月起任富国恒生生物科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；具有基金从业资格。
高明哲	本基金现任基金经理	2025-08-11	—	6	硕士，自 2020 年 6 月加入富国基金管理有限公司，历任助理定量研究员、初级定量研究员、定量研究员；现任富国基金量化投资部定量基金经理。自 2025 年 08 月起任富国中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。

注：1、上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从中国证监会《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》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国中证 A500 指数增强型证券投资基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险、力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定收益为目标，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期，公司严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规和内部管理办法的要求，通过自动化系统、人工审核等方式在各投资业务环节加强管控，确保公平对待旗下管理的所有投资组合。管理人对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析评估。在同向交易价差分析方面，采集连续四个季度不同时间窗口（1 日内、3 日内、5 日内）的同向交易样本，对同向交易价差进行假设检验并对检验结果进行分析。分析结果表明在同向交易价差方面，本投资组合与公司管理的其他投资组合未出现可能导致不公平交易、利益输送的交易事项。本报告期内公司旗下基金严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。

在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本基金与公司管理的其他投资组合之间，出现 26 次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 5% 的情况，为投资组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平对待投资组合或利益输送等情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年伊始，国内经济数据回暖、人民币升值等因素助推 A 股快速上行，随后融资保证金上调降温市场，叠加海外关税、美伊地缘反复扰动情绪。进入 2 月，美联储新任主席提名强化紧缩预期，全球迎来鹰派交易。3 月起，美伊冲突主导市场，月初冲突推高油价打压风险偏好；中旬局势僵持加剧滞胀忧虑；下旬美方释放缓和信号，悲观情绪有所修复。4 月地缘扰动降温、流动性预期改善，A 股科技成长维持强势并向低拥挤赛道扩散。海外半导体行情向好，AI 算力需求持续验证；国内资金聚焦产业主线，行情向国产算力、半导体、AIDC 基建延伸。5 月中旬多重催化消退，叠加美国通胀走高、加息预期升温，美债利率上行带来海外流动性压力，市场见顶回落。资金进一步聚焦 AI 硬件，电子、通信虹吸其他板块。6 月市场维持震荡分化，指数依靠少数赛道保持韧性，但个股中位数持续走弱，多数标的承受调整压力。

总体来看，2026 年上半年上证综指上涨 3.16%，沪深 300 上涨 7.55%，中证 500 指数上涨 20.97%，创业板指上涨 35.58%，科创综指上涨 53.99%。

在投资管理上，我们坚持采取量化策略进行投资和风险管理，积极获取超额收益率。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 6 月 30 日，本基金份额净值富国中证 A500 指数增强 A 为 1.4301 元，富国中证 A500 指数增强 C 为 1.4260 元；份额累计净值富国中证 A500 指数增强 A 为 1.4301 元，富国中证 A500 指数增强 C 为 1.4260 元；本报告期，本基金份额净值增长率情况：富国中证 A500 指数增强 A 为 13.28%，富国中证 A500 指数增强 C 为 13.17%；同期业绩比较基准收益率情况：富国中证 A500 指数增强 A 为 11.34%，富国中证 A500 指数增强 C 为 11.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，随着部分不确定因素逐步明朗，市场或仍以震荡运行为主。从外部环境来看，地缘政治局势仍可能对市场风险偏好产生扰动，油价冲高后有所回落；美国通胀数据环比回落，

叠加非农数据走弱，后续美联储加息预期或有所降温，对全球流动性的压制可能相应缓解。国内方面，经济修复态势短期或将延续，内需仍有待进一步修复，后续稳增长政策及相关工程项目的实施效果值得关注。整体来看，受资金博弈等因素影响，市场运行过程中仍可能伴随节奏波动与反复。8月中报密集披露期可能促使市场进一步关注企业盈利表现，市场机会或更多体现为具有业绩支撑品种的估值修复。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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》等法律法规、估值指引的相关规定，以及基金合同对估值程序的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、基金份额净值的计算由基金管理人独立完成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、本基金《基金合同》的约定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：富国中证 A500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：		
货币资金	28,008,832.20	9,582,219.98
结算备付金	18,177,000.94	2,395,251.20
存出保证金	2,430,115.20	5,736,614.40
交易性金融资产	1,033,691,233.28	424,382,121.56
其中：股票投资	989,112,998.47	407,668,095.21
基金投资	—	—
债券投资	44,578,234.81	16,714,026.35
资产支持证券投资	—	—
贵金属投资	—	—
其他投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收清算款	—	—
应收股利	—	—
应收申购款	16,636,441.39	60,151,747.07
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	1,098,943,623.01	502,247,954.21
负债和净资产	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	20,000,824.66	13,203,452.04
应付清算款	—	—
应付赎回款	14,655,143.86	7,931,478.29
应付管理人报酬	623,811.00	244,274.33
应付托管费	116,964.56	45,801.43
应付销售服务费	70,747.56	26,931.45
应付投资顾问费	—	—
应交税费	6,869.31	9,769.28

应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	125,358.41	163,432.00
负债合计	35,599,719.36	21,625,138.82
净资产：		
实收基金	744,598,828.36	381,094,133.11
未分配利润	318,745,075.29	99,528,682.28
净资产合计	1,063,343,903.65	480,622,815.39
负债和净资产总计	1,098,943,623.01	502,247,954.21

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.4281 元，基金份额总额 744,598,828.36 份。其中：富国中证 A500 指数增强 A 份额净值 1.4301 元，份额总额 379,648,098.70 份；富国中证 A500 指数增强 C 份额净值 1.4260 元，份额总额 364,950,729.66 份。

6.2 利润表

会计主体：富国中证 A500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 (2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日)	上年度可比期间 (2025 年 1 月 23 日(基金合同生效日) 至 2025 年 6 月 30 日)
一、营业总收入	115,666,706.83	7,746,607.97
1. 利息收入	163,897.52	709,450.91
其中：存款利息收入	163,897.52	117,744.93
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	—	591,705.98
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	95,908,514.67	-89,995.98
其中：股票投资收益	85,407,136.67	-4,391,304.01
基金投资收益	—	—
债券投资收益	249,237.28	8,991.83
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具收益	2,225,523.85	—
股利收益	8,026,616.87	4,292,316.20
其他投资收益	—	—
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	19,260,287.27	7,116,681.26
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	334,007.37	10,471.78
减：二、营业总支出	4,446,072.74	2,205,826.04
1. 管理人报酬	3,277,057.25	1,590,876.56

2. 托管费	614,448.24	298,289.39
3. 销售服务费	326,619.39	232,180.16
4. 投资顾问费	—	—
5. 利息支出	135,087.00	—
其中：卖出回购金融资产支出	135,087.00	—
6. 信用减值损失	—	—
7. 税金及附加	8,700.45	11.43
8. 其他费用	84,160.41	84,468.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	111,220,634.09	5,540,781.93
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	111,220,634.09	5,540,781.93
五、其他综合收益的税后净额	—	—
六、综合收益总额	111,220,634.09	5,540,781.93

6.3 净资产变动表

会计主体：富国中证 A500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 (2026 年 01 月 01 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	381,094,133.11	99,528,682.28	480,622,815.39
二、本期期初净资产	381,094,133.11	99,528,682.28	480,622,815.39
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	363,504,695.25	219,216,393.01	582,721,088.26
（一）、综合收益总额	—	111,220,634.09	111,220,634.09
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	363,504,695.25	107,995,758.92	471,500,454.17
其中：1. 基金申购款	1,536,826,795.14	520,699,245.28	2,057,526,040.42
2. 基金赎回款	— 1,173,322,099.89	— -412,703,486.36	— 1,586,025,586.25
（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	744,598,828.36	318,745,075.29	1,063,343,903.65
项目	上年度可比期间（2025 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日）		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、本期期初净资产	750,161,178.30	—	750,161,178.30
二、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-440,955,856.62	4,801,245.07	-436,154,611.55
（一）、综合收益总额	—	5,540,781.93	5,540,781.93
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净	-440,955,856.62	-739,536.86	-441,695,393.48

资产减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	74,848,956.35	-1,662,692.18	73,186,264.17
2. 基金赎回款	-515,804,812.97	923,155.32	-514,881,657.65
(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）	—	—	—
三、本期期末净资产	309,205,321.68	4,801,245.07	314,006,566.75

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：

陈 戈

林志松

徐 慧

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

富国中证 A500 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可（2024）1596 号《关于准予富国中证 A500 指数增强型证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人富国基金管理有限公司自 2024 年 12 月 26 日至 2025 年 1 月 21 日止期间向社会公开发行募集，募集期结束经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具德师报(验)字(25)第 00025 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2025 年 1 月 23 日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 749,987,368.47 元，募集资金在募集期间产生的利息为人民币 173,809.83 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 750,161,178.30 元，折合 750,161,178.30 份基金份额，其中 A 类基金份额 291,085,194.60 份，C 类基金份额 459,075,983.70 份。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股、备选成份股（均含存托凭证）、港股通标的股票、其他股票（包括主板、科创板、创业板及其他经中国证监会允许发行的股票）、存托凭证、债券（国债、央行票据、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金的股票（含存托凭证）资产投资比例不低于基金资产的 80%（其中港股通标的股票不超过股票资产的 20%），投资于标的指数成份股及其备选成份股（均含存托凭证）的资产不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，基金管理人在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。

