

富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）

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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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	45
7.1	期末基金资产组合情况	45

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	70
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	71
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.....	71
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.....	72
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.....	72
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.....	72
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	72
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	72
7.12 投资组合报告附注	72
§ 8 基金份额持有人信息	75
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	75
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	75
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.....	75
§ 9 开放式基金份额变动	76
§ 10 重大事件揭示	77
10.1 基金份额持有人大会决议	77
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.....	77
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	77
10.4 基金投资策略的改变	77
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	77
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	77
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.....	78
10.8 其他重大事件	79
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	81
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	81
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	81
§ 12 备查文件目录	82

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）	
基金简称	富国中证 1000 指数增强（LOF）	
场内简称	1000 增强 LOF	
基金主代码	161039	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 05 月 31 日	
基金管理人	富国基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	315,790,324.53 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	2018 年 6 月 20 日	
下属分级基金的基金简称	富国中证 1000 指数增强（LOF） A	富国中证 1000 指数增强（LOF）C
下属分级基金场内简称	1000 增强 LOF	—
下属分级基金的交易代码	161039	013331
报告期末下属分级基金的份额总额	224,917,603.85 份	90,872,720.68 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 1000 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”，主要策略为复制目标指数，即投资组合将以成份股在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进行超配或低配选择。本基金在复制目标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%。本基金的股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生工具投资策略及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	中证 1000 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。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	任航
	联系电话	021-20361818	010-66060069

	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		95105686、4008880688	95599
传真		021-20361616	010-68121816
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	北京市东城区建国门内大街 69 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	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		200120	100031
法定代表人		陈戈	谷澍

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 中国农业银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9

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 1000 指数增强 (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	117,327,381.45
本期利润	117,459,951.96
加权平均基金份额本期利润	0.4454
本期加权平均净值利润率	15.65%
本期基金份额净值增长率	16.93%
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	373,998,189.90
期末可供分配基金份额利润	1.6628
期末基金资产净值	684,780,857.11
期末基金份额净值	3.0446
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	204.46%

(2) 富国中证 1000 指数增强 (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	64,631,300.30
本期利润	60,105,090.15
加权平均基金份额本期利润	0.4172
本期加权平均净值利润率	14.85%
本期基金份额净值增长率	16.81%
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	148,515,984.52
期末可供分配基金份额利润	1.6343
期末基金资产净值	273,993,811.29
期末基金份额净值	3.0151
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	46.29%

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 1000 指数增强 (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	13.67%	1.52%	14.83%	1.53%	-1.16%	-0.01%
过去六个月	16.93%	1.52%	15.23%	1.54%	1.70%	-0.02%
过去一年	46.59%	1.27%	36.53%	1.31%	10.06%	-0.04%
过去三年	54.94%	1.48%	32.22%	1.57%	22.72%	-0.09%
过去五年	56.85%	1.39%	23.98%	1.47%	32.87%	-0.08%
过去七年	188.01%	1.38%	63.17%	1.45%	124.84%	-0.07%
自基金合同生效起至今	204.46%	1.38%	40.74%	1.48%	163.72%	-0.10%

(2) 富国中证 1000 指数增强 (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	13.61%	1.52%	14.83%	1.53%	-1.22%	-0.01%
过去六个月	16.81%	1.52%	15.23%	1.54%	1.58%	-0.02%
过去一年	46.29%	1.27%	36.53%	1.31%	9.76%	-0.04%
过去三年	54.02%	1.48%	32.22%	1.57%	21.80%	-0.09%
自基金分级生效日起至今	46.29%	1.40%	17.88%	1.47%	28.41%	-0.07%

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 1000 指数增强 (LOF) A



注：1、截止日期为 2026 年 6 月 30 日。

(2) 富国中证 1000 指数增强 (LOF) C



注：1、截止日期为 2026 年 6 月 30 日。

2、本基金自 2021 年 8 月 19 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		
徐幼华	本基金现任基金经理	2018-05-31	—	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。
方旻	本基金现任 基金经理	2018-05-31	—	16	硕士，自 2010 年 2 月加入富国基金管理有限公司，历任定量研究员、基金经理助理、基金经理、量化与海外投资部量化投资总监助理、高级定量基金经理、量化投资部量化投资副总监、量化投资部量化投资总监；现任富国基金量化投资部量化投资总监兼资深定量基金经理。自 2014 年 11 月起任富国沪深 300 增强证券投资基金基金经理；自 2014 年 11 月起任富国中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理；自 2014 年 11 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 2014 年 11 月起任上证综指交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2015 年 10 月起任富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；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 2019 年 01 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 2020 年 02 月起任富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金基金经理；自 2025 年 04 月起任富国致盛量化选股股票型证券投资基金基金经理；自 2025 年 05 月起任富国上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金基金经理；自 2025 年 06 月起任富国致享量化选股股票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 1000 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 1000 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 24 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，积极追求获取超额收益率。

