

富国中证高端制造指数增强型证券投资基金（LOF）

二〇二六年中期报告

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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	12
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	13
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	14
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	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
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.....	58
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.....	58
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.....	58
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.....	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.12 投资组合报告附注	59
§ 8 基金份额持有人信息	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
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.....	61
§ 9 开放式基金份额变动	62
§ 10 重大事件揭示	63
10.1 基金份额持有人大会决议	63
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.....	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
10.4 基金投资策略的改变	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	63
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.....	64
10.8 其他重大事件	66
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	68
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	68
§ 12 备查文件目录	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国中证高端制造指数增强型证券投资基金（LOF）	
基金简称	富国中证高端制造指数增强型（LOF）	
场内简称	高端制造 LOF	
基金主代码	161037	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 04 月 27 日	
基金管理人	富国基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	85,266,263.53 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2017 年 5 月 11 日	
下属分级基金的基金简称	富国中证高端制造指数增强型（LOF）A	富国中证高端制造指数增强型（LOF）C
下属分级基金场内简称	高端制造 LOF	—
下属分级基金的交易代码	161037	005627
报告期末下属分级基金的份额总额	45,477,848.94 份	39,788,414.59 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，在力求对中证高端制造主题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”，主要策略为优化复制目标指数，即投资组合将以目标指数中的基准权重为基础，利用富国定量投资模型在有限范围内权重优化，进行一定比例的超配或低配，严格控制组合跟踪误差，在复制目标指数的基础上一定程度优化个股权重，力求投资收益能够跟踪并适度超越目标指数。本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8%。本基金选股范围以指数成份股为主，并包括非成份股中与成份股相关性强、流动性好、基本面信息充足的股票。本基金的股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、金融衍生工具投资策略、参与转融通证券出借业务策略详见法律文件。
业绩比较基准	95%×中证高端制造主题指数收益率+5%×银行人民币活期存款利率（税后）
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，属于较高预期收益和预期风险水平的投资品种。

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	中国建设银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	赵瑛	王小飞
	联系电话	021-20361818	021-6063 7103
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		95105686、4008880688	021-60637228
传真		021-20361616	021-60635778
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	北京市西城区金融大街 25 号
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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		陈戈	张金良

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 中国建设银行股份有限公司 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	A 类：中国证券登记结算有限责任公司； C 类：富国基金管理有限公司	北京市西城区太平桥大街 17 号；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) 富国中证高端制造指数增强型 (LOF) 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	25,011,355.21
本期利润	38,392,960.18
加权平均基金份额本期利润	0.8813
本期加权平均净值利润率	32.51%
本期基金份额净值增长率	36.55%
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	73,419,085.03
期末可供分配基金份额利润	1.6144
期末基金资产净值	148,985,301.05
期末基金份额净值	3.2760
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	227.60%

(2) 富国中证高端制造指数增强型 (LOF) 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	21,240,926.16
本期利润	32,528,344.22
加权平均基金份额本期利润	0.8634
本期加权平均净值利润率	32.15%
本期基金份额净值增长率	36.42%
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	63,260,073.72
期末可供分配基金份额利润	1.5899
期末基金资产净值	129,187,647.80
期末基金份额净值	3.2469
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	55.48%

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) 富国中证高端制造指数增强型（LOF）A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	35.29%	1.79%	38.86%	1.91%	-3.57%	-0.12%
过去六个月	36.55%	1.61%	37.50%	1.72%	-0.95%	-0.11%
过去一年	82.03%	1.46%	83.82%	1.59%	-1.79%	-0.13%
过去三年	90.16%	1.51%	79.30%	1.57%	10.86%	-0.06%
过去五年	46.10%	1.46%	35.72%	1.49%	10.38%	-0.03%
过去七年	224.42%	1.50%	145.39%	1.51%	79.03%	-0.01%
自基金合同生效起至今	227.60%	1.48%	106.44%	1.48%	121.16%	0.00%

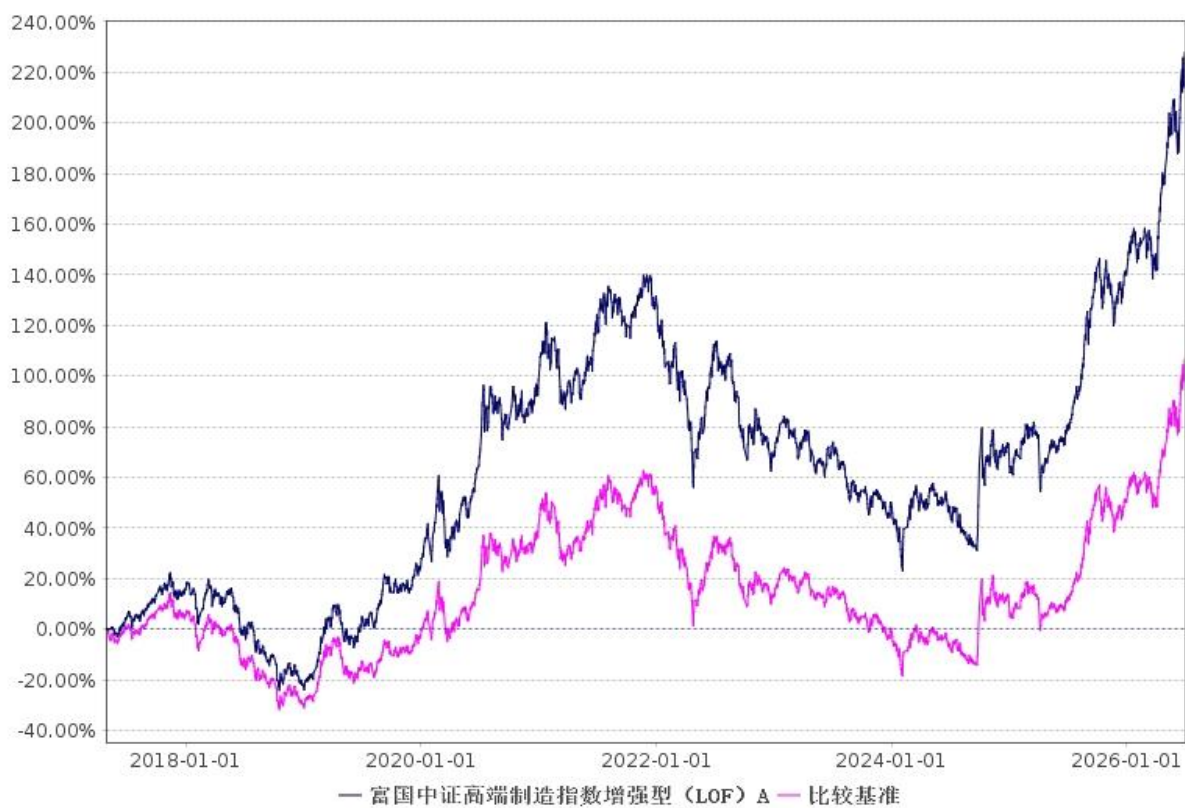
(2) 富国中证高端制造指数增强型（LOF）C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	35.23%	1.79%	38.86%	1.91%	-3.63%	-0.12%
过去六个月	36.42%	1.61%	37.50%	1.72%	-1.08%	-0.11%
过去一年	81.67%	1.46%	83.82%	1.59%	-2.15%	-0.13%
过去三年	89.04%	1.51%	79.30%	1.57%	9.74%	-0.06%
自基金分级生效日起至今	55.48%	1.49%	46.60%	1.52%	8.88%	-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) 富国中证高端制造指数增强型（LOF）A



注：1、截止日期为 2026 年 6 月 30 日。

(2) 富国中证高端制造指数增强型 (LOF) C



注：1、截止日期为 2026 年 6 月 30 日。

2、本基金自 2022 年 1 月 25 日起增加 C 类份额，相关数据按实际存续期计算。

§ 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		
牛志冬	本基金现任基金经理	2017-07-25	—	19	硕士，曾任华夏基金管理有限公司研究员；自 2010 年 8 月加入富国基金管理有限公司，历任量化投资基金经理助理、投资经理、量化与海外投资部量化投资总监助理兼基金经理、定量基金经理、量化投资部量化投资副总监；现任富国基金量化投资部量化投资副总监