本基金的业绩比较基准为：中证 A500 指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本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、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”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会发布的《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号〈会计报表附注的编制及披露〉》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政

策、会计估计一致。

6.4.5 会计差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

2 增值税

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 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》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品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，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税，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、债券取得的收入免征增值税；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税；本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为适用简易计税方法，按照 3% 的征收率计算缴纳增值税；

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（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。对在该日期之前已发行的国债、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 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定(2011年修订)》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育附加。

4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（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、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，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。

5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金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，暂减按25%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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会

财税[2014]81 号文《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[2016]127 号文《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》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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	2,503,053.76
等于：本金	2,502,798.95
加：应计利息	254.81
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	25,505,778.44
等于：本金	25,500,976.85
加：应计利息	4,801.59
减：坏账准备	—
合计	28,008,832.20

注：本基金本报告期末未持有定期存款。其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

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		960,631,134.25	—	989,112,998.47	28,481,864.22
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	44,223,537.00	315,574.81	44,578,234.81	39,123.00
	银行间市场	—	—	—	—
	合计	44,223,537.00	315,574.81	44,578,234.81	39,123.00
资产支持证券		—	—	—	—
基金		—	—	—	—
其他		—	—	—	—

合计	1,004,854,671.25	315,574.81	1,033,691,233.28	28,520,987.22
----	------------------	------------	------------------	---------------

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06月30日）			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	—	—	—	—
货币衍生工具	—	—	—	—
权益衍生工具	19,791,500.00	—	—	—
股指期货	19,791,500.00	—	—	—
其他衍生工具	—	—	—	—
合计	19,791,500.00	—	—	—

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。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2608	IF2608	9.00	13,173,840.00	254,340.00
IC2608	IC2608	4.00	7,077,120.00	205,120.00
合计				459,460.00
减：可抵销期货暂收款				459,460.00
净额				—

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末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

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易。

6.4.7.5 其他资产

注：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06月30日）
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	7.60
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	—
预提信息披露费	60,000.00
预提审计费	61,843.91
其他	3,506.90
合计	125,358.41

6.4.7.7 实收基金

富国中证 A500 指数增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期（2026年01月01日至2026年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	171,788,882.20	171,788,882.20
本期申购	848,263,174.63	848,263,174.63
本期赎回（以“-”号填列）	-640,403,958.13	-640,403,958.13
本期末	379,648,098.70	379,648,098.70

富国中证 A500 指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期（2026年01月01日至2026年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	209,305,250.91	209,305,250.91
本期申购	688,563,620.51	688,563,620.51
本期赎回（以“-”号填列）	-532,918,141.76	-532,918,141.76
本期末	364,950,729.66	364,950,729.66

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

富国中证 A500 指数增强 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	39,729,553.58	5,357,243.20	45,086,796.78
本期期初	39,729,553.58	5,357,243.20	45,086,796.78
本期利润	53,978,597.93	10,106,456.85	64,085,054.78

本期基金份额交易产生的变动数	56,608,707.21	-2,502,856.65	54,105,850.56
其中：基金申购款	259,030,466.69	21,546,683.86	280,577,150.55
基金赎回款	-202,421,759.48	-24,049,540.51	-226,471,299.99
本期已分配利润	—	—	—
本期末	150,316,858.72	12,960,843.40	163,277,702.12

富国中证 A500 指数增强 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	47,922,400.22	6,519,485.28	54,441,885.50
本期期初	47,922,400.22	6,519,485.28	54,441,885.50
本期利润	37,981,748.89	9,153,830.42	47,135,579.31
本期基金份额交易产生的变动数	57,123,294.80	-3,233,386.44	53,889,908.36
其中：基金申购款	222,078,832.89	18,043,261.84	240,122,094.73
基金赎回款	-164,955,538.09	-21,276,648.28	-186,232,186.37
本期已分配利润	—	—	—
本期末	143,027,443.91	12,439,929.26	155,467,373.17

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）
活期存款利息收入	6,954.01
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	104,506.04
结算备付金利息收入	47,296.59
其他	5,140.88
合计	163,897.52

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）
卖出股票成交总额	3,118,324,527.58
减：卖出股票成本总额	3,030,016,393.60
减：交易费用	2,900,997.31
买卖股票差价收入	85,407,136.67

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）
----	--

债券投资收益——利息收入	205,995.61
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	43,241.67
合计	249,237.28

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2026年01月01日至2026年06月30日）
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	5,132,100.96
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,029,550.00
减：应计利息总额	59,306.37
减：交易费用	2.92
买卖债券差价收入	43,241.67

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.13 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无买卖贵金属交易。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2026年01月01日至2026年06月30日）
股指期货投资收益	2,225,523.85

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2026年01月01日至2026年06月30日）
股票投资产生的股利收益	8,026,616.87

其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	—
合计	8,026,616.87

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2026年01月01日至2026年06月30日）
1. 交易性金融资产	18,625,995.27
股票投资	18,596,038.97
债券投资	29,956.30
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	634,292.00
权证投资	—
股指期货	634,292.00
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	19,260,287.27

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2026年01月01日至2026年06月30日）
基金赎回费收入	330,712.40
基金转换费收入	3,294.97
合计	334,007.37

6.4.7.18 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期（2026年01月01日至2026年06月30日）
审计费用	18,843.91
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	5,287.19
其他	29.31
合计	84,160.41

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

截至财务报表批准日，本基金无其他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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大影响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
富国基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构（2025 年 3 月 14 日前）
国泰海通证券股份有限公司（“国泰海通”）	基金管理人的股东、基金代销机构（自 2025 年 3 月 14 日起）
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东、基金代销机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金代销机构
申万宏源证券承销保荐有限责任公司	基金管理人的股东控制的子公司

注：（1）关联方国泰海通证券股份有限公司（简称“国泰海通”）是由原国泰君安证券股份有限公司与原关联方海通证券股份有限公司于 2025 年 3 月 14 日合并组建而成。

（2）以下关联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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均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01月01日至2026年06月30日）	上年度可比期间（2025年1月23日（基金合同生效日）至2025年6月30日）
当期发生的基金应支付的管理费	3,277,057.25	1,590,876.56
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,414,781.39	759,206.55
应支付基金管理人的净管理费	1,862,275.86	831,670.01

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.80%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2026年01月01日至2026年06月30日）	上年度可比期间（2025年1月23日（基金合同生效日）至2025年6月30日）
当期发生的基金应支付的托管费	614,448.24	298,289.39

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富国中证 A500 指数增强 A	富国中证 A500 指数增强 C	合计
富国基金管理有限公司	—	7,897.90	7,897.90
国泰海通证券股份有限公司	—	74.24	74.24
申万宏源证券有限公司	—	179.57	179.57
招商银行股份有限公司	—	73,448.15	73,448.15
合计	—	81,599.86	81,599.86

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间(2025 年 1 月 23 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日)		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富国中证 A500 指数增强 A	富国中证 A500 指数增强 C	合计
富国基金管理有限公司	—	828.13	828.13
国泰海通证券股份有限公司	—	41.59	41.59
海通证券股份有限公司	—	13.44	13.44
招商银行股份有限公司	—	45,348.74	45,348.74
合计	—	46,231.90	46,231.90

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日该类基金份额资产净值的 0.2%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times \text{该类基金份额销售服务费年费率} \div \text{当年天数}$$

H 为该类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为该类基金份额前一日的基金资产净值

C 类基金份额的销售服务费自基金合同生效日次日起每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

从事证券出借业务。

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内及上年度可比期间内本基金的基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）		上年度可比期间（2025 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日）	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	2,503,053.76	6,954.01	8,100,437.11	20,935.12

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
国泰海通证券股份有限公司	301599	理奇智能	IPO 网下申购	4,325	60,160.75
国泰海通证券股份有限公司	301666	大普微	IPO 网下申购	3,048	140,451.84
国泰海通证券股份有限公司	301696	三瑞智能	IPO 网下申购	2,157	53,234.76
国泰海通证券股份有限公司	688781	视涯科技	IPO 网下申购	9,746	221,039.28
国泰海通证券股份有限公司	688818	电科蓝天	IPO 网下申购	14,685	139,066.95

申万宏源证券承销保荐有限责任公司	301682	宏明电子	IPO 网下申购	2,377	165,581.82
申万宏源证券承销保荐有限责任公司	603352	至信股份	IPO 网下申购	1,115	24,396.20

金额单位：人民币元

上年度可比期间(2025 年 1 月 23 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日)					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
申万宏源证券承销保荐有限责任公司	301636	泽润新能	IPO 网下申购	1,273	42,085.38

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期未进行利润分配。

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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001220	世盟股份	2026-01-27	6 个月	新股限售	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	—
001237	惠康科技	2026-05-15	6 个月	新股限售	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	—
001248	华润新能源	2026-06-24	6 个月	新股限售	10.11	10.11	28,299	286,102.89	286,102.89	—
001248	华润新能源	2026-06-24	1 个月内（含）	新股认购	10.11	10.11	12,127	122,603.97	122,603.97	—
001312	福恩股份	2026-04-14	6 个月	新股限售	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	—
001365	天海电子	2026-05-11	6 个月	新股限售	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	—
001393	维通利	2026-05-08	6 个月	新股限售	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	—