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 1000 指数增强（LOF）A 为 3.0446 元，富国中证 1000 指数增强（LOF）C 为 3.0151 元；份额累计净值富国中证 1000 指数增强（LOF）A 为 3.0446 元，富国中证 1000 指数增强（LOF）C 为 3.0151 元；本报告期，本基金份额净值增长率情况：富国中证 1000 指数增强（LOF）A 为 16.93%，富国中证 1000 指数增强（LOF）C 为 16.81%；同期业绩比较基准收益率情况：富国中证 1000 指数增强（LOF）A 为 15.23%，富国中证 1000 指数增强（LOF）C 为 15.23%。

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

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，以自身能够获取的数据和信息为限，对本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行核查，以上内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：富国中证 1000 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	87,892,678.60	149,304,441.35
结算备付金	13,270,664.00	19,962,438.62
存出保证金	5,715,984.77	13,837,979.73
交易性金融资产	857,888,266.58	1,003,436,550.71
其中：股票投资	857,535,478.23	1,002,978,974.59
基金投资	—	—
债券投资	352,788.35	457,576.12
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	538,233.36	2,600,875.84
应收股利	—	—
应收申购款	5,225,761.48	1,767,963.97
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	970,531,588.79	1,190,910,250.22
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	—	1,267,114.98
应付赎回款	9,773,428.40	4,352,946.30
应付管理人报酬	792,004.37	984,944.92
应付托管费	118,800.65	147,741.74
应付销售服务费	43,403.16	72,488.18
应付投资顾问费	—	—
应交税费	208,032.41	115,553.12

应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	821,251.40	780,865.20
负债合计	11,756,920.39	7,721,654.44
净资产：		
实收基金	315,790,324.53	455,868,105.68
未分配利润	642,984,343.87	727,320,490.10
净资产合计	958,774,668.40	1,183,188,595.78
负债和净资产总计	970,531,588.79	1,190,910,250.22

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 3.0361 元，基金份额总额 315,790,324.53 份。其中：富国中证 1000 指数增强（LOF）A 份额净值 3.0446 元，份额总额 224,917,603.85 份；富国中证 1000 指数增强（LOF）C 份额净值 3.0151 元，份额总额 90,872,720.68 份。

6.2 利润表

会计主体：富国中证 1000 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	184,755,694.50	140,689,629.06
1. 利息收入	351,625.65	698,755.48
其中：存款利息收入	351,625.65	698,755.48
债券利息收入	—	—
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	—	—
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	188,560,293.86	95,470,321.30
其中：股票投资收益	162,649,012.97	76,512,044.44
基金投资收益	—	—
债券投资收益	494,739.56	4,038.92
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具收益	20,130,225.58	2,312,321.09
股利收益	5,286,315.75	16,641,916.85
其他投资收益	—	—
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-4,393,639.64	44,157,994.04
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	237,414.63	362,558.24
减：二、营业总支出	7,190,652.39	10,526,965.33
1. 管理人报酬	5,753,921.97	8,335,878.76

2. 托管费	863,088.32	1,250,381.76
3. 销售服务费	406,070.85	748,879.01
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	72,501.70	24,878.81
8. 其他费用	95,069.55	166,946.99
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	177,565,042.11	130,162,663.73
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	177,565,042.11	130,162,663.73
五、其他综合收益的税后净额	—	—
六、综合收益总额	177,565,042.11	130,162,663.73

6.3 净资产变动表

会计主体：富国中证 1000 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	455,868,105.68	727,320,490.10	1,183,188,595.78
二、本期期初净资产	455,868,105.68	727,320,490.10	1,183,188,595.78
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-140,077,781.15	-84,336,146.23	-224,413,927.38
（一）、综合收益总额	—	177,565,042.11	177,565,042.11
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-140,077,781.15	-261,901,188.34	-401,978,969.49
其中：1. 基金申购款	164,815,424.39	299,975,622.30	464,791,046.69
2. 基金赎回款	-304,893,205.54	-561,876,810.64	-866,770,016.18
（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	315,790,324.53	642,984,343.87	958,774,668.40
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	1,049,219,160.72	972,689,934.15	2,021,909,094.87
二、本期期初净资产	1,049,219,160.72	972,689,934.15	2,021,909,094.87
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-390,812,550.40	-267,966,845.63	-658,779,396.03
（一）、综合收益总额	—	130,162,663.73	130,162,663.73
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净	-390,812,550.40	-398,129,509.36	-788,942,059.76

资产减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	261, 521, 463. 90	249, 495, 167. 21	511, 016, 631. 11
2. 基金赎回款	-652, 334, 014. 30	-647, 624, 676. 57	— 1, 299, 958, 690. 87
(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	658, 406, 610. 32	704, 723, 088. 52	1, 363, 129, 698. 84

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 1000 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[2018]30 号文《关于准予富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）注册的批复》的核准，由富国基金管理有限公司作为管理人向社会公开发行募集。基金合同于 2018 年 5 月 31 日正式生效，首次设立募集规模为 512,114,043.76 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 2021 年 8 月 17 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 2021 年 8 月 19 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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证 1000 指数的成份股、备选成份股、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）、存托凭证、国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、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）、同业存单、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）。本基金可根据法律法规的规定参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 1000 指数成份股和备选成份股的资产（均含存托凭证）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。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 1000 指数收益率 $\times$ 95%+银行人民币活期存款利率(税后) $\times$ 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。