					兼高级定量基金经理。自 2015 年 05 月起任富国中证新能源汽车指数型证券投资基金(原富国中证新能源汽车指数分级证券投资基金)基金经理；自 2015 年 05 月起任富国中证移动互联网指数型证券投资基金(原富国中证移动互联网指数分级证券投资基金)基金经理；自 2016 年 11 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 2017 年 03 月起任富国中证娱乐主题指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理；自 2017 年 07 月起任富国中证高端制造指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理；自 2019 年 07 月起任富国中证军工龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2022 年 01 月起任富国中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2023 年 03 月起任富国创业板增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2024 年 07 月起任富国创业板增强策略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 07 月起任富国中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2026 年 01 月起任富国中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2026 年 04 月起任富国中证科创创业人工智能交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2026 年 04 月起任富国中证全指食品交易型开放式指数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高端制造指数增强型证券投资基金(LOF)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

中证高端制造指数增强型证券投资基金（LOF）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9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。

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高端制造指数增强型（LOF）A 为 3.2760 元，富国中证高端制造指数增强型（LOF）C 为 3.2469 元；份额累计净值富国中证高端制造指数增强型（LOF）A 为 3.2760 元，富国中证高端制造指数增强型（LOF）C 为 3.2469 元；本报告期内，本基金份额净值增长率情况：富国中证高端制造指数增强型（LOF）A 为 36.55%，富国中证高端制造指数增强型（LOF）C 为 36.42%；同期业绩比较基准收益率情况：富国中证高端制造指数增强型（LOF）A 为 37.50%，富国中证高端制造指数增强型（LOF）C 为 37.50%。

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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 半年度财务报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：富国中证高端制造指数增强型证券投资基金（LOF）

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	20,003,516.94	15,580,600.26
结算备付金	997,951.29	478,510.51
存出保证金	26,517.14	24,988.52
交易性金融资产	265,242,792.24	178,531,376.96
其中：股票投资	261,796,320.91	178,329,357.67
基金投资	—	—
债券投资	3,446,471.33	202,019.29
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	1,109,542.66	353,259.24
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	287,380,320.27	194,968,735.49
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	—	—
应付清算款	6,421,433.66	2,421,381.53
应付赎回款	2,263,849.06	2,620,620.16
应付管理人报酬	251,428.01	191,143.68
应付托管费	41,904.69	31,857.27
应付销售服务费	19,218.99	13,865.38
应付投资顾问费	—	—
应交税费	118.79	—

应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	209,418.22	218,499.20
负债合计	9,207,371.42	5,497,367.22
净资产：		
实收基金	85,266,263.53	79,261,628.38
未分配利润	192,906,685.32	110,209,739.89
净资产合计	278,172,948.85	189,471,368.27
负债和净资产总计	287,380,320.27	194,968,735.49

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 3.2624 元，基金份额总额 85,266,263.53 份。其中：富国中证高端制造指数增强型（LOF）A 份额净值 3.2760 元，份额总额 45,477,848.94 份；富国中证高端制造指数增强型（LOF）C 份额净值 3.2469 元，份额总额 39,788,414.59 份。

6.2 利润表

会计主体：富国中证高端制造指数增强型证券投资基金（LOF）

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 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日)
一、营业总收入	72,613,982.49	8,276,057.20
1. 利息收入	21,230.09	14,209.54
其中：存款利息收入	21,230.09	14,209.54
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）	47,811,847.88	8,923,891.93
其中：股票投资收益	46,449,901.87	7,937,874.62
基金投资收益	—	—
债券投资收益	41,029.89	1,076.51
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具收益	—	—
股利收益	1,320,916.12	984,940.80
其他投资收益	—	—
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	24,669,023.03	-701,483.47
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	111,881.49	39,439.20
减：二、营业总支出	1,692,678.09	956,318.81
1. 管理人报酬	1,298,635.10	733,057.55

2. 托管费	216,439.23	122,176.24
3. 销售服务费	99,887.11	18,642.10
4. 投资顾问费	—	—
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 信用减值损失	—	—
7. 税金及附加	41.03	—
8. 其他费用	77,675.62	82,442.92
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	70,921,304.40	7,319,738.39
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	70,921,304.40	7,319,738.39
五、其他综合收益的税后净额	—	—
六、综合收益总额	70,921,304.40	7,319,738.39

6.3 净资产变动表

会计主体：富国中证高端制造指数增强型证券投资基金（LOF）

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	79,261,628.38	110,209,739.89	189,471,368.27
二、本期期初净资产	79,261,628.38	110,209,739.89	189,471,368.27
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	6,004,635.15	82,696,945.43	88,701,580.58
（一）、综合收益总额	—	70,921,304.40	70,921,304.40
（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）	6,004,635.15	11,775,641.03	17,780,276.18
其中：1. 基金申购款	48,069,867.99	84,526,365.33	132,596,233.32
2. 基金赎回款	-42,065,232.84	-72,750,724.30	-114,815,957.14
（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	85,266,263.53	192,906,685.32	278,172,948.85
项目	上年度可比期间 (2025年01月01日至2025年06月30日)		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	74,709,983.60	51,846,169.62	126,556,153.22
二、本期期初净资产	74,709,983.60	51,846,169.62	126,556,153.22
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-8,240,616.84	1,190,101.42	-7,050,515.42
（一）、综合收益总额	—	7,319,738.39	7,319,738.39
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净	-8,240,616.84	-6,129,636.97	-14,370,253.81

资产减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	16,390,876.17	11,814,276.94	28,205,153.11
2. 基金赎回款	-24,631,493.01	-17,943,913.91	-42,575,406.92
(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	66,469,366.76	53,036,271.04	119,505,637.80

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

富国中证高端制造指数增强型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2016]2731号《关于准予富国中证高端制造指数增强型证券投资基金（LOF）注册的批复》的核准，由基金管理人富国基金管理有限公司向社会公开发行人募集，基金合同于 2017 年 4 月 27 日生效，首次设立募集规模为 281,495,289.54 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。根据基金管理人于 2022 年 1 月 21 日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下部分基金增加 C 类基金份额并相应修订基金合同及托管协议的公告》，自 2022 年 1 月 25 日起，本基金增加 C 类份额。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，A 类基金份额的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，C 类基金份额的注册登记机构为富国基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证高端制造主题指数的成份股、备选成份股（均含存托凭证）、其他股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票，包括一级市场首次发行或增发）、存托凭证、固定收益资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、公募可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、质押及买断式回购、银行存款（包括银行定期存款、银行协议存款、银行通知存款等）等）、衍生工具（股指期货、权证等）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）。

本基金将按照法律法规相关规定参与融资与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：本基金的股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中证高端制造主题指数成份股和备选成份股（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。

本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证高端制造主题指数收益率} + 5\% \times \text{银行人民币活期存款利率（税后）}$ 。

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。

6.4.7 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	20,003,516.94
等于：本金	20,002,265.65

加：应计利息	1,251.29
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	20,003,516.94

注：本基金本报告期末未持有定期存款。

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		219,935,952.56	—	261,796,320.91	41,860,368.35
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	3,416,070.00	32,031.33	3,446,471.33	-1,630.00
	银行间市场	—	—	—	—
	合计	3,416,070.00	32,031.33	3,446,471.33	-1,630.00
资产支持证券		—	—	—	—
基金		—	—	—	—
其他		—	—	—	—
合计		223,352,022.56	32,031.33	265,242,792.24	41,858,738.35

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

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	5,372.49
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	94,681.52
其中：交易所市场	94,681.52
银行间市场	—
应付利息	—
预提信息披露费	60,000.00
预提审计费	49,364.21
合计	209,418.22

6.4.7.7 实收基金

富国中证高端制造指数增强型（LOF）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	43,200,064.78	43,200,064.78
本期申购	26,867,199.43	26,867,199.43
本期赎回（以“-”号填列）	-24,589,415.27	-24,589,415.27
本期末	45,477,848.94	45,477,848.94