001399	惠科股份	2026-06-16	6 个月	新股限售	10.12	27.73	4,866	49,243.92	134,934.18	—
301513	尚水智能	2026-04-10	6 个月	新股限售	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	—
301531	春光集团	2026-04-28	6 个月	新股限售	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	—
301599	理奇智能	2026-04-22	6 个月	新股限售	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	—
301666	大普微	2026-04-08	6 个月	新股限售	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	—
301669	高特电子	2026-06-02	6 个月	新股限售	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	—
301680	固德电材	2026-02-27	6 个月	新股限售	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	—
301682	宏明电子	2026-03-18	6 个月	新股限售	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	—
301683	慧谷新材	2026-03-24	6 个月	新股限售	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	—
301687	新广益	2025-12-24	6 个月	新股限售	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	—
301696	三瑞智能	2026-03-31	6 个月	新股限售	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	—
601112	振石股份	2026-01-21	6 个月	新股限售	11.18	17.59	455	5,086.90	8,003.45	—
603284	林平发展	2026-02-03	6 个月	新股限售	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	—
603293	埃泰克	2026-04-09	6 个月	新股限售	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	—
603352	至信股份	2026-01-08	6 个月	新股限售	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	—
603435	嘉德利	2026-05-15	6 个月	新股限售	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	—
603459	红板科技	2026-03-31	6 个月	新股限售	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	—
688781	视涯科技	2026-03-18	9 个月	新股限售	22.68	42.16	6,335	143,677.80	267,083.60	—
688783	西安奕材	2025-10-20	9 个月	新股限售	8.62	57.42	13,147	113,327.14	754,900.74	—
688785	恒运昌	2026-01-20	6 个月	新股限售	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	—
688790	昂瑞微	2025-12-09	9 个月	新股限售	83.06	126.45	986	81,897.16	124,679.70	—

688795	摩尔线程	2025-11-26	9 个月	新股限售	114.28	676.94	1,280	146,278.40	866,483.20	—
688797	臻宝科技	2026-06-16	6 个月	新股限售	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	—
688802	沐曦股份	2025-12-09	9 个月	新股限售	104.66	768.89	965	100,996.90	741,978.85	—
688808	联讯仪器	2026-04-16	6 个月	新股限售	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	—
688811	有研新材	2026-04-01	6 个月	新股限售	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	—
688813	泰金新能	2026-03-24	6 个月	新股限售	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	—
688816	易思维	2026-02-04	6 个月	新股限售	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	—
688818	电科蓝天	2026-02-03	6 个月	新股限售	9.47	70.14	1,469	13,911.43	103,035.66	—
688820	盛合晶微	2026-04-13	6 个月	新股限售	19.68	141.49	1,414	27,827.52	200,066.86	—

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113704	春风转债	2026-06-10	1 个月内（含）	认购新发证券	100.00	100.00	290	29,000.00	29,001.33	—

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 06 月 29 日	重大事项停牌	832.00	2026 年 07 月 13 日	890.99	4,341.00	2,628,498.89	3,611,712.00	—

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出

回购证券款余额 20,000,824.66 元，于 2026 年 7 月 6 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部和合规稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。由于国债、央行票据和政策性金融债的信用风险很低，故不进行列示。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的信用债。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末（2026 年 06 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
--------	-----------------------	------------------------

AAA	—	—
AAA 以下	29,001.33	4,718.96
未评级	—	—
合计	29,001.33	4,718.96

注：本表主要列示除短融和超短融之外的信用债，债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

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。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。

本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金本报告期末无重大流动性风险。

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货币资金、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末（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	28,008,832.20	—	—	—	28,008,832.20
结算备付金	18,177,000.94	—	—	—	18,177,000.94
存出保证金	—	—	—	2,430,115.20	2,430,115.20
交易性金融资产	44,578,234.81	—	—	989,112,998.47	1,033,691,233.28
应收申购款	—	—	—	16,636,441.39	16,636,441.39
资产总计	90,764,067.95	—	—	1,008,179,555.06	1,098,943,623.01
负债					
卖出回购金融资产款	20,000,824.66	—	—	—	20,000,824.66
应付赎回款	—	—	—	14,655,143.86	14,655,143.86
应付管理人报酬	—	—	—	623,811.00	623,811.00
应付托管费	—	—	—	116,964.56	116,964.56
应付销售服务费	—	—	—	70,747.56	70,747.56
应交税费	—	—	—	6,869.31	6,869.31
其他负债	—	—	—	125,358.41	125,358.41
负债总计	20,000,824.66	—	—	15,598,894.70	35,599,719.36
利率敏感度缺口	70,763,243.29	—	—	992,580,660.36	1,063,343,903.65

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	9,582,219.98	—	—	—	9,582,219.98
结算备付金	2,395,251.20	—	—	—	2,395,251.20
存出保证金	—	—	—	5,736,614.40	5,736,614.40
交易性金融资产	16,714,026.35	—	—	407,668,095.21	424,382,121.56
应收申购款	—	—	—	60,151,747.07	60,151,747.07
资产总计	28,691,497.53	—	—	473,556,456.68	502,247,954.21
负债					
卖出回购金融资产款	13,203,452.04	—	—	—	13,203,452.04
应付赎回款	—	—	—	7,931,478.29	7,931,478.29
应付管理人报酬	—	—	—	244,274.33	244,274.33
应付托管费	—	—	—	45,801.43	45,801.43
应付销售服务费	—	—	—	26,931.45	26,931.45
应交税费	—	—	—	9,769.28	9,769.28
其他负债	—	—	—	163,432.00	163,432.00
负债总计	13,203,452.04	—	—	8,421,686.78	21,625,138.82
利率敏感度缺口	15,488,045.49	—	—	465,134,769.90	480,622,815.39

注：上表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 影响生息资产公允价值的其他变量不变，仅利率发生变动；2. 利率变动范围合理。		
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）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	1. 基准点利率增加 0.1%	-19,536.81	-8,906.06
	2. 基准点利率减少 0.1%	19,536.81	8,906.06

注：上表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的

变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金可持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场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证券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

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）		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	989,112,998.47	93.02	407,668,095.21	84.82
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	44,578,234.81	4.19	16,714,026.35	3.48
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	1,033,691,233.28	97.21	424,382,121.56	88.30

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关；2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值风险变量保持不变。		
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）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）

	1. 业绩比较基准增加 1%	10,348,410.87	4,458,008.29
	2. 业绩比较基准减少 1%	-10,348,410.87	-4,458,008.29

注：本基金管理人运用资本资产定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，业绩比较基准所对应的市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末（2026 年 06 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
第一层次	980,524,339.98	405,184,304.54
第二层次	48,613,820.77	17,413,632.36
第三层次	4,553,072.53	1,784,184.66
合计	1,033,691,233.28	424,382,121.56

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行业务等情况，本基金不

会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均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

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，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	989,112,998.47	90.01
	其中：股票	989,112,998.47	90.01
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	44,578,234.81	4.06
	其中：债券	44,578,234.81	4.06
	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	46,185,833.14	4.20
8	其他各项资产	19,066,556.59	1.73
9	合计	1,098,943,623.01	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

7.2.1.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	150,457.00	0.01
B	采矿业	46,988,775.35	4.42
C	制造业	593,979,268.02	55.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,242,006.00	1.15
E	建筑业	5,063,931.00	0.48
F	批发和零售业	14,078,538.00	1.32
G	交通运输、仓储和邮政业	26,386,324.00	2.48
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	43,960,218.30	4.13
J	金融业	60,001,331.13	5.64
K	房地产业	4,713,326.00	0.44
L	租赁和商务服务业	7,496,399.61	0.70
M	科学研究和技术服务业	19,217,724.40	1.81

N	水利、环境和公共设施管理业	16,441,826.42	1.55
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	523,418.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	340,724.72	0.03
S	综合	96,022.00	0.01
	合计	851,680,289.95	80.09

7.2.1.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	6,349,131.00	0.60
C	制造业	86,053,265.95	8.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,765,406.86	0.35
E	建筑业	987,890.00	0.09
F	批发和零售业	2,765,154.00	0.26
G	交通运输、仓储和邮政业	3,154,366.82	0.30
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,500,486.39	0.61
J	金融业	23,832,587.00	2.24
K	房地产业	1,369,988.00	0.13
L	租赁和商务服务业	218,708.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	1,940,422.00	0.18
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	456,855.00	0.04
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	38,447.50	0.00
S	综合	—	—
	合计	137,432,708.52	12.92

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	37,200	47,244,000.00	4.44
2	300750	宁德时代	73,900	29,043,439.00	2.73