6.4.7 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	87,892,678.60
等于：本金	87,883,511.81

加：应计利息	9,166.79
减：坏账准备	—
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
其中：存款期限 1 个月以内	—
存款期限 1-3 个月	—
存款期限 3 个月以上	—
其他存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
合计	87,892,678.60

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		836,452,683.85	—	857,535,478.23	21,082,794.38
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	281,100.00	18.56	352,788.35	71,669.79
	银行间市场	—	—	—	—
	合计	281,100.00	18.56	352,788.35	71,669.79
资产支持证券		—	—	—	—
基金		—	—	—	—
其他		—	—	—	—
合计		836,733,783.85	18.56	857,888,266.58	21,154,464.17

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	41,725,400.00	—	—	—
股指期货	41,725,400.00	—	—	—
其他衍生工具	—	—	—	—

合计	41,725,400.00	—	—	—
----	---------------	---	---	---

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
IM2607	IM2607	26.00	45,185,920.00	3,460,520.00
合计				3,460,520.00
减：可抵销期货暂收款				3,460,520.00
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	19,990.66
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	658,987.66
其中：交易所市场	658,987.66
银行间市场	—
应付利息	—
预提信息披露费	60,000.00
预提审计费	82,273.08
合计	821,251.40

6.4.7.7 实收基金

富国中证 1000 指数增强（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	287,427,380.41	287,427,380.41
本期申购	66,996,269.65	66,996,269.65
本期赎回（以“-”号填列）	-129,506,046.21	-129,506,046.21
本期末	224,917,603.85	224,917,603.85

富国中证 1000 指数增强（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	168,440,725.27	168,440,725.27
本期申购	97,819,154.74	97,819,154.74
本期赎回（以“-”号填列）	-175,387,159.33	-175,387,159.33
本期末	90,872,720.68	90,872,720.68

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 1000 指数增强（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	351,550,418.56	109,427,830.89	460,978,249.45
本期期初	351,550,418.56	109,427,830.89	460,978,249.45
本期利润	117,327,381.45	132,570.51	117,459,951.96
本期基金份额交易产生的变动数	-94,879,610.11	-23,695,338.04	-118,574,948.15
其中：基金申购款	96,752,412.43	26,352,293.93	123,104,706.36
基金赎回款	-191,632,022.54	-50,047,631.97	-241,679,654.51
本期已分配利润	—	—	—
本期末	373,998,189.90	85,865,063.36	459,863,253.26

富国中证 1000 指数增强（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	202,371,730.24	63,970,510.41	266,342,240.65
本期期初	202,371,730.24	63,970,510.41	266,342,240.65
本期利润	64,631,300.30	-4,526,210.15	60,105,090.15
本期基金份额交易产生的变动数	-118,487,046.02	-24,839,194.17	-143,326,240.19
其中：基金申购款	137,707,821.88	39,163,094.06	176,870,915.94
基金赎回款	-256,194,867.90	-64,002,288.23	-320,197,156.13
本期已分配利润	—	—	—
本期末	148,515,984.52	34,605,106.09	183,121,090.61

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	268,267.59
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	77,946.89
其他	5,411.17
合计	351,625.65

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	4,353,273,873.59
减：卖出股票成本总额	4,186,769,293.02
减：交易费用	3,855,567.60
买卖股票差价收入	162,649,012.97

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	92.81
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	494,646.75
合计	494,739.56

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	976,077.94
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	481,300.00
减：应计利息总额	92.15
减：交易费用	39.04
买卖债券差价收入	494,646.75

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	20,130,225.58

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	5,286,315.75
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	5,286,315.75

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	-2,366,639.64
股票投资	-2,288,849.23
债券投资	-77,790.41
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	-2,027,000.00
权证投资	—

股指期货	-2,027,000.00
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	-4,393,639.64

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	229,921.53
基金转换费收入	7,493.10
合计	237,414.63

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	27,273.08
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	7,757.75
其他	38.72
合计	95,069.55

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，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
中国农业银行股份有限公司 (“农业银行”)	基金托管人、基金代销机构
海通期货股份有限公司	基金管理人的股东控制的子公司、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
富国鑫旺均衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)	纳入基金管理人合并财务报表合并范围内的证券投资基金

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	2,235,291,607.49	26.63	837,030,399.29	8.67
海通证券	—	—	82,721,547.41	0.86
申万宏源	256,129,132.40	3.05	393,458,112.52	4.07

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 (%)
国泰海通	267,517.14	27.41	13,907.52	63.39

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	303,781.31	26.63	218,387.02	33.14
申万宏源	34,806.31	3.05	12,948.06	1.96
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	113,760.73	8.67	113,760.73	24.53
海通证券	11,242.24	0.86	—	—
申万宏源	53,475.57	4.07	513.87	0.11

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	5,753,921.97	8,335,878.76
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,961,624.39	2,256,188.74
应支付基金管理人的净管理费	3,792,297.58	6,079,690.02

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.0%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times 1.0\%/当年天数$$