富国中证高端制造指数增强型（LOF）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	36,061,563.60	36,061,563.60
本期申购	21,202,668.56	21,202,668.56
本期赎回（以“-”号填列）	-17,475,817.57	-17,475,817.57
本期末	39,788,414.59	39,788,414.59

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

富国中证高端制造指数增强型（LOF）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	45,128,546.86	15,312,084.99	60,440,631.85
本期期初	45,128,546.86	15,312,084.99	60,440,631.85
本期利润	25,011,355.21	13,381,604.97	38,392,960.18
本期基金份额交易产生的变动数	3,279,182.96	1,394,677.12	4,673,860.08
其中：基金申购款	35,184,591.52	12,134,322.97	47,318,914.49
基金赎回款	-31,905,408.56	-10,739,645.85	-42,645,054.41
本期已分配利润	—	—	—
本期末	73,419,085.03	30,088,367.08	103,507,452.11

富国中证高端制造指数增强型（LOF）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	37,058,632.82	12,710,475.22	49,769,108.04
本期期初	37,058,632.82	12,710,475.22	49,769,108.04
本期利润	21,240,926.16	11,287,418.06	32,528,344.22
本期基金份额交易产生的变动数	4,960,514.74	2,141,266.21	7,101,780.95
其中：基金申购款	27,734,231.31	9,473,219.53	37,207,450.84
基金赎回款	-22,773,716.57	-7,331,953.32	-30,105,669.89
本期已分配利润	—	—	—
本期末	63,260,073.72	26,139,159.49	89,399,233.21

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	19,490.86
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	1,124.49
其他	614.74
合计	21,230.09

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	568,666,757.91
减：卖出股票成本总额	521,702,896.96
减：交易费用	513,959.08

买卖股票差价收入	46,449,901.87
----------	---------------

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	12,202.07
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	28,827.82
合计	41,029.89

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	261,058.63
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	229,482.00
减：应计利息总额	2,746.47
减：交易费用	2.34
买卖债券差价收入	28,827.82

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

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

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	1,320,916.12
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	1,320,916.12

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	24,669,023.03
股票投资	24,670,631.03
债券投资	-1,608.00
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	—
合计	24,669,023.03

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	104,427.27
基金转换费收入	7,454.22
合计	111,881.49

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	16,364.21
信息披露费	60,000.00

证券出借违约金	—
银行费用	1,311.41
合计	77,675.62

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
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	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

金额单位：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01月01日至2025年06月30日）	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
国泰海通	45,720,787.23	3.98	23,206,400.65	4.51
申万宏源	21,449,191.97	1.87	54,934,115.00	10.67

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）		上年度可比期间（2025年01月01日至 2025年06月30日）	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
申万宏源	—	—	8,475.50	100.00

注：本基金本报告期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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2026年01月01日至2026年06月30日）			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
国泰海通	6,213.76	3.98	3,889.79	4.11
申万宏源	2,914.96	1.87	2,851.51	3.01
关联方名称	上年度可比期间（2025年01月01日至2025年06月30日）			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
国泰海通	3,153.42	4.51	3,153.42	9.06
申万宏源	7,465.60	10.67	4,416.36	12.68

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.2 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 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）
当期发生的基金应支付的管理费	1,298,635.10	733,057.55
其中：应支付销售机构的客户维护费	348,943.83	249,310.51
应支付基金管理人的净管理费	949,691.27	483,747.04

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% / \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，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 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）
当期发生的基金应支付的托管费	216,439.23	122,176.24

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

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		
	富国中证高端制造指数增强型（LOF）A	富国中证高端制造指数增强型（LOF）C	合计
富国基金管理有限公司	—	68,754.93	68,754.93
国泰海通证券股份有限公司	—	18.50	18.50
合计	—	68,773.43	68,773.43

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 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

	富国中证高端制造指数增强型（LOF）A	富国中证高端制造指数增强型（LOF）C	合计
富国基金管理有限公司	—	2,041.42	2,041.42
合计	—	2,041.42	2,041.42

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将专门用于本基金 C 类基金份额的销售与基金份额持有人服务。

在通常情况下，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.20% 年费率计提。销售服务费计算方法如下：

$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 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01月01日至2025年06月30日）	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	20,003,516.94	19,490.86	7,038,944.98	13,215.05

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	2,536	35,275.76
国泰海通证券股份有限公司	301666	大普微	IPO 网下申购	762	35,112.96
国泰海通证券股份有限公司	301696	三瑞智能	IPO 网下申购	1,294	31,935.92
国泰海通证券股份有限公司	688635	长进光子	IPO 网下申购	978	40,078.44
国泰海通证券股份有限公司	688781	视涯科技	IPO 网下申购	2,854	64,728.72
国泰海通证券股份有限公司	688818	电科蓝天	IPO 网下申购	5,702	53,997.94
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	635	44,234.10
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	639	13,981.32

金额单位：人民币元

上年度可比期间（2025年01月01日至2025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	301658	首航新能	IPO 网下申购	3,087	36,426.60
申万宏源证券承销保荐有限责任公司	301479	弘景光电	IPO 网下申购	717	30,042.30

申万宏源证券承销保荐 有限责任公司	301601	惠通科技	IPO 网下申购	3,055	36,049.00
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	768	25,390.08

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：本基金本报告期末进行利润分配。

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	48	1,344.00	1,333.44	—
001237	惠康科技	2026-05-15	6 个月	新股限售	53.26	58.74	86	4,580.36	5,051.64	—
001248	华润新能 源	2026-06-24	6 个月	新股限售	10.11	10.11	7,810	78,959.10	78,959.10	—
001248	华润新能 源	2026-06-24	1 个月内 （含）	新股认购	10.11	10.11	3,347	33,838.17	33,838.17	—
001257	盛龙股份	2026-03-24	6 个月	新股限售	7.82	20.74	816	6,381.12	16,923.84	—
001312	福恩股份	2026-04-14	6 个月	新股限售	18.38	16.78	76	1,396.88	1,275.28	—
001365	天海电子	2026-05-11	6 个月	新股限售	27.19	31.31	213	5,791.47	6,669.03	—
001393	维通利	2026-05-08	6 个月	新股限售	30.38	38.99	150	4,557.00	5,848.50	—
001399	惠科股份	2026-06-16	6 个月	新股限售	10.12	27.73	1,317	13,328.04	36,520.41	—
301513	尚水智能	2026-04-10	6 个月	新股限售	26.66	50.96	136	3,625.76	6,930.56	—
301531	春光集团	2026-04-	6 个月	新股限售	13.30	51.56	232	3,085.60	11,961.92	—

		28								
301599	理奇智能	2026-04-22	6 个月	新股限售	13.91	32.47	254	3,533.14	8,247.38	—
301666	大普微	2026-04-08	6 个月	新股限售	46.08	463.33	305	14,054.40	141,315.65	—
301680	固德电材	2026-02-27	6 个月	新股限售	58.00	112.16	64	3,712.00	7,178.24	—
301682	宏明电子	2026-03-18	6 个月	新股限售	69.66	160.06	191	13,305.06	30,571.46	—
301683	慧谷新材	2026-03-24	6 个月	新股限售	78.38	121.77	44	3,448.72	5,357.88	—
301687	新广益	2025-12-24	6 个月	新股限售	21.93	77.78	146	3,201.78	11,355.88	—
301696	三瑞智能	2026-03-31	6 个月	新股限售	24.68	86.80	130	3,208.40	11,284.00	—
601112	振石股份	2026-01-21	6 个月	新股限售	11.18	17.59	188	2,101.84	3,306.92	—
603284	林平发展	2026-02-03	6 个月	新股限售	37.88	34.87	39	1,477.32	1,359.93	—
603293	埃泰克	2026-04-09	6 个月	新股限售	33.49	33.93	35	1,172.15	1,187.55	—
603352	至信股份	2026-01-08	6 个月	新股限售	21.88	25.52	64	1,400.32	1,633.28	—
603407	长裕集团	2026-04-29	6 个月	新股限售	13.86	73.46	135	1,871.10	9,917.10	—
603435	嘉德利	2026-05-15	6 个月	新股限售	15.76	46.71	94	1,481.44	4,390.74	—
603459	红板科技	2026-03-31	6 个月	新股限售	17.70	84.32	131	2,318.70	11,045.92	—
688635	长进光子	2026-05-20	6 个月	新股限售	40.98	308.19	98	4,016.04	30,202.62	—
688781	视涯科技	2026-03-18	9 个月	新股限售	22.68	42.16	1,856	42,094.08	78,248.96	—
688783	西安奕材	2025-10-20	9 个月	新股限售	8.62	57.42	8,094	69,770.28	464,757.48	—
688785	恒运昌	2026-01-20	6 个月	新股限售	92.18	463.15	49	4,516.82	22,694.35	—
688790	昂瑞微	2025-12-09	9 个月	新股限售	83.06	126.45	551	45,766.06	69,673.95	—
688795	摩尔线程	2025-11-26	9 个月	新股限售	114.28	676.94	689	78,738.92	466,411.66	—
688797	臻宝科技	2026-06-	6 个月	新股限售	44.56	468.67	99	4,411.44	46,398.33	—