3	603259	药明康德	150,640	18,756,186.40	1.76
4	300502	新易盛	28,024	17,010,568.00	1.60
5	603986	兆易创新	19,400	15,811,000.00	1.49
6	600519	贵州茅台	11,810	14,000,636.90	1.32
7	601899	紫金矿业	535,600	13,464,984.00	1.27
8	002384	东山精密	47,900	12,566,565.00	1.18
9	688002	睿创微纳	79,074	12,231,957.06	1.15
10	600030	中信证券	415,190	11,928,408.70	1.12
11	000333	美的集团	156,300	11,805,339.00	1.11
12	600150	中国船舶	343,359	11,602,100.61	1.09
13	002266	浙富控股	2,241,597	11,342,480.82	1.07
14	000792	盐湖股份	350,800	10,590,652.00	1.00
15	688256	寒武纪	6,069	9,683,392.95	0.91
16	688981	中芯国际	55,978	8,890,425.96	0.84
17	688008	澜起科技	28,458	8,819,134.20	0.83
18	002738	中矿资源	148,500	8,760,015.00	0.82
19	002414	高德红外	656,800	8,709,168.00	0.82
20	600418	江淮汽车	335,400	8,663,382.00	0.81
21	601398	工商银行	1,197,600	8,467,032.00	0.80
22	688012	中微公司	17,623	8,256,375.50	0.78
23	600989	宝丰能源	405,700	8,247,881.00	0.78
24	300475	香农芯创	27,000	8,100,000.00	0.76
25	600938	中国海油	287,901	7,816,512.15	0.74
26	002049	紫光国微	87,137	7,733,408.75	0.73
27	603799	华友钴业	155,700	7,514,082.00	0.71
28	002371	北方华创	8,400	7,430,304.00	0.70
29	300857	协创数据	21,600	7,341,840.00	0.69
30	601318	中国平安	152,900	7,299,446.00	0.69
31	600487	亨通光电	63,800	6,975,892.00	0.66
32	688111	金山办公	31,438	6,697,865.90	0.63
33	600026	中远海能	369,500	6,628,830.00	0.62
34	688041	海光信息	17,635	6,530,240.50	0.61
35	601328	交通银行	1,014,000	6,520,020.00	0.61
36	002156	通富微电	84,300	6,395,841.00	0.60
37	600183	生益科技	36,200	6,277,080.00	0.59
38	688498	源杰科技	3,314	6,250,204.00	0.59
39	000975	山金国际	361,600	6,147,200.00	0.58
40	002271	东方雨虹	516,900	6,135,603.00	0.58
41	600522	中天科技	97,700	5,928,436.00	0.56
42	300604	长川科技	16,900	5,769,998.00	0.54
43	002415	海康威视	165,200	5,649,840.00	0.53

44	002475	立讯精密	79,000	5,561,600.00	0.52
45	600900	长江电力	200,800	5,315,176.00	0.50
46	000651	格力电器	136,200	5,107,500.00	0.48
47	000338	潍柴动力	185,800	5,063,050.00	0.48
48	002558	巨人网络	181,400	4,999,384.00	0.47
49	300432	富临精工	245,000	4,922,050.00	0.46
50	002709	天赐材料	94,510	4,860,649.30	0.46
51	601985	中国核电	537,100	4,850,013.00	0.46
52	688266	泽璟制药	40,641	4,741,179.06	0.45
53	300223	君正股份	18,800	4,679,320.00	0.44
54	000933	神火股份	220,300	4,670,360.00	0.44
55	601988	中国银行	811,050	4,639,206.00	0.44
56	601872	招商轮船	258,000	4,533,060.00	0.43
57	601288	农业银行	717,900	4,357,653.00	0.41
58	688578	艾力斯	39,257	4,286,864.40	0.40
59	300476	胜宏科技	12,305	4,262,821.15	0.40
60	600309	万华化学	62,200	4,255,102.00	0.40
61	000988	华工科技	22,600	4,172,186.00	0.39
62	600875	东方电气	143,200	4,119,864.00	0.39
63	600887	伊利股份	171,500	4,109,140.00	0.39
64	002028	思源电气	23,700	4,100,100.00	0.39
65	300014	亿纬锂能	63,000	4,096,890.00	0.39
66	300661	圣邦股份	28,300	4,060,484.00	0.38
67	300408	三环集团	23,690	3,953,861.00	0.37
68	600233	圆通速递	250,700	3,948,525.00	0.37
69	001965	招商公路	424,500	3,888,420.00	0.37
70	600489	中金黄金	209,994	3,790,391.70	0.36
71	600323	瀚蓝环境	137,500	3,775,750.00	0.36
72	688235	百济神州	14,577	3,711,449.97	0.35
73	300073	当升科技	77,100	3,703,884.00	0.35
74	000807	云铝股份	165,400	3,661,956.00	0.34
75	601877	正泰电器	144,400	3,620,108.00	0.34
76	688072	拓荆科技	4,341	3,611,712.00	0.34
77	002517	恺英网络	218,800	3,555,500.00	0.33
78	002544	普天科技	193,300	3,521,926.00	0.33
79	301308	江波龙	5,000	3,519,000.00	0.33
80	601127	赛力斯	56,600	3,466,750.00	0.33
81	601117	中国化学	459,400	3,376,590.00	0.32
82	300803	指南针	35,300	3,235,951.00	0.30
83	601567	三星电气	216,200	3,230,028.00	0.30
84	000408	藏格矿业	46,200	3,202,584.00	0.30

85	600547	山东黄金	138,100	3,188,729.00	0.30
86	600741	华域汽车	204,100	3,167,632.00	0.30
87	301358	湖南裕能	41,600	3,156,192.00	0.30
88	600885	宏发股份	91,000	3,138,590.00	0.30
89	300049	福瑞医科	80,700	3,137,616.00	0.30
90	688469	芯联集成	293,486	3,113,886.46	0.29
91	600663	陆家嘴	472,700	2,968,556.00	0.28
92	300438	鹏辉能源	34,700	2,874,895.00	0.27
93	002131	利欧股份	592,700	2,815,325.00	0.26
94	688525	佰维存储	5,593	2,767,024.89	0.26
95	300919	中伟新材	62,000	2,712,500.00	0.26
96	002460	赣锋锂业	41,000	2,681,400.00	0.25
97	600893	航发动力	69,300	2,656,962.00	0.25
98	300972	万辰集团	15,200	2,635,832.00	0.25
99	601166	兴业银行	156,798	2,596,574.88	0.24
100	300017	网宿科技	199,100	2,590,291.00	0.24
101	000100	TCL 科技	434,510	2,528,848.20	0.24
102	000001	平安银行	248,600	2,498,430.00	0.23
103	000415	渤海租赁	612,800	2,494,096.00	0.23
104	000938	紫光股份	86,300	2,490,618.00	0.23
105	605117	德业股份	23,440	2,488,859.20	0.23
106	600460	士兰微	45,300	2,476,098.00	0.23
107	600941	中国移动	28,600	2,463,318.00	0.23
108	002600	领益智造	138,200	2,396,388.00	0.23
109	601601	中国太保	82,600	2,355,752.00	0.22
110	000426	兴业银锡	69,500	2,290,720.00	0.22
111	600176	中国巨石	31,300	2,281,144.00	0.21
112	601360	三六零	257,500	2,237,675.00	0.21
113	600426	华鲁恒升	91,900	2,198,248.00	0.21
114	600535	天士力	164,200	2,172,366.00	0.20
115	300677	英科医疗	55,100	2,158,267.00	0.20
116	002493	荣盛石化	200,000	2,150,000.00	0.20
117	603019	中科曙光	19,900	2,133,877.00	0.20
118	000547	航天发展	110,000	2,106,500.00	0.20
119	600219	南山铝业	525,100	2,095,149.00	0.20
120	600018	上港集团	443,000	2,090,960.00	0.20
121	600549	厦门钨业	24,330	2,072,916.00	0.19
122	002463	沪电股份	13,400	2,047,520.00	0.19
123	002195	岩山科技	310,200	2,028,708.00	0.19
124	002155	湖南黄金	84,250	2,011,047.50	0.19
125	603993	洛阳钼业	114,400	2,007,720.00	0.19

126	002532	天山铝业	182,600	1,959,298.00	0.18
127	601857	中国石油	223,500	1,939,980.00	0.18
128	601658	邮储银行	393,100	1,937,983.00	0.18
129	002436	兴森科技	37,900	1,931,005.00	0.18
130	002080	中材科技	21,300	1,917,000.00	0.18
131	603806	福斯特	113,100	1,898,949.00	0.18
132	601888	中国中免	34,923	1,875,714.33	0.18
133	600276	恒瑞医药	35,564	1,850,750.56	0.17
134	300394	天孚通信	5,872	1,777,336.96	0.17
135	002812	恩捷股份	26,200	1,753,042.00	0.16
136	300433	蓝思科技	31,300	1,679,558.00	0.16
137	300207	欣旺达	85,700	1,627,443.00	0.15
138	002185	华天科技	68,500	1,528,235.00	0.14
139	300409	道氏技术	75,300	1,500,729.00	0.14
140	300442	润泽科技	18,000	1,495,260.00	0.14
141	600438	通威股份	123,300	1,493,163.00	0.14
142	000568	泸州老窖	18,945	1,468,616.40	0.14
143	000425	徐工机械	173,500	1,403,615.00	0.13
144	002837	英维克	17,600	1,400,256.00	0.13
145	605499	东鹏饮料	11,305	1,395,376.15	0.13
146	300724	捷佳伟创	19,700	1,390,820.00	0.13
147	600177	雅戈尔	182,216	1,372,086.48	0.13
148	600089	特变电工	58,400	1,314,000.00	0.12
149	000725	京东方A	151,100	1,311,548.00	0.12
150	000034	神州数码	44,140	1,224,885.00	0.12
151	603568	伟明环保	78,020	1,199,947.60	0.11
152	688063	派能科技	22,027	1,173,378.29	0.11
153	300458	全志科技	29,380	1,159,334.80	0.11
154	688396	华润微	11,827	1,153,723.85	0.11
155	600584	长电科技	11,100	1,149,405.00	0.11
156	600000	浦发银行	131,855	1,135,271.55	0.11
157	002497	雅化集团	54,800	1,116,276.00	0.10
158	002281	光迅科技	4,300	1,104,842.00	0.10
159	000301	东方盛虹	96,400	1,103,780.00	0.10
160	002008	大族激光	7,200	1,080,792.00	0.10
161	000733	振华科技	18,800	1,064,832.00	0.10
162	601100	恒立液压	9,800	1,054,088.00	0.10
163	300059	东方财富	50,900	1,037,342.00	0.10
164	688390	固德威	9,495	1,030,302.45	0.10
165	601728	中国电信	195,200	1,013,088.00	0.10
166	600499	科达制造	72,900	1,006,020.00	0.09