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	863,088.32	1,250,381.76

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

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 1000 指数增强 (LOF) A	富国中证 1000 指数增强 (LOF) C	合计
富国基金管理有限公司	—	64,505.56	64,505.56
国泰海通证券股份有限公司	—	2,473.15	2,473.15
海通期货股份有限公司	—	12.31	12.31
申万宏源证券有限公司	—	1,628.14	1,628.14
合计	—	68,619.16	68,619.16

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 1000 指数增强 (LOF) A	富国中证 1000 指数增强 (LOF) C	合计
富国基金管理有限公司	—	370,623.54	370,623.54
国泰海通证券股份有限公司	—	11,927.21	11,927.21
海通证券股份有限公司	—	23.22	23.22
申万宏源证券有限公司	—	2,323.36	2,323.36
合计	—	384,897.33	384,897.33

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 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，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

份额单位：份

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）	
	富国中证 1000 指数增强（LOF）A	富国中证 1000 指数增强（LOF）C	富国中证 1000 指数增强（LOF）A	富国中证 1000 指数增强（LOF）C
报告期初持有的基金份额	14,851,583.18	—	14,851,583.18	—
报告期内申购/买入总份额	—	—	—	—
报告期内因拆分变动份额	—	—	—	—
减：报告期内赎回/卖出总份额	14,851,583.18	—	—	—
报告期末持有的基金份额	—	—	14,851,583.18	—
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	—	—	3.87%	—

注：本基金管理人投资本基金按照公告的费率条款执行，不存在费率优惠的情况。

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

富国中证 1000 指数增强（LOF）C：

份额单位：份

关联方名称	本期末（2026 年 06 月 30 日）		上年度末（2025 年 12 月 31 日）	
	持有的基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）
富国鑫旺均衡养老 目标三年持有期混 合型发起式基金中 基金（FOF）	2,845,939.59	3.13	—	—

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
中国农业银行股份有 限公司	87,892,678.60	268,267.59	180,404,218.67	582,679.38

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	688635	长进光子	IPO 网下申购	1,271	52,085.58
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	17,168	162,580.96
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 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	4,369	51,554.20
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	1,296	54,302.40
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	3,417	40,320.60
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
申万宏源证券承销保荐有限责任公司	688411	海博思创	IPO 网下申购	5,591	108,353.58

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	30,693	310,306.23	310,306.23	—
001248	华润新能源	2026-06-24	1 个月内（含）	新股认购	10.11	10.11	13,153	132,976.83	132,976.83	—
001257	盛龙股份	2026-03-24	6 个月	新股限售	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	—
001312	福恩股份	2026-04-	6 个月	新股限售	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	—

		14								
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	5,119	51,804.28	141,949.87	—
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	775	8,664.50	13,632.25	—
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	—
603407	长裕集团	2026-04-29	6 个月	新股限售	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	—
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	—
688635	长进光子	2026-05-	6 个月	新股限售	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	—

		20								
688712	北芯生命	2026-01-28	6 个月	新股限售	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	—
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	44,370	382,469.40	2,547,725.40	—
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	2,319	192,616.14	293,237.55	—
688795	摩尔线程	2025-11-26	9 个月	新股限售	114.28	676.94	3,987	455,634.36	2,698,959.78	—
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	3,062	320,468.92	2,354,341.18	—
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	有研复材	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	1,717	16,259.99	120,430.38	—
688820	盛合晶微	2026-04-13	6 个月	新股限售	19.68	141.49	1,773	34,892.64	250,861.77	—

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	190	19,000.00	19,001.33	—
118070	南芯转债	2026-06-18	1 个月内（含）	认购新发证券	100.00	100.01	790	79,000.00	79,004.50	—
118071	华峰转债	2026-06-23	1 个月内（含）	认购新发证券	100.00	100.00	20	2,000.00	2,000.04	—
118072	鼎通转债	2026-06-24	1 个月内（含）	认购新发证券	100.00	100.00	560	56,000.00	56,001.72	—

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	1,248.00	677,308.8 0	1,038,336 .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	352,788.35	457,576.12
未评级	—	—
合计	352,788.35	457,576.12

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。

本基金本报告期末及上年度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	87,892,678.60	—	—	—	87,892,678.60
结算备付金	13,270,664.00	—	—	—	13,270,664.00
存出保证金	293,674.37	—	—	5,422,310.40	5,715,984.77
交易性金融资产	352,788.35	—	—	857,535,478.23	857,888,266.58
应收清算款	—	—	—	538,233.36	538,233.36