		16								
688802	沐曦股份	2025-12-09	9 个月	新股限售	104.66	768.89	533	55,783.78	409,818.37	—
688808	联讯仪器	2026-04-16	6 个月	新股限售	81.88	1,584.33	49	4,012.12	77,632.17	—
688811	有研新材	2026-04-01	6 个月	新股限售	6.41	24.13	613	3,929.33	14,791.69	—
688813	泰金新能	2026-03-24	6 个月	新股限售	26.28	172.09	151	3,968.28	25,985.59	—
688816	易思维	2026-02-04	6 个月	新股限售	55.95	57.10	84	4,699.80	4,796.40	—
688818	电科蓝天	2026-02-03	6 个月	新股限售	9.47	70.14	571	5,407.37	40,049.94	—
688820	盛合晶微	2026-04-13	6 个月	新股限售	19.68	141.49	304	5,982.72	43,012.96	—

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
113705	豪 26 转债	2026-06-15	1 个月内（含）	认购新发证券	100.00	100.01	40	4,000.00	4,000.28	—
118072	鼎通转债	2026-06-24	1 个月内（含）	认购新发证券	100.00	100.00	80	8,000.00	8,000.25	—

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	865.00	601,783.64	719,680.00	—

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，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成

的卖出回购证券款余额。

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	12,000.53	—

未评级	—	—
合计	12,000.53	—

注：本基金上年度末未持有按长期信用评级列示的信用债。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。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

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	20,003,516.94	—	—	—	20,003,516.94
结算备付金	997,951.29	—	—	—	997,951.29
存出保证金	26,517.14	—	—	—	26,517.14
交易性金融资产	3,446,471.33	—	—	261,796,320.91	265,242,792.24
应收申购款	—	—	—	1,109,542.66	1,109,542.66
资产总计	24,474,456.70	—	—	262,905,863.57	287,380,320.27
负债					
应付清算款	—	—	—	6,421,433.66	6,421,433.66
应付赎回款	—	—	—	2,263,849.06	2,263,849.06
应付管理人报酬	—	—	—	251,428.01	251,428.01
应付托管费	—	—	—	41,904.69	41,904.69
应付销售服务费	—	—	—	19,218.99	19,218.99
应交税费	—	—	—	118.79	118.79
其他负债	—	—	—	209,418.22	209,418.22
负债总计	—	—	—	9,207,371.42	9,207,371.42
利率敏感度缺口	24,474,456.70	—	—	253,698,492.15	278,172,948.85

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	15,580,600.26	—	—	—	15,580,600.26
结算备付金	478,510.51	—	—	—	478,510.51
存出保证金	24,988.52	—	—	—	24,988.52
交易性金融资产	202,019.29	—	—	178,329,357.67	178,531,376.96
应收申购款	—	—	—	353,259.24	353,259.24
资产总计	16,286,118.58	—	—	178,682,616.91	194,968,735.49
负债					
应付清算款	—	—	—	2,421,381.53	2,421,381.53
应付赎回款	—	—	—	2,620,620.16	2,620,620.16
应付管理人报酬	—	—	—	191,143.68	191,143.68
应付托管费	—	—	—	31,857.27	31,857.27
应付销售服务费	—	—	—	13,865.38	13,865.38
其他负债	—	—	—	218,499.20	218,499.20
负债总计	—	—	—	5,497,367.22	5,497,367.22
利率敏感度缺口	16,286,118.58	—	—	173,185,249.69	189,471,368.27

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%	-1,079.01	-57.90
	2. 基准点利率减少 0.1%	1,079.01	57.90

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

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

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，所面临的重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	261,796,320.91	94.11	178,329,357.67	94.12
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	3,446,471.33	1.24	202,019.29	0.11
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	265,242,792.24	95.35	178,531,376.96	94.23

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的风险变量保持不变。		
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%	2,570,675.98	1,776,861.81
	2. 业绩比较基准减少 1%	-2,570,675.98	-1,776,861.81

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	258,828,702.62	176,532,203.76
第二层次	4,290,304.48	982,238.29
第三层次	2,123,785.14	1,016,934.91
合计	265,242,792.24	178,531,376.96

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	261,796,320.91	91.10
	其中：股票	261,796,320.91	91.10
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	3,446,471.33	1.20
	其中：债券	3,446,471.33	1.20
	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	21,001,468.23	7.31
8	其他各项资产	1,136,059.80	0.40
9	合计	287,380,320.27	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	—	—
B	采矿业	649,397.00	0.23
C	制造业	216,592,653.39	77.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	41,601.00	0.01
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,455,875.67	3.76
J	金融业	8,892.00	0.00
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	6,299,364.80	2.26

N	水利、环境和公共设施管理业	2,587,556.00	0.93
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	236,635,339.86	85.07

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	827,361.84	0.30
C	制造业	23,580,345.20	8.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	112,797.27	0.04
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	537,600.00	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	1,333.44	0.00
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,089.30	0.01
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	46,874.00	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	33,580.00	0.01
	合计	25,160,981.05	9.05

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	11,560	14,681,200.00	5.28
2	300750	宁德时代	25,620	10,068,916.20	3.62

3	300502	新易盛	14,768	8,964,176.00	3.22
4	603986	兆易创新	6,600	5,379,000.00	1.93
5	603259	药明康德	37,680	4,691,536.80	1.69
6	688256	寒武纪	2,844	4,537,744.20	1.63
7	688008	澜起科技	14,540	4,505,946.00	1.62
8	002475	立讯精密	50,273	3,539,219.20	1.27
9	300476	胜宏科技	9,900	3,429,657.00	1.23
10	002384	东山精密	11,800	3,095,730.00	1.11
11	002371	北方华创	3,470	3,069,423.20	1.10
12	601138	工业富联	41,200	2,972,580.00	1.07
13	000338	潍柴动力	101,400	2,763,150.00	0.99
14	600150	中国船舶	81,374	2,749,627.46	0.99
15	688498	源杰科技	1,396	2,632,856.00	0.95
16	301308	江波龙	3,700	2,604,060.00	0.94
17	300677	英科医疗	65,400	2,561,718.00	0.92
18	688521	芯原股份	6,647	2,466,967.58	0.89
19	688525	佰维存储	4,861	2,404,882.53	0.86
20	605117	德业股份	21,900	2,325,342.00	0.84
21	002049	紫光国微	25,900	2,298,625.00	0.83
22	002414	高德红外	173,200	2,296,632.00	0.83
23	002487	大金重工	39,000	2,260,830.00	0.81
24	600183	生益科技	12,700	2,202,180.00	0.79
25	600487	亨通光电	20,100	2,197,734.00	0.79
26	688002	睿创微纳	13,565	2,098,369.85	0.75
27	600499	科达制造	150,900	2,082,420.00	0.75
28	688041	海光信息	5,569	2,062,200.70	0.74
29	300438	鹏辉能源	23,900	1,980,115.00	0.71
30	688981	中芯国际	12,399	1,969,209.18	0.71
31	002156	通富微电	25,800	1,957,446.00	0.70
32	601869	长飞光纤	3,400	1,856,060.00	0.67
33	002812	恩捷股份	26,700	1,786,497.00	0.64
34	000725	京东方A	203,300	1,764,644.00	0.63
35	001389	广合科技	7,100	1,684,475.00	0.61
36	600875	东方电气	58,500	1,683,045.00	0.61
37	002415	海康威视	48,180	1,647,756.00	0.59
38	300223	君正股份	6,600	1,642,740.00	0.59
39	300857	协创数据	4,700	1,597,530.00	0.57
40	002463	沪电股份	10,200	1,558,560.00	0.56
41	688469	芯联集成	145,333	1,541,983.13	0.55
42	688012	中微公司	3,275	1,534,337.50	0.55
43	600089	特变电工	67,571	1,520,347.50	0.55