167	601018	宁波港	318,100	1,002,015.00	0.09
168	300003	乐普医疗	84,100	996,585.00	0.09
169	002128	电投能源	42,400	980,288.00	0.09
170	002353	杰瑞股份	6,300	960,750.00	0.09
171	601233	桐昆股份	43,000	930,950.00	0.09
172	003816	中国广核	228,600	893,826.00	0.08
173	600711	盛屯矿业	81,400	892,958.00	0.08
174	600690	海尔智家	43,700	891,917.00	0.08
175	600111	北方稀土	18,400	884,120.00	0.08
176	300274	阳光电源	5,500	874,610.00	0.08
177	600497	驰宏锌锗	71,800	869,498.00	0.08
178	000039	中集集团	105,900	858,849.00	0.08
179	688120	华海清科	2,540	818,337.20	0.08
180	002594	比亚迪	10,200	812,940.00	0.08
181	300118	东方日升	64,600	804,270.00	0.08
182	002648	卫星化学	34,000	798,660.00	0.08
183	002130	沃尔核材	41,900	794,424.00	0.07
184	600660	福耀玻璃	15,600	786,864.00	0.07
185	300124	汇川技术	11,300	749,529.00	0.07
186	002407	多氟多	14,700	738,381.00	0.07
187	600346	恒力石化	41,000	726,110.00	0.07
188	300054	鼎龙股份	6,800	720,596.00	0.07
189	600406	国电南瑞	31,121	711,114.85	0.07
190	300390	天华新能	7,600	710,676.00	0.07
191	600988	赤峰黄金	26,800	705,376.00	0.07
192	002352	顺丰控股	22,500	703,350.00	0.07
193	601816	京沪高铁	152,200	689,466.00	0.06
194	600050	中国联通	170,380	681,520.00	0.06
195	301550	斯菱智驱	7,200	658,296.00	0.06
196	002179	中航光电	14,200	656,040.00	0.06
197	002595	豪迈科技	13,675	637,255.00	0.06
198	601000	唐山港	153,500	637,025.00	0.06
199	000657	中钨高新	6,600	631,752.00	0.06
200	300037	新宙邦	6,600	612,810.00	0.06
201	002756	永兴材料	10,700	606,048.00	0.06
202	002466	天齐锂业	9,800	600,936.00	0.06
203	601088	中国神华	14,700	573,888.00	0.05
204	000963	华东医药	20,400	573,648.00	0.05
205	000538	云南白药	12,100	573,177.00	0.05
206	600862	中航高科	31,600	569,748.00	0.05
207	688099	晶晨股份	5,429	558,644.10	0.05

208	600816	建元信托	228,300	557,052.00	0.05
209	300760	迈瑞医疗	4,100	556,903.00	0.05
210	000157	中联重科	79,000	550,630.00	0.05
211	000625	长安汽车	76,300	547,071.00	0.05
212	002273	水晶光电	15,300	542,844.00	0.05
213	300450	先导智能	13,200	537,504.00	0.05
214	600511	国药股份	20,500	533,820.00	0.05
215	600362	江西铜业	12,200	528,260.00	0.05
216	300782	卓胜微	4,800	525,984.00	0.05
217	688180	君实生物	15,283	516,871.06	0.05
218	600208	衢州发展	182,200	515,626.00	0.05
219	600886	国投电力	38,200	508,442.00	0.05
220	688521	芯原股份	1,360	504,750.40	0.05
221	300033	同花顺	2,080	501,280.00	0.05
222	000960	锡业股份	11,700	499,473.00	0.05
223	601668	中国建筑	113,300	491,722.00	0.05
224	601919	中远海控	36,500	483,990.00	0.05
225	300346	南大光电	5,200	481,780.00	0.05
226	603501	豪威集团	5,000	474,250.00	0.04
227	600585	海螺水泥	27,298	462,701.10	0.04
228	300012	华测检测	33,300	461,538.00	0.04
229	603659	璞泰来	15,700	454,201.00	0.04
230	002555	三七互娱	23,200	437,784.00	0.04
231	300395	菲利华	3,200	427,936.00	0.04
232	002938	鹏鼎控股	4,035	425,208.30	0.04
233	601155	新城控股	41,400	424,764.00	0.04
234	001979	招商蛇口	65,600	421,808.00	0.04
235	000423	东阿阿胶	9,200	417,312.00	0.04
236	600039	四川路桥	53,000	414,460.00	0.04
237	688617	惠泰医疗	2,271	412,322.76	0.04
238	002891	中宠股份	15,200	406,144.00	0.04
239	601600	中国铝业	48,300	397,026.00	0.04
240	603288	海天味业	11,880	393,940.80	0.04
241	000630	铜陵有色	60,300	383,508.00	0.04
242	688347	华虹宏力	1,131	380,355.30	0.04
243	600115	中国东航	99,800	380,238.00	0.04
244	300015	爱尔眼科	44,500	367,570.00	0.03
245	603486	科沃斯	7,000	355,250.00	0.03
246	002236	大华股份	21,300	351,237.00	0.03
247	600029	南方航空	67,300	348,614.00	0.03
248	601607	上海医药	22,500	346,500.00	0.03

249	601225	陕西煤业	16,800	341,880.00	0.03
250	000617	中油资本	51,700	340,703.00	0.03
251	000683	博源化工	58,300	335,808.00	0.03
252	601628	中国人寿	9,400	332,290.00	0.03
253	300896	爱美客	3,800	331,360.00	0.03
254	601111	中国国航	54,500	329,725.00	0.03
255	601168	西部矿业	11,900	322,966.00	0.03
256	600028	中国石化	71,600	319,336.00	0.03
257	688036	传音控股	5,363	316,148.85	0.03
258	002294	信立泰	9,700	309,333.00	0.03
259	300454	深信服	3,200	307,840.00	0.03
260	603939	益丰药房	16,700	300,266.00	0.03
261	000999	华润三九	13,300	299,117.00	0.03
262	600019	宝钢股份	53,800	292,134.00	0.03
263	000786	北新建材	15,900	287,631.00	0.03
264	000519	中兵红箭	13,400	282,338.00	0.03
265	002074	国轩高科	10,200	280,602.00	0.03
266	002916	深南电路	610	279,319.00	0.03
267	300142	沃森生物	21,400	277,986.00	0.03
268	688188	柏楚电子	2,603	277,740.10	0.03
269	601766	中国中车	53,300	277,160.00	0.03
270	601006	大秦铁路	60,000	276,600.00	0.03
271	000063	中兴通讯	7,600	275,044.00	0.03
272	300832	新产业	6,500	273,000.00	0.03
273	688599	天合光能	19,179	270,807.48	0.03
274	600398	海澜之家	51,100	267,253.00	0.03
275	300122	智飞生物	22,850	267,116.50	0.03
276	300136	信维通信	2,197	261,992.25	0.02
277	601319	中国人保	38,600	260,936.00	0.02
278	601021	春秋航空	5,700	259,806.00	0.02
279	603129	春风动力	1,000	255,800.00	0.02
280	002472	双环传动	6,100	253,211.00	0.02
281	300251	光线传媒	22,708	251,831.72	0.02
282	002625	光启技术	8,300	251,656.00	0.02
283	600066	宇通客车	9,120	244,507.20	0.02
284	000878	云南铜业	15,300	242,964.00	0.02
285	603816	顾家家居	10,300	230,308.00	0.02
286	603899	晨光股份	10,800	222,804.00	0.02
287	601677	明泰铝业	13,400	222,440.00	0.02
288	002444	巨星科技	7,100	220,810.00	0.02
289	600795	国电电力	47,000	219,490.00	0.02