应收申购款	—	—	—	5,225,761.48	5,225,761.48
资产总计	101,809,805.32	—	—	868,721,783.47	970,531,588.79
负债					
应付赎回款	—	—	—	9,773,428.40	9,773,428.40
应付管理人报酬	—	—	—	792,004.37	792,004.37
应付托管费	—	—	—	118,800.65	118,800.65
应付销售服务费	—	—	—	43,403.16	43,403.16
应交税费	—	—	—	208,032.41	208,032.41
其他负债	—	—	—	821,251.40	821,251.40
负债总计	—	—	—	11,756,920.39	11,756,920.39
利率敏感度缺口	101,809,805.32	—	—	856,964,863.08	958,774,668.40
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	149,304,441.35	—	—	—	149,304,441.35
结算备付金	19,962,438.62	—	—	—	19,962,438.62
存出保证金	464,656.53	—	—	13,373,323.20	13,837,979.73
交易性金融资产	457,576.12	—	—	1,002,978,974.59	1,003,436,550.71
应收清算款	—	—	—	2,600,875.84	2,600,875.84
应收申购款	—	—	—	1,767,963.97	1,767,963.97
资产总计	170,189,112.62	—	—	1,020,721,137.60	1,190,910,250.22
负债					
应付清算款	—	—	—	1,267,114.98	1,267,114.98
应付赎回款	—	—	—	4,352,946.30	4,352,946.30
应付管理人报酬	—	—	—	984,944.92	984,944.92
应付托管费	—	—	—	147,741.74	147,741.74
应付销售服务费	—	—	—	72,488.18	72,488.18
应交税费	—	—	—	115,553.12	115,553.12
其他负债	—	—	—	780,865.20	780,865.20
负债总计	—	—	—	7,721,654.44	7,721,654.44
利率敏感度缺口	170,189,112.62	—	—	1,012,999,483.16	1,183,188,595.78

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

注：本基金本期末及上年度末均未持有债券资产（不含可转债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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，所面临的最大的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	857,535,478.23	89.44	1,002,978,974.59	84.77
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	352,788.35	0.04	457,576.12	0.04
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	857,888,266.58	89.48	1,003,436,550.71	84.81

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%	9,339,216.59	10,749,484.33
	2. 业绩比较基准减少 1%	-9,339,216.59	-10,749,484.33

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	846,055,802.60	996,212,728.74
第二层次	1,652,793.75	641,740.00
第三层次	10,179,670.23	6,582,081.97
合计	857,888,266.58	1,003,436,550.71

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	857,535,478.23	88.36
	其中：股票	857,535,478.23	88.36
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	352,788.35	0.04
	其中：债券	352,788.35	0.04
	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	101,163,342.60	10.42
8	其他各项资产	11,479,979.61	1.18
9	合计	970,531,588.79	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	1,428,408.00	0.15
B	采矿业	15,052,204.00	1.57
C	制造业	503,864,643.91	52.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,897,945.00	1.35
E	建筑业	12,671,429.00	1.32
F	批发和零售业	11,221,172.00	1.17
G	交通运输、仓储和邮政业	20,727,521.32	2.16
H	住宿和餐饮业	294,840.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	81,499,110.59	8.50
J	金融业	5,837,164.90	0.61
K	房地产业	15,750,820.96	1.64
L	租赁和商务服务业	3,200,919.00	0.33
M	科学研究和技术服务业	12,489,501.00	1.30

N	水利、环境和公共设施管理业	10,182,247.40	1.06
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	998,623.20	0.10
Q	卫生和社会工作	357,638.00	0.04
R	文化、体育和娱乐业	2,323,862.00	0.24
S	综合	370,036.00	0.04
	合计	711,168,086.28	74.17

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	533,683.00	0.06
B	采矿业	4,447,175.82	0.46
C	制造业	116,481,229.72	12.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	631,427.06	0.07
E	建筑业	349,553.00	0.04
F	批发和零售业	5,329,355.00	0.56
G	交通运输、仓储和邮政业	1,064,172.46	0.11
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,765,257.02	1.02
J	金融业	3,118,960.00	0.33
K	房地产业	138,788.00	0.01
L	租赁和商务服务业	532,000.00	0.06
M	科学研究和技术服务业	3,852,150.87	0.40
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	123,640.00	0.01
S	综合	—	—
	合计	146,367,391.95	15.27

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	603083	剑桥科技	41,700	10,628,079.00	1.11
2	688766	普冉股份	13,144	10,076,190.40	1.05