44	300207	欣旺达	79,400	1,507,806.00	0.54
45	603699	纽威股份	29,900	1,503,970.00	0.54
46	000988	华工科技	8,000	1,476,880.00	0.53
47	300432	富临精工	72,800	1,462,552.00	0.53
48	600741	华域汽车	92,900	1,441,808.00	0.52
49	600418	江淮汽车	55,700	1,438,731.00	0.52
50	603296	华勤技术	19,340	1,436,381.80	0.52
51	600460	士兰微	26,100	1,426,626.00	0.51
52	300450	先导智能	35,000	1,425,200.00	0.51
53	688578	艾力斯	13,013	1,421,019.60	0.51
54	001309	德明利	1,500	1,414,350.00	0.51
55	601877	正泰电器	56,200	1,408,934.00	0.51
56	002709	天赐材料	26,900	1,383,467.00	0.50
57	688235	百济神州	5,383	1,370,565.63	0.49
58	000997	新 大 陆	83,500	1,361,050.00	0.49
59	688266	泽璟制药	11,650	1,359,089.00	0.49
60	688331	荣昌生物	10,324	1,344,804.24	0.48
61	002222	福晶科技	14,500	1,338,060.00	0.48
62	002028	思源电气	7,700	1,332,100.00	0.48
63	688208	道通科技	52,286	1,317,084.34	0.47
64	300850	新强联	48,400	1,297,120.00	0.47
65	002402	和而泰	48,600	1,255,338.00	0.45
66	300953	震裕科技	9,380	1,254,106.00	0.45
67	002850	科达利	6,500	1,230,450.00	0.44
68	002266	浙富控股	241,400	1,221,484.00	0.44
69	688629	华丰科技	6,394	1,198,938.94	0.43
70	603290	斯达半导	7,700	1,177,638.00	0.42
71	000977	浪潮信息	16,700	1,169,000.00	0.42
72	301358	湖南裕能	15,400	1,168,398.00	0.42
73	300124	汇川技术	17,600	1,167,408.00	0.42
74	688220	翱捷科技	9,383	1,166,494.56	0.42
75	301165	锐捷网络	14,400	1,158,480.00	0.42
76	300394	天孚通信	3,720	1,125,969.60	0.40
77	301536	星宸科技	8,600	1,106,906.00	0.40
78	600893	航发动力	28,300	1,085,022.00	0.39
79	002001	新 和 成	37,280	1,059,497.60	0.38
80	601717	中创智领	74,820	1,040,746.20	0.37
81	300408	三环集团	6,200	1,034,780.00	0.37
82	300274	阳光电源	6,088	968,113.76	0.35
83	301606	绿联科技	15,800	964,116.00	0.35
84	601127	赛力斯	15,700	961,625.00	0.35

85	002600	领益智造	54,300	941,562.00	0.34
86	688213	思特威	8,753	937,183.71	0.34
87	600104	上汽集团	92,800	905,728.00	0.33
88	600885	宏发股份	26,200	903,638.00	0.32
89	601058	赛轮轮胎	76,700	884,351.00	0.32
90	600363	联创光电	24,600	880,188.00	0.32
91	603127	昭衍新药	23,000	879,060.00	0.32
92	002916	深南电路	1,830	837,957.00	0.30
93	002821	凯莱英	5,140	832,680.00	0.30
94	002841	视源股份	24,100	832,173.00	0.30
95	300724	捷佳伟创	11,700	826,020.00	0.30
96	600066	宇通客车	30,300	812,343.00	0.29
97	002008	大族激光	5,300	795,583.00	0.29
98	002595	豪迈科技	16,200	754,920.00	0.27
99	000100	TCL 科技	127,400	741,468.00	0.27
100	600196	复星医药	32,500	730,275.00	0.26
101	688072	拓荆科技	865	719,680.00	0.26
102	600323	瀚蓝环境	26,000	713,960.00	0.26
103	300014	亿纬锂能	10,900	708,827.00	0.25
104	688099	晶晨股份	6,805	700,234.50	0.25
105	600438	通威股份	56,400	683,004.00	0.25
106	000039	中集集团	82,100	665,831.00	0.24
107	603568	伟明环保	42,400	652,112.00	0.23
108	600871	石化油服	319,900	649,397.00	0.23
109	600166	福田汽车	220,800	642,528.00	0.23
110	002048	宁波华翔	27,900	641,700.00	0.23
111	688195	腾景科技	3,332	641,676.56	0.23
112	300573	兴齐眼药	15,400	627,704.00	0.23
113	603596	伯特利	24,900	618,516.00	0.22
114	002179	中航光电	13,200	609,840.00	0.22
115	300661	圣邦股份	4,200	602,616.00	0.22
116	300456	赛微电子	14,000	594,580.00	0.21
117	600584	长电科技	5,700	590,235.00	0.21
118	601966	玲珑轮胎	57,700	587,963.00	0.21
119	600703	三安光电	27,400	581,428.00	0.21
120	300604	长川科技	1,700	580,414.00	0.21
121	003035	南网能源	99,100	576,762.00	0.21
122	601231	环旭电子	17,700	573,480.00	0.21
123	605358	立昂微	7,300	566,480.00	0.20
124	688396	华润微	5,751	561,010.05	0.20
125	601567	三星电气	36,600	546,804.00	0.20

126	603236	移远通信	10,400	532,168.00	0.19
127	603019	中科曙光	4,600	493,258.00	0.18
128	688475	萤石网络	17,208	470,638.80	0.17
129	300775	三角防务	21,200	467,248.00	0.17
130	603920	世运电路	9,600	461,184.00	0.17
131	002506	协鑫集成	143,300	455,694.00	0.16
132	301550	斯菱智驱	4,900	448,007.00	0.16
133	301377	鼎泰高科	800	440,720.00	0.16
134	601012	隆基绿能	33,587	440,661.44	0.16
135	603659	璞泰来	15,100	436,843.00	0.16
136	600498	烽火通信	5,700	419,520.00	0.15
137	600522	中天科技	6,600	400,488.00	0.14
138	000951	中国重汽	20,500	399,955.00	0.14
139	002185	华天科技	17,300	385,963.00	0.14
140	688336	三生国健	7,170	380,727.00	0.14
141	600601	方正科技	27,400	379,216.00	0.14
142	300409	道氏技术	18,500	368,705.00	0.13
143	600276	恒瑞医药	7,000	364,280.00	0.13
144	002074	国轩高科	13,200	363,132.00	0.13
145	600482	中国动力	11,000	360,800.00	0.13
146	002837	英维克	4,470	355,633.20	0.13
147	688180	君实生物	9,968	337,117.76	0.12
148	002270	华明装备	17,700	333,645.00	0.12
149	002202	金风科技	13,900	332,210.00	0.12
150	601179	中国西电	21,800	325,256.00	0.12
151	300236	上海新阳	2,400	315,600.00	0.11
152	603025	大豪科技	22,600	308,264.00	0.11
153	000559	万向钱潮	23,500	303,855.00	0.11
154	300458	全志科技	7,600	299,896.00	0.11
155	300919	中伟新材	6,800	297,500.00	0.11
156	688301	奕瑞科技	2,374	294,376.00	0.11
157	000066	中国长城	14,900	283,845.00	0.10
158	688110	东芯股份	1,367	278,457.90	0.10
159	688100	威胜信息	8,929	273,138.11	0.10
160	600550	保变电气	23,200	272,136.00	0.10
161	601615	明阳智能	23,100	267,267.00	0.10
162	688223	晶科能源	54,320	258,020.00	0.09
163	000425	徐工机械	31,200	252,408.00	0.09
164	601865	福莱特	23,700	249,087.00	0.09
165	603308	应流股份	4,000	241,600.00	0.09
166	603083	剑桥科技	900	229,383.00	0.08