290	600515	海南机场	77,400	212,076.00	0.02
291	600031	三一重工	12,200	210,816.00	0.02
292	002821	凯莱英	1,300	210,600.00	0.02
293	688005	容百科技	6,880	210,528.00	0.02
294	002223	鱼跃医疗	8,200	210,412.00	0.02
295	600482	中国动力	6,400	209,920.00	0.02
296	601390	中国中铁	49,400	205,998.00	0.02
297	002027	分众传媒	42,192	204,209.28	0.02
298	000887	中鼎股份	11,400	203,946.00	0.02
299	603833	欧派家居	6,700	201,737.00	0.02
300	600096	云天化	6,500	197,600.00	0.02
301	603979	金诚信	3,300	194,799.00	0.02
302	601179	中国西电	13,000	193,960.00	0.02
303	600352	浙江龙盛	15,700	190,127.00	0.02
304	601186	中国铁建	31,400	186,830.00	0.02
305	300573	兴齐眼药	4,551	185,498.76	0.02
306	600011	华能国际	24,100	182,919.00	0.02
307	600170	上海建工	80,500	178,710.00	0.02
308	002064	华峰化学	18,400	174,616.00	0.02
309	603605	珀莱雅	2,900	173,768.00	0.02
310	000002	万 科A	57,600	170,496.00	0.02
311	000400	许继电气	7,800	169,260.00	0.02
312	002050	三花智控	3,695	161,951.85	0.02
313	600763	通策医疗	4,600	155,848.00	0.01
314	601799	星宇股份	1,700	154,054.00	0.01
315	002714	牧原股份	4,300	150,457.00	0.01
316	600008	首创环保	53,000	144,160.00	0.01
317	600998	九州通	30,000	140,700.00	0.01
318	600332	白云山	7,000	140,280.00	0.01
319	600529	山东药玻	7,600	140,220.00	0.01
320	600704	物产中大	29,300	138,296.00	0.01
321	601012	隆基绿能	10,500	137,760.00	0.01
322	601216	君正集团	29,200	130,232.00	0.01
323	601633	长城汽车	8,600	129,774.00	0.01
324	002078	太阳纸业	10,300	128,647.00	0.01
325	600803	新奥股份	8,100	127,980.00	0.01
326	002318	久立特材	5,300	126,670.00	0.01
327	000035	中国天楹	25,600	123,648.00	0.01
328	000932	华菱钢铁	34,300	119,021.00	0.01
329	002603	以岭药业	7,632	114,480.00	0.01
330	002001	新 和 成	4,000	113,680.00	0.01

331	688009	中国通号	23,651	112,578.76	0.01
332	002007	华兰生物	9,200	112,148.00	0.01
333	600820	隧道股份	20,600	107,326.00	0.01
334	600153	建发股份	13,500	107,055.00	0.01
335	000032	深桑达A	4,100	102,295.00	0.01
336	603392	万泰生物	3,700	99,789.00	0.01
337	002120	韵达股份	15,500	98,580.00	0.01
338	000833	粤桂股份	4,100	96,022.00	0.01
339	000623	吉林敖东	5,100	90,423.00	0.01
340	002602	世纪华通	6,400	90,240.00	0.01
341	300144	宋城演艺	15,300	88,893.00	0.01
342	600004	白云机场	12,000	87,120.00	0.01
343	002091	江苏国泰	11,700	84,591.00	0.01
344	688116	天奈科技	1,939	74,069.80	0.01
345	300757	罗博特科	100	61,900.00	0.01
346	002025	航天电器	800	60,976.00	0.01
347	002572	索菲亚	8,100	59,130.00	0.01
348	002230	科大讯飞	1,400	57,176.00	0.01
349	688777	中控技术	400	47,000.00	0.00
350	600160	巨化股份	400	21,204.00	0.00
351	000977	浪潮信息	100	7,000.00	0.00

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	301536	星宸科技	49,400	6,358,274.00	0.60
2	001389	广合科技	15,700	3,724,825.00	0.35
3	002142	宁波银行	121,700	3,613,273.00	0.34
4	000776	广发证券	129,000	3,018,600.00	0.28
5	603345	安井食品	36,100	2,894,859.00	0.27
6	002379	宏桥控股	189,200	2,794,484.00	0.26
7	002487	大金重工	47,900	2,776,763.00	0.26
8	600801	华新建材	169,800	2,648,880.00	0.25
9	600919	江苏银行	243,100	2,620,618.00	0.25
10	603198	迎驾贡酒	85,900	2,542,640.00	0.24
11	601995	中金公司	65,600	2,371,440.00	0.22
12	600498	烽火通信	31,900	2,347,840.00	0.22
13	002402	和而泰	90,800	2,345,364.00	0.22
14	603290	斯达半导	15,000	2,294,100.00	0.22
15	002841	视源股份	62,100	2,144,313.00	0.20

16	600999	招商证券	99,800	2,105,780.00	0.20
17	688629	华丰科技	10,541	1,976,542.91	0.19
18	300416	苏试试验	94,900	1,934,062.00	0.18
19	301345	涛涛车业	8,300	1,917,300.00	0.18
20	601336	新华保险	31,700	1,891,222.00	0.18
21	000603	盛达资源	80,300	1,854,930.00	0.17
22	601339	百隆东方	272,100	1,842,117.00	0.17
23	601939	建设银行	187,800	1,808,514.00	0.17
24	603699	纽威股份	35,900	1,805,770.00	0.17
25	605189	富春染织	147,800	1,780,990.00	0.17
26	603893	瑞芯微	9,000	1,695,240.00	0.16
27	002643	万润股份	79,900	1,673,905.00	0.16
28	601699	潞安环能	115,900	1,655,052.00	0.16
29	002468	申通快递	113,500	1,652,560.00	0.16
30	688127	蓝特光学	16,814	1,641,046.40	0.15
31	601009	南京银行	164,800	1,629,872.00	0.15
32	601077	渝农商行	260,500	1,591,655.00	0.15
33	688795	摩尔线程	2,265	1,572,225.85	0.15
34	605599	菜百股份	111,300	1,524,810.00	0.14
35	300413	芒果超媒	101,000	1,477,630.00	0.14
36	300129	泰胜风能	161,100	1,377,405.00	0.13
37	601869	长飞光纤	2,500	1,364,750.00	0.13
38	300850	新强联	50,600	1,356,080.00	0.13
39	600188	兖矿能源	72,200	1,282,994.00	0.12
40	688378	奥来德	20,540	1,273,480.00	0.12
41	002961	瑞达期货	64,200	1,257,036.00	0.12
42	003010	若羽臣	49,000	1,190,700.00	0.11
43	688301	奕瑞科技	9,445	1,171,180.00	0.11
44	688095	福昕软件	19,641	1,167,264.63	0.11
45	688717	艾罗能源	14,027	1,158,209.39	0.11
46	002803	吉宏股份	44,100	1,139,544.00	0.11
47	001914	招商积余	133,600	1,090,176.00	0.10
48	601139	深圳燃气	179,200	1,014,272.00	0.10
49	601611	中国核建	88,600	987,890.00	0.09
50	001286	陕西能源	96,300	976,482.00	0.09
51	002345	潮宏基	105,500	967,435.00	0.09
52	300870	欧陆通	2,600	898,794.00	0.08
53	600350	山东高速	78,200	870,366.00	0.08
54	600299	安迪苏	110,600	868,210.00	0.08
55	301165	锐捷网络	10,600	852,770.00	0.08
56	002946	新乳业	58,900	829,312.00	0.08

57	601456	国联民生	90,200	797,368.00	0.07
58	301377	鼎泰高科	1,400	771,260.00	0.07
59	688783	西安奕材	13,147	754,900.74	0.07
60	300285	国瓷材料	7,300	753,214.00	0.07
61	688802	沐曦股份	965	741,978.85	0.07
62	000534	万泽股份	26,700	730,512.00	0.07
63	603619	中曼石油	38,300	716,593.00	0.07
64	300926	博俊科技	39,500	701,125.00	0.07
65	600750	华润江中	31,600	697,412.00	0.07
66	300236	上海新阳	5,300	696,950.00	0.07
67	601138	工业富联	9,400	678,210.00	0.06
68	688775	影石创新	4,699	651,516.35	0.06
69	600566	济川药业	29,200	647,948.00	0.06
70	605111	新洁能	6,400	634,496.00	0.06
71	301371	敷尔佳	22,400	582,400.00	0.05
72	300277	汽轮科技	38,300	576,032.00	0.05
73	301606	绿联科技	9,400	573,588.00	0.05
74	300738	奥飞数据	28,300	572,226.00	0.05
75	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.05
76	002270	华明装备	29,800	561,730.00	0.05
77	002948	青岛银行	107,900	548,132.00	0.05
78	601991	大唐发电	77,300	547,284.00	0.05
79	300570	太辰光	2,200	542,762.00	0.05
80	600985	淮北矿业	37,600	528,280.00	0.05
81	603737	三棵树	21,000	506,100.00	0.05
82	688025	杰普特	1,002	470,940.00	0.04
83	300492	华图山鼎	13,300	456,855.00	0.04
84	603296	华勤技术	6,120	454,532.40	0.04
85	002043	兔宝宝	40,800	452,064.00	0.04
86	688326	经纬恒润	6,371	451,576.48	0.04
87	688668	鼎通科技	1,200	447,960.00	0.04
88	603507	振江股份	13,200	434,148.00	0.04
89	600483	福能股份	41,600	423,904.00	0.04
90	688059	华锐精密	2,111	421,587.81	0.04
91	002865	钧达股份	7,000	417,760.00	0.04
92	002534	西子洁能	22,200	411,810.00	0.04
93	001248	华润新能源	40,426	408,706.86	0.04
94	301086	鸿富瀚	1,900	397,632.00	0.04
95	300596	利安隆	7,200	377,856.00	0.04
96	688018	乐鑫科技	2,924	374,038.08	0.04
97	300773	拉卡拉	23,400	358,020.00	0.03