3	688110	东芯股份	44,536	9,071,983.20	0.95
4	688536	思瑞浦	21,364	7,778,418.76	0.81
5	300438	鹏辉能源	89,900	7,448,215.00	0.78
6	688025	杰普特	13,985	6,572,950.00	0.69
7	002222	福晶科技	68,956	6,363,259.68	0.66
8	002497	雅化集团	310,100	6,316,737.00	0.66
9	688390	固德威	56,178	6,095,874.78	0.64
10	601678	滨化股份	888,606	5,855,913.54	0.61
11	688127	蓝特光学	59,691	5,825,841.60	0.61
12	301396	宏景科技	16,980	5,630,568.00	0.59
13	603127	昭衍新药	147,200	5,625,984.00	0.59
14	002468	申通快递	384,500	5,598,320.00	0.58
15	301511	德福科技	38,800	5,581,380.00	0.58
16	603588	高能环境	277,500	5,328,000.00	0.56
17	688388	嘉元科技	118,740	5,224,560.00	0.54
18	688700	东威科技	56,822	5,079,886.80	0.53
19	300503	昊志机电	53,200	4,910,360.00	0.51
20	603929	亚翔集成	17,800	4,841,956.00	0.51
21	688717	艾罗能源	58,048	4,793,023.36	0.50
22	601677	明泰铝业	275,500	4,573,300.00	0.48
23	688368	晶丰明源	21,113	4,571,386.76	0.48
24	301031	中熔电气	37,236	4,447,840.20	0.46
25	688321	微芯生物	166,409	4,381,548.97	0.46
26	688668	鼎通科技	11,592	4,327,293.60	0.45
27	688543	国科军工	108,461	4,278,786.45	0.45
28	300850	新强联	153,800	4,121,840.00	0.43
29	002345	潮宏基	447,600	4,104,492.00	0.43
30	600186	莲花控股	287,600	4,026,400.00	0.42
31	003010	若羽臣	165,000	4,009,500.00	0.42
32	688690	纳微科技	89,944	3,966,530.40	0.41
33	301219	腾远钴业	72,358	3,965,218.40	0.41
34	301345	涛涛车业	17,100	3,950,100.00	0.41
35	002518	科士达	73,200	3,922,788.00	0.41
36	600502	安徽建工	896,900	3,901,515.00	0.41
37	000059	华锦股份	1,026,900	3,850,875.00	0.40
38	600064	南京高科	538,864	3,842,100.32	0.40
39	000990	诚志股份	453,600	3,710,448.00	0.39
40	688515	裕太微	14,904	3,707,519.04	0.39
41	600323	瀚蓝环境	134,640	3,697,214.40	0.39
42	301217	铜冠铜箔	21,900	3,615,033.00	0.38
43	002838	道恩股份	117,400	3,594,788.00	0.37

44	603162	海通发展	395,856	3,550,828.32	0.37
45	688503	聚和材料	26,462	3,511,507.40	0.37
46	603306	华懋科技	33,400	3,463,246.00	0.36
47	002354	天娱数科	369,500	3,436,350.00	0.36
48	001914	招商积余	419,500	3,423,120.00	0.36
49	002946	新乳业	238,500	3,358,080.00	0.35
50	601083	锦江航运	336,100	3,340,834.00	0.35
51	688167	炬光科技	9,392	3,326,740.32	0.35
52	688409	富创精密	10,740	3,289,125.00	0.34
53	605599	菜百股份	237,700	3,256,490.00	0.34
54	000636	风华高科	44,500	3,214,680.00	0.34
55	002716	湖南白银	393,400	3,182,606.00	0.33
56	688327	云从科技	253,146	3,154,199.16	0.33
57	688630	芯碁微装	5,653	3,105,701.67	0.32
58	002755	奥赛康	226,700	3,087,654.00	0.32
59	002245	蔚蓝锂芯	164,612	3,079,890.52	0.32
60	688559	海目星	36,585	3,070,213.20	0.32
61	688372	伟测科技	16,491	3,067,326.00	0.32
62	002428	云南锗业	25,100	3,016,518.00	0.31
63	603063	禾望电气	56,800	3,004,152.00	0.31
64	002484	江海股份	28,400	2,982,000.00	0.31
65	688262	国芯科技	68,973	2,981,702.79	0.31
66	300568	星源材质	158,700	2,970,864.00	0.31
67	002701	奥瑞金	684,100	2,914,266.00	0.30
68	688627	精智达	4,014	2,870,010.00	0.30
69	000581	威孚高科	167,900	2,857,658.00	0.30
70	688519	南亚新材	7,486	2,844,979.44	0.30
71	002947	恒铭达	37,300	2,836,665.00	0.30
72	002408	齐翔腾达	599,900	2,813,531.00	0.29
73	688048	长光华芯	5,494	2,757,988.00	0.29
74	300672	国科微	9,300	2,743,500.00	0.29
75	000923	河钢资源	218,100	2,706,621.00	0.28
76	301316	慧博云通	68,200	2,685,716.00	0.28
77	688146	中船特气	7,648	2,676,723.52	0.28
78	601208	东材科技	37,600	2,661,704.00	0.28
79	000973	佛塑科技	185,000	2,654,750.00	0.28
80	300613	富瀚微	32,900	2,634,632.00	0.27
81	600773	西藏城投	200,100	2,575,287.00	0.27
82	600686	金龙汽车	223,000	2,517,670.00	0.26
83	300236	上海新阳	18,700	2,459,050.00	0.26
84	600577	精达股份	247,481	2,420,364.18	0.25