167	688778	厦钨新能	4,158	226,195.20	0.08
168	000021	深科技	3,300	212,091.00	0.08
169	688009	中国通号	44,436	211,515.36	0.08
170	600933	爱柯迪	13,900	205,442.00	0.07
171	300115	长盈精密	7,300	203,962.00	0.07
172	601689	拓普集团	3,600	203,112.00	0.07
173	688709	成都华微	5,326	202,867.34	0.07
174	002484	江海股份	1,900	199,500.00	0.07
175	688052	纳芯微	671	193,456.01	0.07
176	688660	电气风电	21,701	187,062.62	0.07
177	300782	卓胜微	1,700	186,286.00	0.07
178	600877	电科芯片	10,600	181,578.00	0.07
179	002281	光迅科技	700	179,858.00	0.06
180	601126	四方股份	2,800	176,960.00	0.06
181	603806	福斯特	10,500	176,295.00	0.06
182	002422	科伦药业	4,500	173,340.00	0.06
183	300779	惠城环保	3,440	172,688.00	0.06
184	600732	爱旭股份	12,200	168,970.00	0.06
185	002151	北斗星通	5,300	168,275.00	0.06
186	002273	水晶光电	4,500	159,660.00	0.06
187	002594	比亚迪	2,000	159,400.00	0.06
188	688271	联影医疗	1,567	158,627.41	0.06
189	300896	爱美客	1,800	156,960.00	0.06
190	300136	信维通信	1,300	155,025.00	0.06
191	300102	乾照光电	5,200	135,408.00	0.05
192	688516	奥特维	2,277	130,677.03	0.05
193	002432	九安医疗	1,800	127,224.00	0.05
194	601399	国机重装	35,700	124,950.00	0.04
195	300602	飞荣达	2,400	122,880.00	0.04
196	603392	万泰生物	4,400	118,668.00	0.04
197	300672	国科微	400	118,000.00	0.04
198	688188	柏楚电子	1,095	116,836.50	0.04
199	002465	海格通信	8,800	112,376.00	0.04
200	300296	利亚德	20,000	112,000.00	0.04
201	300548	长芯博创	400	111,200.00	0.04
202	300759	康龙化成	3,800	109,934.00	0.04
203	688630	芯碁微装	200	109,878.00	0.04
204	002245	蔚蓝锂芯	5,700	106,647.00	0.04
205	000519	中兵红箭	5,000	105,350.00	0.04
206	600733	北汽蓝谷	20,900	101,783.00	0.04
207	002335	科华数据	2,180	92,541.00	0.03

208	688313	仕佳光子	448	82,723.20	0.03
209	688536	思瑞浦	217	79,007.53	0.03
210	688385	复旦微电	1,087	77,492.23	0.03
211	600563	法拉电子	400	76,320.00	0.03
212	300620	光库科技	200	75,640.00	0.03
213	600577	精达股份	7,500	73,350.00	0.03
214	688347	华虹宏力	200	67,260.00	0.02
215	600685	中船防务	2,300	58,512.00	0.02
216	688018	乐鑫科技	442	56,540.64	0.02
217	300638	广和通	3,000	55,530.00	0.02
218	603306	华懋科技	500	51,845.00	0.02
219	600764	中国海防	2,700	47,061.00	0.02
220	002353	杰瑞股份	300	45,750.00	0.02
221	300866	安克创新	400	41,800.00	0.02
222	600072	中船科技	4,900	41,601.00	0.01
223	300446	航天智造	2,400	40,392.00	0.01
224	002025	航天电器	500	38,110.00	0.01
225	603501	豪威集团	400	37,940.00	0.01
226	601106	中国一重	11,400	37,620.00	0.01
227	688582	芯动联科	564	36,660.00	0.01
228	301200	大族数控	100	36,065.00	0.01
229	300870	欧陆通	100	34,569.00	0.01
230	600699	均胜电子	1,500	32,415.00	0.01
231	300433	蓝思科技	600	32,196.00	0.01
232	600038	中直股份	1,100	27,819.00	0.01
233	688248	南网科技	400	27,672.00	0.01
234	002625	光启技术	900	27,288.00	0.01
235	601100	恒立液压	200	21,512.00	0.01
236	002236	大华股份	1,200	19,788.00	0.01
237	000157	中联重科	2,800	19,516.00	0.01
238	300390	天华新能	200	18,702.00	0.01
239	300346	南大光电	200	18,530.00	0.01
240	300474	景嘉微	300	18,144.00	0.01
241	688349	三一重能	1,126	17,092.68	0.01
242	002444	巨星科技	500	15,550.00	0.01
243	300347	泰格医药	300	14,400.00	0.01
244	600206	有研新材	200	13,320.00	0.00
245	600879	航天电子	600	12,774.00	0.00
246	002294	信立泰	400	12,756.00	0.00
247	300001	特锐德	300	11,349.00	0.00
248	000063	中兴通讯	300	10,857.00	0.00

249	002518	科士达	200	10,718.00	0.00
250	600312	平高电气	600	10,596.00	0.00
251	002938	鹏鼎控股	100	10,538.00	0.00
252	002773	康弘药业	500	10,225.00	0.00
253	688166	博瑞医药	290	10,152.90	0.00
254	688281	华秦科技	200	10,046.00	0.00
255	002906	华阳集团	400	9,984.00	0.00
256	603179	新泉股份	200	9,930.00	0.00
257	002459	晶澳科技	1,200	9,720.00	0.00
258	300073	当升科技	200	9,608.00	0.00
259	300122	智飞生物	800	9,352.00	0.00
260	600517	国网英大	1,900	8,892.00	0.00
261	600031	三一重工	500	8,640.00	0.00
262	300726	宏达电子	100	8,457.00	0.00
263	001696	宗申动力	400	8,324.00	0.00
264	600118	中国卫星	100	8,205.00	0.00
265	000768	中航西飞	400	8,192.00	0.00
266	002779	中坚科技	100	7,856.00	0.00
267	603228	景旺电子	100	7,241.00	0.00
268	000636	风华高科	100	7,224.00	0.00
269	600406	国电南瑞	300	6,855.00	0.00
270	600105	永鼎股份	100	6,748.00	0.00
271	600435	北方导航	600	6,720.00	0.00
272	002984	森麒麟	500	6,535.00	0.00
273	600316	洪都航空	200	5,588.00	0.00
274	000738	航发控制	300	5,487.00	0.00
275	603005	晶方科技	100	5,387.00	0.00
276	002436	兴森科技	100	5,095.00	0.00
277	600660	福耀玻璃	100	5,044.00	0.00
278	002180	奔图科技	300	4,908.00	0.00
279	600100	同方股份	700	4,795.00	0.00
280	603298	杭叉集团	200	4,772.00	0.00
281	002241	歌尔股份	200	4,506.00	0.00
282	300199	翰宇药业	200	4,416.00	0.00
283	603358	华达科技	100	4,350.00	0.00
284	000400	许继电气	200	4,340.00	0.00
285	600372	中航机载	400	4,340.00	0.00
286	300832	新产业	100	4,200.00	0.00
287	002472	双环传动	100	4,151.00	0.00
288	603786	科博达	100	4,091.00	0.00
289	002389	航天彩虹	200	3,554.00	0.00