98	000429	粤高速A	24,900	339,885.00	0.03
99	301061	匠心家居	9,400	329,658.00	0.03
100	601881	中国银河	23,600	296,652.00	0.03
101	601865	福莱特	27,500	289,025.00	0.03
102	003022	联泓新科	11,100	287,490.00	0.03
103	600563	法拉电子	1,500	286,200.00	0.03
104	300769	德方纳米	4,300	285,950.00	0.03
105	600023	浙能电力	52,800	277,728.00	0.03
106	300628	亿联网络	8,100	273,942.00	0.03
107	688388	嘉元科技	6,142	270,248.00	0.03
108	000708	中信特钢	21,400	270,068.00	0.03
109	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.03
110	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.02
111	002997	瑞鹄模具	9,200	253,552.00	0.02
112	300990	同飞股份	2,400	252,168.00	0.02
113	300002	神州泰岳	32,200	251,482.00	0.02
114	300627	华测导航	8,640	245,376.00	0.02
115	300776	帝尔激光	1,100	236,456.00	0.02
116	688582	芯动联科	3,314	215,410.00	0.02
117	688515	裕太微	843	209,704.68	0.02
118	688820	盛合晶微	1,414	200,066.86	0.02
119	601898	中煤能源	15,400	187,572.00	0.02
120	601838	成都银行	10,500	185,850.00	0.02
121	002734	利民股份	10,800	185,436.00	0.02
122	603268	松发股份	1,300	181,064.00	0.02
123	600007	中国国贸	9,400	178,412.00	0.02
124	688411	海博思创	600	174,720.00	0.02
125	603317	天味食品	13,400	174,334.00	0.02
126	688196	卓越新能	4,605	165,319.50	0.02
127	601083	锦江航运	14,500	144,130.00	0.01
128	300373	扬杰科技	900	141,507.00	0.01
129	001399	惠科股份	4,866	134,934.18	0.01
130	603355	莱克电气	5,100	134,538.00	0.01
131	002152	广电运通	14,100	132,258.00	0.01
132	688677	海泰新光	1,298	131,266.74	0.01
133	688790	昂瑞微	986	124,679.70	0.01
134	600057	厦门象屿	22,600	122,492.00	0.01
135	600863	华能蒙电	24,900	117,030.00	0.01
136	688052	纳芯微	400	115,324.00	0.01
137	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.01
138	688049	炬芯科技	2,354	110,426.14	0.01

139	600590	泰豪科技	10,700	108,070.00	0.01
140	300682	朗新科技	10,900	107,910.00	0.01
141	300953	震裕科技	800	106,960.00	0.01
142	688818	电科蓝天	1,469	103,035.66	0.01
143	002706	良信股份	9,400	102,554.00	0.01
144	601512	中新集团	13,000	101,400.00	0.01
145	605056	咸亨国际	6,300	100,800.00	0.01
146	605305	中际联合	2,400	100,608.00	0.01
147	600391	航发科技	3,000	100,350.00	0.01
148	300113	顺网科技	5,500	100,155.00	0.01
149	002488	金固股份	11,100	98,901.00	0.01
150	301275	汉朔科技	2,200	98,780.00	0.01
151	002240	盛新锂能	2,200	98,626.00	0.01
152	603162	海通发展	10,988	98,562.36	0.01
153	300005	探路者	4,300	97,180.00	0.01
154	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.01
155	605168	三人行	1,900	96,216.00	0.01
156	688249	晶合集成	1,599	94,388.97	0.01
157	301216	万凯新材	4,100	94,259.00	0.01
158	601998	中信银行	13,500	93,555.00	0.01
159	002701	奥瑞金	19,500	83,070.00	0.01
160	301338	凯格精机	500	81,445.00	0.01
161	601966	玲珑轮胎	7,900	80,501.00	0.01
162	002154	报喜鸟	21,900	77,964.00	0.01
163	601666	平煤股份	10,600	75,790.00	0.01
164	688234	天岳先进	400	69,404.00	0.01
165	688809	强一股份	107	66,661.00	0.01
166	600809	山西汾酒	600	65,622.00	0.01
167	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.01
168	603256	宏和科技	200	53,066.00	0.00
169	300035	中科电气	3,400	49,028.00	0.00
170	688690	纳微科技	1,108	48,862.80	0.00
171	002791	坚朗五金	3,700	48,470.00	0.00
172	001203	大中矿业	1,600	47,920.00	0.00
173	600012	皖通高速	3,000	47,280.00	0.00
174	601231	环旭电子	1,400	45,360.00	0.00
175	002545	东方铁塔	2,700	43,794.00	0.00
176	605333	沪光股份	2,500	42,625.00	0.00
177	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
178	603402	陕西旅游	650	38,447.50	0.00
179	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00

180	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
181	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
182	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
183	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
184	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
185	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
186	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
187	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
188	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
189	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
190	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
191	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
192	601112	振石股份	455	8,003.45	0.00
193	001369	双欣材料	587	7,936.24	0.00
194	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
195	601226	华电科工	1,000	6,360.00	0.00
196	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
197	601377	兴业证券	500	3,020.00	0.00
198	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
199	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
200	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
201	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
202	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	44,114,674.00	9.18
2	300750	宁德时代	40,197,704.80	8.36
3	603259	药明康德	35,569,866.60	7.40
4	600150	中国船舶	30,768,364.49	6.40
5	300502	新易盛	29,572,955.06	6.15
6	000333	美的集团	28,866,638.00	6.01
7	600030	中信证券	27,669,256.00	5.76
8	600519	贵州茅台	27,525,490.00	5.73
9	002475	立讯精密	25,125,482.90	5.23
10	601899	紫金矿业	24,833,865.00	5.17
11	688256	寒武纪	24,494,319.29	5.10
12	603993	洛阳钼业	22,783,251.00	4.74

13	300274	阳光电源	21,120,472.00	4.39
14	002558	巨人网络	20,823,286.00	4.33
15	600418	江淮汽车	19,649,802.00	4.09
16	002414	高德红外	19,421,732.00	4.04
17	000792	盐湖股份	19,007,066.00	3.95
18	002384	东山精密	18,582,878.00	3.87
19	002463	沪电股份	18,346,368.00	3.82
20	688002	睿创微纳	18,193,201.63	3.79
21	688981	中芯国际	17,774,354.14	3.70
22	002028	思源电气	17,611,536.00	3.66
23	300014	亿纬锂能	17,552,742.40	3.65
24	600938	中国海油	17,482,955.77	3.64
25	603019	中科曙光	17,133,478.00	3.56
26	002415	海康威视	16,534,315.00	3.44
27	600989	宝丰能源	15,821,428.00	3.29
28	002371	北方华创	15,748,619.00	3.28
29	000338	潍柴动力	15,104,553.00	3.14
30	002266	浙富控股	14,930,543.11	3.11
31	600741	华域汽车	14,853,120.00	3.09
32	601398	工商银行	14,763,187.00	3.07
33	688008	澜起科技	14,737,886.92	3.07
34	603986	兆易创新	14,666,259.00	3.05
35	002738	中矿资源	14,648,962.00	3.05
36	300408	三环集团	14,543,115.61	3.03
37	000975	山金国际	14,482,155.00	3.01
38	002460	赣锋锂业	14,461,401.00	3.01
39	600887	伊利股份	14,399,941.00	3.00
40	603799	华友钴业	14,370,607.99	2.99
41	600584	长电科技	14,101,459.00	2.93
42	600183	生益科技	13,916,752.33	2.90
43	601318	中国平安	13,645,112.00	2.84
44	600026	中远海能	13,598,007.52	2.83
45	002156	通富微电	13,565,239.00	2.82
46	000063	中兴通讯	13,538,109.00	2.82
47	000408	藏格矿业	13,454,163.00	2.80
48	000651	格力电器	13,387,577.00	2.79
49	600000	浦发银行	13,326,765.00	2.77
50	688111	金山办公	13,326,216.02	2.77
51	000426	兴业银锡	13,270,426.00	2.76
52	300207	欣旺达	13,142,606.00	2.73
53	600323	瀚蓝环境	12,941,056.00	2.69

54	688012	中微公司	12,801,864.30	2.66
55	600039	四川路桥	12,707,895.00	2.64
56	300476	胜宏科技	12,490,132.00	2.60
57	601088	中国神华	12,396,722.00	2.58
58	601615	明阳智能	12,165,983.00	2.53
59	603486	科沃斯	12,053,608.00	2.51
60	600309	万华化学	11,963,520.00	2.49
61	600362	江西铜业	11,963,224.00	2.49
62	600900	长江电力	11,933,681.00	2.48
63	300433	蓝思科技	11,756,417.00	2.45
64	002271	东方雨虹	11,721,041.00	2.44
65	300058	蓝色光标	11,643,905.00	2.42
66	000977	浪潮信息	11,607,376.00	2.42
67	600522	中天科技	11,217,671.00	2.33
68	601127	赛力斯	11,211,255.00	2.33
69	601166	兴业银行	11,173,404.00	2.32
70	000807	云铝股份	11,171,882.00	2.32
71	688041	海光信息	11,165,382.33	2.32
72	600176	中国巨石	11,113,578.00	2.31
73	603659	璞泰来	11,078,588.00	2.31
74	601677	明泰铝业	10,890,832.00	2.27
75	002517	恺英网络	10,888,409.00	2.27
76	600487	亨通光电	10,848,337.00	2.26
77	601225	陕西煤业	10,700,711.00	2.23
78	300438	鹏辉能源	10,681,037.00	2.22
79	688213	思特威	10,625,852.42	2.21
80	300394	天孚通信	10,545,911.00	2.19
81	601328	交通银行	10,533,267.00	2.19
82	300001	特锐德	10,429,708.00	2.17
83	300073	当升科技	10,265,907.00	2.14
84	002841	视源股份	10,190,924.00	2.12
85	002001	新 和 成	10,071,040.00	2.10
86	300803	指南针	10,056,343.00	2.09
87	601601	中国太保	10,038,784.00	2.09
88	300124	汇川技术	9,890,121.00	2.06
89	601872	招商轮船	9,878,888.00	2.06
90	600879	航天电子	9,865,565.00	2.05
91	000100	TCL 科技	9,848,179.00	2.05
92	600031	三一重工	9,640,762.00	2.01
93	300136	信维通信	9,614,789.41	2.00