85	600641	先导基电	60,700	2,419,502.00	0.25
86	001339	智微智能	23,640	2,417,899.20	0.25
87	002747	埃斯顿	64,700	2,415,251.00	0.25
88	002373	千方科技	325,000	2,333,500.00	0.24
89	605123	派克新材	23,900	2,318,539.00	0.24
90	600331	宏达股份	209,800	2,305,702.00	0.24
91	601975	招商南油	611,800	2,282,014.00	0.24
92	000600	建投能源	260,500	2,279,375.00	0.24
93	301216	万凯新材	97,900	2,250,721.00	0.23
94	301626	苏州天脉	5,800	2,226,968.00	0.23
95	002043	兔 宝 宝	199,100	2,206,028.00	0.23
96	002948	青岛银行	433,330	2,201,316.40	0.23
97	605376	博迁新材	8,100	2,197,530.00	0.23
98	603283	赛腾股份	26,440	2,141,111.20	0.22
99	688141	杰华特	13,713	2,104,945.50	0.22
100	300409	道氏技术	104,100	2,074,713.00	0.22
101	600740	山西焦化	636,807	2,031,414.33	0.21
102	300049	福瑞医科	51,800	2,013,984.00	0.21
103	000612	焦作万方	188,900	2,000,451.00	0.21
104	600201	生物股份	169,800	1,978,170.00	0.21
105	600961	株冶集团	60,200	1,949,878.00	0.20
106	603663	三祥新材	20,100	1,935,630.00	0.20
107	600869	远东股份	57,700	1,931,219.00	0.20
108	603619	中曼石油	101,800	1,904,678.00	0.20
109	688195	腾景科技	9,860	1,898,838.80	0.20
110	002544	普天科技	102,300	1,863,906.00	0.19
111	001337	四川黄金	50,800	1,862,328.00	0.19
112	300416	苏试试验	91,000	1,854,580.00	0.19
113	002182	宝武镁业	116,800	1,818,576.00	0.19
114	688158	优刻得	48,998	1,801,166.48	0.19
115	300775	三角防务	81,700	1,800,668.00	0.19
116	600353	旭光电子	39,300	1,792,080.00	0.19
117	600409	三友化工	289,900	1,771,289.00	0.18
118	600330	天通股份	57,300	1,767,132.00	0.18
119	000810	创维数字	133,000	1,762,250.00	0.18
120	301371	敷尔佳	65,900	1,713,400.00	0.18
121	300772	运达股份	139,000	1,709,700.00	0.18
122	600667	太极实业	58,500	1,707,030.00	0.18
123	300323	华灿光电	82,600	1,685,040.00	0.18
124	688353	华盛锂电	14,416	1,673,265.12	0.17
125	300777	中简科技	63,500	1,668,780.00	0.17

126	688279	峰岷科技	7,280	1,633,923.20	0.17
127	300821	东岳硅材	78,700	1,618,072.00	0.17
128	000778	新兴铸管	435,500	1,615,705.00	0.17
129	002326	永太科技	68,200	1,612,930.00	0.17
130	688593	新相微	41,195	1,603,309.40	0.17
131	688392	骄成超声	7,042	1,599,801.56	0.17
132	603317	天味食品	122,700	1,596,327.00	0.17
133	002170	芭田股份	142,300	1,545,378.00	0.16
134	002364	中恒电气	28,500	1,533,300.00	0.16
135	605111	新洁能	15,400	1,526,756.00	0.16
136	688779	五矿新能	187,487	1,520,519.57	0.16
137	601777	千里科技	184,800	1,507,968.00	0.16
138	000811	冰轮环境	26,771	1,505,065.62	0.16
139	301392	汇成真空	5,200	1,500,928.00	0.16
140	300870	欧陆通	4,320	1,493,380.80	0.16
141	600206	有研新材	22,400	1,491,840.00	0.16
142	301500	飞南资源	56,900	1,482,245.00	0.15
143	688063	派能科技	27,810	1,481,438.70	0.15
144	301510	固高科技	46,200	1,475,166.00	0.15
145	300428	立中集团	80,800	1,468,944.00	0.15
146	600710	苏美达	152,800	1,460,768.00	0.15
147	600123	兰花科创	270,900	1,446,606.00	0.15
148	300723	一品红	38,700	1,442,736.00	0.15
149	601636	旗滨集团	139,100	1,422,993.00	0.15
150	300456	赛微电子	33,300	1,414,251.00	0.15
151	688150	莱特光电	20,587	1,412,679.94	0.15
152	688548	广钢气体	26,504	1,380,858.40	0.14
153	300806	斯迪克	12,200	1,366,400.00	0.14
154	002928	华夏航空	194,600	1,360,254.00	0.14
155	000935	四川双马	51,700	1,348,853.00	0.14
156	002270	华明装备	70,600	1,330,810.00	0.14
157	603876	鼎胜新材	50,800	1,321,308.00	0.14
158	002706	良信股份	118,519	1,293,042.29	0.13
159	603005	晶方科技	23,800	1,282,106.00	0.13
160	300926	博俊科技	72,000	1,278,000.00	0.13
161	300257	开山股份	44,500	1,276,260.00	0.13
162	300031	宝通科技	44,200	1,262,794.00	0.13
163	002993	奥海科技	17,500	1,253,175.00	0.13
164	603516	淳中科技	9,300	1,251,873.00	0.13
165	603057	紫燕食品	56,100	1,251,030.00	0.13
166	002922	伊戈尔	37,800	1,239,840.00	0.13