290	002611	东方精工	200	3,532.00	0.00
291	688599	天合光能	244	3,445.28	0.00
292	300628	亿联网络	100	3,382.00	0.00
293	601608	中信重工	700	3,339.00	0.00
294	600580	卧龙电驱	100	3,310.00	0.00
295	600171	上海贝岭	100	3,194.00	0.00
296	002056	横店东磁	100	3,048.00	0.00
297	002456	欧菲光	300	2,838.00	0.00
298	002152	广电运通	300	2,814.00	0.00
299	301029	怡合达	100	2,701.00	0.00
300	002340	格林美	400	2,644.00	0.00
301	002130	沃尔核材	100	1,896.00	0.00
302	002262	恩华药业	100	1,875.00	0.00
303	000739	普洛药业	100	1,666.00	0.00
304	688538	和辉光电	531	1,380.60	0.00
305	300142	沃森生物	100	1,299.00	0.00
306	600765	中航重机	100	1,292.00	0.00
307	600582	天地科技	200	890.00	0.00
308	300009	安科生物	100	785.00	0.00
309	002583	海能达	100	769.00	0.00
310	000800	一汽解放	100	595.00	0.00
311	601766	中国中车	100	520.00	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	600590	泰豪科技	152,400	1,539,240.00	0.55
2	688236	春立医疗	90,801	1,312,982.46	0.47
3	688390	固德威	11,006	1,194,261.06	0.43
4	300772	运达股份	93,400	1,148,820.00	0.41
5	605123	派克新材	10,900	1,057,409.00	0.38
6	688221	前沿生物	40,970	917,728.00	0.33
7	688700	东威科技	9,540	852,876.00	0.31
8	300483	首华燃气	46,100	810,438.00	0.29
9	688127	蓝特光学	7,743	755,716.80	0.27
10	300129	泰胜风能	87,700	749,835.00	0.27
11	002531	天顺风能	88,100	742,683.00	0.27
12	301087	可孚医疗	15,100	719,515.00	0.26
13	002283	天润工业	74,300	716,995.00	0.26
14	300443	金雷股份	33,000	712,140.00	0.26

15	601311	骆驼股份	90,700	706,553.00	0.25
16	688556	高测股份	52,820	701,449.60	0.25
17	688049	炬芯科技	14,936	700,647.76	0.25
18	688668	鼎通科技	1,653	617,064.90	0.22
19	000550	江铃汽车	35,400	574,188.00	0.21
20	600480	凌云股份	69,000	573,390.00	0.21
21	605056	咸亨国际	33,600	537,600.00	0.19
22	000534	万泽股份	18,400	503,424.00	0.18
23	300049	福瑞医科	12,700	493,776.00	0.18
24	688795	摩尔线程	689	466,411.66	0.17
25	688783	西安奕材	8,094	464,757.48	0.17
26	688802	沐曦股份	533	409,818.37	0.15
27	300428	立中集团	22,200	403,596.00	0.15
28	002865	钧达股份	5,500	328,240.00	0.12
29	300926	博俊科技	18,400	326,600.00	0.12
30	688800	瑞可达	2,983	286,278.51	0.10
31	603507	振江股份	8,400	276,276.00	0.10
32	603239	浙江仙通	13,200	195,492.00	0.07
33	688378	奥来德	3,033	188,046.00	0.07
34	688510	航亚科技	7,448	177,858.24	0.06
35	688063	派能科技	2,985	159,010.95	0.06
36	300680	隆盛科技	6,600	149,952.00	0.05
37	002488	金固股份	16,300	145,233.00	0.05
38	688488	艾迪药业	11,133	143,059.05	0.05
39	301666	大普微	305	141,315.65	0.05
40	688636	智明达	3,892	141,007.16	0.05
41	605333	沪光股份	7,900	134,695.00	0.05
42	688513	苑东生物	2,858	125,637.68	0.05
43	301011	华立科技	8,000	113,120.00	0.04
44	001248	华润新能源	11,157	112,797.27	0.04
45	601777	千里科技	12,900	105,264.00	0.04
46	688677	海泰新光	1,040	105,175.20	0.04
47	688781	视涯科技	1,856	78,248.96	0.03
48	688085	三友医疗	6,502	77,828.94	0.03
49	688808	联讯仪器	49	77,632.17	0.03
50	300580	贝斯特	3,700	74,407.00	0.03
51	603063	禾望电气	1,400	74,046.00	0.03
52	688790	昂瑞微	551	69,673.95	0.03
53	688176	亚虹医药	7,018	69,618.56	0.03
54	688698	伟创电气	1,092	57,275.40	0.02
55	605133	嵘泰股份	1,400	55,118.00	0.02

56	300416	苏试试验	2,300	46,874.00	0.02
57	688797	臻宝科技	99	46,398.33	0.02
58	688820	盛合晶微	304	43,012.96	0.02
59	688818	电科蓝天	571	40,049.94	0.01
60	001399	惠科股份	1,317	36,520.41	0.01
61	600673	东阳光	1,000	33,580.00	0.01
62	002922	伊戈尔	1,000	32,800.00	0.01
63	301682	宏明电子	191	30,571.46	0.01
64	688635	长进光子	98	30,202.62	0.01
65	603297	永新光学	200	29,390.00	0.01
66	300693	盛弘股份	600	29,250.00	0.01
67	688813	泰金新能	151	25,985.59	0.01
68	688785	恒运昌	49	22,694.35	0.01
69	605305	中际联合	500	20,960.00	0.01
70	001257	盛龙股份	816	16,923.84	0.01
71	688811	有研复材	613	14,791.69	0.01
72	688136	科兴制药	610	12,633.10	0.00
73	301531	春光集团	232	11,961.92	0.00
74	603638	艾迪精密	500	11,725.00	0.00
75	000682	东方电子	910	11,493.30	0.00
76	301687	新广益	146	11,355.88	0.00
77	301696	三瑞智能	130	11,284.00	0.00
78	002979	雷赛智能	200	11,156.00	0.00
79	002448	中原内配	900	11,070.00	0.00
80	603459	红板科技	131	11,045.92	0.00
81	603407	长裕集团	135	9,917.10	0.00
82	603859	能科科技	200	9,596.00	0.00
83	603556	海兴电力	400	8,800.00	0.00
84	301599	理奇智能	254	8,247.38	0.00
85	002020	京新药业	600	7,494.00	0.00
86	002925	盈趣科技	300	7,398.00	0.00
87	002881	美格智能	200	7,288.00	0.00
88	301680	固德电材	64	7,178.24	0.00
89	301513	尚水智能	136	6,930.56	0.00
90	605319	无锡振华	300	6,807.00	0.00
91	001365	天海电子	213	6,669.03	0.00
92	603013	亚普股份	400	6,316.00	0.00
93	001393	维通利	150	5,848.50	0.00
94	603730	岱美股份	500	5,585.00	0.00
95	002364	中恒电气	100	5,380.00	0.00
96	300747	锐科激光	101	5,362.09	0.00

97	301683	慧谷新材	44	5,357.88	0.00
98	603416	信捷电气	100	5,287.00	0.00
99	300685	艾德生物	300	5,052.00	0.00
100	001237	惠康科技	86	5,051.64	0.00
101	000680	山推股份	500	5,025.00	0.00
102	603009	北特科技	100	4,797.00	0.00
103	688816	易思维	84	4,796.40	0.00
104	600353	旭光电子	100	4,560.00	0.00
105	603435	嘉德利	94	4,390.74	0.00
106	300415	伊之密	200	3,982.00	0.00
107	603305	旭升集团	300	3,636.00	0.00
108	301039	中集车辆	500	3,525.00	0.00
109	601112	振石股份	188	3,306.92	0.00
110	603809	豪能股份	300	2,631.00	0.00
111	601882	海天精工	100	2,023.00	0.00
112	603352	至信股份	64	1,633.28	0.00
113	603284	林平发展	39	1,359.93	0.00
114	001220	世盟股份	48	1,333.44	0.00
115	001312	福恩股份	76	1,275.28	0.00
116	603293	埃泰克	35	1,187.55	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	600150	中国船舶	6,001,885.93	3.17
2	002415	海康威视	5,128,475.20	2.71
3	300750	宁德时代	4,666,977.00	2.46
4	603986	兆易创新	4,628,746.00	2.44
5	000977	浪潮信息	4,624,000.00	2.44
6	300677	英科医疗	4,600,138.20	2.43
7	002371	北方华创	4,006,862.00	2.11
8	000338	潍柴动力	3,913,229.00	2.07
9	603259	药明康德	3,892,665.06	2.05
10	002475	立讯精密	3,789,033.60	2.00
11	600418	江淮汽车	3,744,277.00	1.98
12	600183	生益科技	3,743,160.00	1.98
13	688008	澜起科技	3,741,653.52	1.97
14	300274	阳光电源	3,739,987.00	1.97
15	601138	工业富联	3,674,433.00	1.94