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	27,650,588.00	5.75
2	300750	宁德时代	27,071,150.32	5.63
3	300502	新易盛	26,572,563.25	5.53
4	002475	立讯精密	24,675,837.00	5.13
5	000333	美的集团	23,653,684.00	4.92
6	002463	沪电股份	22,474,331.00	4.68
7	300274	阳光电源	22,257,562.00	4.63
8	688256	寒武纪	22,248,561.14	4.63
9	603259	药明康德	21,962,314.00	4.57
10	600030	中信证券	20,662,749.10	4.30
11	603993	洛阳钼业	19,841,077.00	4.13
12	600519	贵州茅台	18,998,460.00	3.95
13	603019	中科曙光	18,674,294.00	3.89
14	600150	中国船舶	18,645,185.35	3.88
15	600584	长电科技	16,895,018.05	3.52
16	002558	巨人网络	16,605,431.00	3.45
17	600183	生益科技	15,987,707.00	3.33
18	002028	思源电气	15,647,496.00	3.26
19	300408	三环集团	15,565,915.00	3.24
20	601899	紫金矿业	14,886,632.00	3.10
21	000063	中兴通讯	14,820,458.00	3.08
22	600176	中国巨石	14,534,420.00	3.02
23	601318	中国平安	14,060,421.00	2.93
24	300014	亿纬锂能	14,022,057.00	2.92
25	002371	北方华创	13,730,220.00	2.86
26	603486	科沃斯	13,438,458.77	2.80
27	600000	浦发银行	13,424,417.50	2.79
28	000977	浪潮信息	13,380,892.00	2.78
29	002460	赣锋锂业	13,012,227.80	2.71
30	688213	思特威	12,861,488.74	2.68
31	300058	蓝色光标	12,856,434.00	2.67
32	002414	高德红外	12,835,909.08	2.67
33	002384	东山精密	12,783,598.00	2.66
34	000338	潍柴动力	12,686,569.00	2.64
35	002916	深南电路	12,668,671.00	2.64
36	600362	江西铜业	12,628,648.00	2.63
37	601615	明阳智能	12,575,131.00	2.62

38	300476	胜宏科技	12, 557, 604. 00	2. 61
39	601088	中国神华	12, 302, 062. 00	2. 56
40	300207	欣旺达	12, 276, 364. 00	2. 55
41	600887	伊利股份	12, 238, 484. 00	2. 55
42	600741	华域汽车	11, 967, 758. 00	2. 49
43	600039	四川路桥	11, 834, 307. 00	2. 46
44	688002	睿创微纳	11, 768, 624. 54	2. 45
45	600938	中国海油	11, 759, 036. 00	2. 45
46	000408	藏格矿业	11, 688, 853. 00	2. 43
47	002001	新 和 成	11, 660, 862. 00	2. 43
48	600988	赤峰黄金	11, 648, 711. 00	2. 42
49	603659	璞泰来	11, 645, 336. 00	2. 42
50	600352	浙江龙盛	11, 637, 839. 00	2. 42
51	002156	通富微电	11, 624, 044. 00	2. 42
52	688008	澜起科技	11, 620, 751. 78	2. 42
53	601398	工商银行	11, 566, 957. 00	2. 41
54	000792	盐湖股份	11, 395, 681. 00	2. 37
55	300433	蓝思科技	11, 293, 771. 00	2. 35
56	600989	宝丰能源	11, 238, 727. 00	2. 34
57	002415	海康威视	11, 232, 165. 00	2. 34
58	000100	TCL 科技	11, 076, 259. 00	2. 30
59	300001	特锐德	11, 067, 706. 00	2. 30
60	600031	三一重工	11, 040, 161. 00	2. 30
61	600879	航天电子	10, 957, 822. 00	2. 28
62	300394	天孚通信	10, 904, 712. 00	2. 27
63	000426	兴业银锡	10, 742, 892. 00	2. 24
64	600276	恒瑞医药	10, 708, 547. 00	2. 23
65	688981	中芯国际	10, 669, 645. 82	2. 22
66	600118	中国卫星	10, 536, 873. 00	2. 19
67	603986	兆易创新	10, 511, 741. 00	2. 19
68	300033	同花顺	10, 474, 980. 20	2. 18
69	601677	明泰铝业	10, 471, 083. 00	2. 18
70	600323	瀚蓝环境	10, 372, 048. 00	2. 16
71	300450	先导智能	10, 122, 224. 00	2. 11
72	600418	江淮汽车	9, 912, 886. 00	2. 06
73	000708	中信特钢	9, 883, 723. 00	2. 06
74	002466	天齐锂业	9, 873, 038. 80	2. 05
75	601225	陕西煤业	9, 724, 139. 00	2. 02
76	300628	亿联网络	9, 688, 104. 00	2. 02
77	300124	汇川技术	9, 669, 963. 00	2. 01
78	300438	鹏辉能源	9, 646, 806. 00	2. 01

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,592,865,257.89
卖出股票收入（成交）总额	3,118,324,527.58

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”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 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	44,549,233.48	4.19
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	29,001.33	0.00
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	44,578,234.81	4.19

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019827	26 国债 01	326,000	32,811,310.52	3.09
2	019785	25 国债 13	76,000	7,695,953.64	0.72
3	019792	25 国债 19	40,000	4,041,969.32	0.38
4	113704	春风转债	290	29,001.33	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低交易成本，提高投资效率，从而更好地实现投资目标。

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的原则，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场定性和定量的分析，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,430,115.20
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	16,636,441.39
6	其他应收款	—

7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	19,066,556.59

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未持有流通受限的股票。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中未持有流通受限股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
富国中证 A500 指数增强 A	21,055	18,031.26	72,540,110.34	19.11	307,107,988.36	80.89
富国中证 A500 指数增强 C	28,263	12,912.67	27,199,392.28	7.45	337,751,337.38	92.55
合计	49,318	15,097.91	99,739,502.62	13.40	644,859,325.74	86.60

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	富国中证 A500 指数增强 A	875,447.47	0.2306
	富国中证 A500 指数增强 C	1,223.08	0.0003
	合计	876,670.55	0.1177

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	富国中证 A500 指数增强 A	0
	富国中证 A500 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	富国中证 A500 指数增强 A	50~100
	富国中证 A500 指数增强 C	0
	合计	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	富国中证 A500 指数增强 A	富国中证 A500 指数增强 C
基金合同生效日（2025 年 01 月 23 日）基金份额总额	291,085,194.60	459,075,983.70
本报告期期初基金份额总额	171,788,882.20	209,305,250.91
本报告期基金总申购份额	848,263,174.63	688,563,620.51
减：本报告期基金总赎回份额	640,403,958.13	532,918,141.76
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	379,648,098.70	364,950,729.66

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有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，本基金基金管理人于 2026 年 6 月 27 日发布公告，王苏龙先生自 2026 年 6 月 26 日起担任公司董事长，同日起裴长江先生不再担任公司董事长。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

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，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本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

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

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

注：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

注：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

注：本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

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 (%)	
华泰证券	3	1,547,507,628.08	23.07	210,321.69	23.07	—
华西证券	3	784,946,971.59	11.70	106,675.26	11.70	—
中金财富	3	4,375,957,835.05	65.23	594,746.37	65.23	—

注：我公司对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。本报告期内本基金租用券商交易单元无变更。

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	
	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 (%)
华泰证券	15,054.65	0.04	—	—	—	—
华西证券	10,001.40	0.03	—	—	—	—
中金财富	37,645,255.81	99.93	508,194,000.00	100.00	—	—

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2026年01月09日

2	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2026 年 02 月 04 日
3	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2026 年 03 月 19 日
4	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2026 年 03 月 19 日
5	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2026 年 04 月 01 日
6	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2026 年 04 月 09 日
7	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2026 年 04 月 23 日
8	富国基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	规定披露媒介	2026 年 06 月 27 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期无单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，经基金管理人董事会第七届十四次会议审议通过，王苏龙先生自 2026 年 6 月 26 日起担任公司董事长，同日起裴长江先生不再担任公司董事长。具体可参见基金管理人于 2026 年 6 月 27 日发布的《富国基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

§ 12 备查文件目录

备查文件名称	备查文件存放地点	备查文件查阅方式
1、中国证监会批准设立富国中证 A500 指数增强型证券投资基金的文件 2、富国中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同 3、富国中证 A500 指数增强型证券投资基金托管协议 4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件 5、富国中证 A500 指数增强型证券投资基金财务报表及报表附注 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费）公司网址： http://www.fullgoal.com.cn 。