16	300408	三环集团	3,646,030.00	1.92
17	603296	华勤技术	3,521,121.00	1.86
18	300308	中际旭创	3,469,251.00	1.83
19	002600	领益智造	3,460,435.00	1.83
20	300207	欣旺达	3,446,189.00	1.82

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	300750	宁德时代	4,872,813.00	2.57
2	002475	立讯精密	4,659,671.00	2.46
3	600584	长电科技	4,644,093.00	2.45
4	300274	阳光电源	4,345,058.00	2.29
5	603986	兆易创新	4,257,175.00	2.25
6	600150	中国船舶	4,138,153.00	2.18
7	002371	北方华创	3,944,599.00	2.08
8	600183	生益科技	3,924,860.00	2.07
9	603019	中科曙光	3,804,483.00	2.01
10	002463	沪电股份	3,785,008.00	2.00
11	688002	睿创微纳	3,687,455.59	1.95
12	000977	浪潮信息	3,663,804.00	1.93
13	002415	海康威视	3,524,014.00	1.86
14	600276	恒瑞医药	3,516,006.00	1.86
15	688025	杰普特	3,515,233.17	1.86
16	600066	宇通客车	3,465,511.00	1.83
17	300857	协创数据	3,438,151.00	1.81
18	300408	三环集团	3,422,020.00	1.81
19	000725	京东方 A	3,388,159.00	1.79
20	000063	中兴通讯	3,378,169.00	1.78

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	580,499,229.17
卖出股票收入（成交）总额	568,666,757.91

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	3,434,470.80	1.23
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）	12,000.53	0.00
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	3,446,471.33	1.24

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	019792	25 国债 19	31,000	3,132,526.22	1.13
2	019827	26 国债 01	3,000	301,944.58	0.11
3	118072	鼎通转债	80	8,000.25	0.00
4	113705	豪 26 转债	40	4,000.28	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，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

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

本基金不允许投资国债期货。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，立讯精密工业股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家市场监督管理总局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

本基金持有的其余证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 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	26,517.14
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	1,109,542.66
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,136,059.80

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 (%)
富国中证高端制造指 数增强型 (LOF) A	10,116	4,495.64	26,401.66	0.06	45,451,447 .28	99.94
富国中证高端制造指 数增强型 (LOF) C	3,510	11,335.73	32,625,943. 86	82.00	7,162,470. 73	18.00
合计	13,626	6,257.62	32,652,345. 52	38.29	52,613,918 .01	61.71

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	富国中证高端制造指数增强 型 (LOF) A	460,244.07	1.0120
	富国中证高端制造指数增强 型 (LOF) C	2,394.45	0.0060
	合计	462,638.52	0.5426

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	富国中证高端制造指数增强型 (LOF) A	10~50
	富国中证高端制造指数增强型 (LOF) C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持 有本开放式基金	富国中证高端制造指数增强型 (LOF) A	0~10
	富国中证高端制造指数增强型 (LOF) C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	富国中证高端制造指数增强 型（LOF）A	富国中证高端制造指数增强 型（LOF）C
基金合同生效日（2017年04月27日）基金份额 总额	281,495,289.54	—
本报告期期初基金份额总额	43,200,064.78	36,061,563.60
本报告期基金总申购份额	26,867,199.43	21,202,668.56
减：本报告期基金总赎回份额	24,589,415.27	17,475,817.57
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	45,477,848.94	39,788,414.59

§ 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，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、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，本基金托管人无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

注：本报告期内，本基金托管人相关从业人员无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(%)	
长城证券	1	—	—	—	—	—
长江证券	3	—	—	—	—	—
东北证券	2	—	—	—	—	—
东财证券	2	—	—	—	—	—
方正证券	2	54,985,745.68	4.79	7,472.85	4.79	—
高盛中国	1	—	—	—	—	—
光大证券	2	—	—	—	—	—
广发证券	2	260,837,067.09	22.72	35,448.13	22.72	—
国海证券	2	—	—	—	—	—
国盛证券	2	—	—	—	—	—
国泰海通	3	45,720,787.23	3.98	6,213.76	3.98	—
国投证券	2	—	—	—	—	—
国信证券	2	71,569,154.17	6.23	9,726.80	6.23	—
华泰证券	2	22,094,969.90	1.92	3,002.71	1.92	—
华源证券	2	—	—	—	—	—
平安证券	2	—	—	—	—	—
瑞银证券	2	—	—	—	—	—
上海证券	1	—	—	—	—	—
申万宏源	2	21,449,191.97	1.87	2,914.96	1.87	—
太平洋证券	2	—	—	—	—	—
天风证券	2	—	—	—	—	—
西南证券	2	—	—	—	—	—

湘财证券	2	—	—	—	—	—
信达证券	2	—	—	—	—	—
兴业证券	1	—	—	—	—	—
招商证券	1	271,528,254.06	23.65	36,902.25	23.65	—
中航证券	2	—	—	—	—	—
中金公司	2	82,306,199.27	7.17	11,185.04	7.17	—
中泰证券	2	—	—	—	—	—
中信建投	2	40,925,214.59	3.56	5,561.49	3.56	—
中信证券	3	276,629,942.33	24.10	37,594.25	24.10	—
中银证券	1	—	—	—	—	—

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。本报告期本基金退租券商交易单元：国泰海通（274902）。

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 (%)
长城证券	—	—	—	—	—	—
长江证券	—	—	—	—	—	—
东北证券	—	—	—	—	—	—
东财证券	—	—	—	—	—	—
方正证券	300,145.00	8.67	—	—	—	—
高盛中国	—	—	—	—	—	—
光大证券	—	—	—	—	—	—
广发证券	—	—	—	—	—	—
国海证券	—	—	—	—	—	—
国盛证券	—	—	—	—	—	—
国泰海通	—	—	—	—	—	—
国投证券	—	—	—	—	—	—
国信证券	2,008,119.23	58.00	—	—	—	—
华泰证券	—	—	—	—	—	—
华源证券	—	—	—	—	—	—
平安证券	—	—	—	—	—	—

瑞银证券	—	—	—	—	—	—
上海证券	—	—	—	—	—	—
申万宏源	—	—	—	—	—	—
太平洋证券	—	—	—	—	—	—
天风证券	—	—	—	—	—	—
西南证券	—	—	—	—	—	—
湘财证券	—	—	—	—	—	—
信达证券	—	—	—	—	—	—
兴业证券	—	—	—	—	—	—
招商证券	14,155.40	0.41	—	—	—	—
中航证券	—	—	—	—	—	—
中金公司	—	—	—	—	—	—
中泰证券	—	—	—	—	—	—
中信建投	—	—	—	—	—	—
中信证券	1,139,969.00	32.92	—	—	—	—
中银证券	—	—	—	—	—	—

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	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	规定披露媒介	2026年04月23日

	销期内承销证券的公告		
8	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 05 月 21 日
9	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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2026-01-01 至 2026-06-30	22,667,618.65	503,776.10	3,170,337.53	20,001,057.22	23.46%
产品特有风险							
本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。							

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高端制造指数增强型证券投资基金（LOF）的文件 2、富国中证高端制造指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同 3、富国中证高端制造指数增强型证券投资基金（LOF）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、富国中证高端制造指数增强型证券投资基金（LOF）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 。