167	002840	华统股份	169,600	1,236,384.00	0.13
168	000555	神州信息	119,936	1,235,340.80	0.13
169	300184	力源信息	70,100	1,230,255.00	0.13
170	301101	明月镜片	45,000	1,225,800.00	0.13
171	300693	盛弘股份	24,900	1,213,875.00	0.13
172	301029	怡合达	44,700	1,207,347.00	0.13
173	688800	瑞可达	12,570	1,206,342.90	0.13
174	300657	弘信电子	27,300	1,201,746.00	0.13
175	002636	金安国纪	10,000	1,199,700.00	0.13
176	603612	索通发展	65,900	1,194,767.00	0.12
177	688131	皓元医药	12,610	1,192,906.00	0.12
178	688486	龙迅股份	18,389	1,169,172.62	0.12
179	001287	中电港	37,000	1,152,550.00	0.12
180	301389	隆扬电子	13,000	1,128,270.00	0.12
181	002163	海南发展	134,200	1,119,228.00	0.12
182	601778	晶科科技	260,000	1,118,000.00	0.12
183	601126	四方股份	17,600	1,112,320.00	0.12
184	600246	万通发展	58,200	1,105,800.00	0.12
185	603124	江南新材	5,900	1,103,182.00	0.12
186	688516	奥特维	19,218	1,102,921.02	0.12
187	601107	四川成渝	224,900	1,097,512.00	0.11
188	688326	经纬恒润	15,419	1,092,898.72	0.11
189	600490	鹏欣资源	187,600	1,091,832.00	0.11
190	600395	盘江股份	239,200	1,090,752.00	0.11
191	002396	星网锐捷	56,390	1,080,996.30	0.11
192	601963	重庆银行	106,600	1,074,528.00	0.11
193	688403	汇成股份	26,940	1,069,518.00	0.11
194	001267	汇绿生态	19,900	1,064,650.00	0.11
195	603393	新天然气	49,700	1,064,077.00	0.11
196	002545	东方铁塔	65,600	1,064,032.00	0.11
197	300337	银邦股份	91,100	1,062,226.00	0.11
198	002077	大港股份	55,000	1,060,950.00	0.11
199	002048	宁波华翔	46,100	1,060,300.00	0.11
200	603638	艾迪精密	45,200	1,059,940.00	0.11
201	688776	国光电气	17,231	1,056,949.54	0.11
202	002456	欧菲光	111,600	1,055,736.00	0.11
203	000420	吉林化纤	260,600	1,055,430.00	0.11
204	300602	飞荣达	20,600	1,054,720.00	0.11
205	300493	润欣科技	70,500	1,051,155.00	0.11
206	001301	尚太科技	11,200	1,047,312.00	0.11
207	603025	大豪科技	76,600	1,044,824.00	0.11

208	002506	协鑫集成	328,300	1,043,994.00	0.11
209	301487	盟固利	54,500	1,043,675.00	0.11
210	688484	南芯科技	18,461	1,042,861.89	0.11
211	300342	天银机电	22,000	1,034,000.00	0.11
212	300065	海兰信	46,200	1,030,722.00	0.11
213	300036	超图软件	91,208	1,027,914.16	0.11
214	002654	万润科技	45,300	1,008,378.00	0.11
215	002534	西子洁能	54,300	1,007,265.00	0.11
216	002913	奥士康	15,699	1,003,794.06	0.10
217	002895	川恒股份	34,200	998,640.00	0.10
218	300492	华图山鼎	29,072	998,623.20	0.10
219	002317	众生药业	40,600	997,542.00	0.10
220	603220	中贝通信	46,400	991,568.00	0.10
221	000534	万泽股份	36,200	990,432.00	0.10
222	002511	中顺洁柔	147,900	983,535.00	0.10
223	300773	拉卡拉	63,700	974,610.00	0.10
224	002104	恒宝股份	94,500	974,295.00	0.10
225	002110	三钢闽光	338,200	974,016.00	0.10
226	600750	华润江中	44,100	973,287.00	0.10
227	601619	嘉泽新能	225,100	967,930.00	0.10
228	002643	万润股份	45,700	957,415.00	0.10
229	002174	游族网络	74,400	938,184.00	0.10
230	688107	安路科技	20,560	937,536.00	0.10
231	300296	利亚德	166,100	930,160.00	0.10
232	300199	翰宇药业	42,100	929,568.00	0.10
233	300088	长信科技	80,000	928,000.00	0.10
234	600266	城建发展	236,504	924,730.64	0.10
235	300776	帝尔激光	4,300	924,328.00	0.10
236	600114	东睦股份	24,400	921,344.00	0.10
237	300224	正海磁材	68,900	918,437.00	0.10
238	000719	中原传媒	79,800	912,114.00	0.10
239	002536	飞龙股份	19,300	910,574.00	0.09
240	301205	联特科技	2,700	902,070.00	0.09
241	002315	焦点科技	38,700	900,936.00	0.09
242	300762	上海瀚讯	19,705	899,533.25	0.09
243	300102	乾照光电	34,400	895,776.00	0.09
244	000875	电投绿能	171,500	883,225.00	0.09
245	600391	航发科技	26,300	879,735.00	0.09
246	600552	凯盛科技	26,800	873,144.00	0.09
247	000962	东方钽业	9,600	869,760.00	0.09
248	002458	益生股份	111,700	867,909.00	0.09

249	600037	歌华有线	138,200	866,514.00	0.09
250	688208	道通科技	34,344	865,125.36	0.09
251	002539	云图控股	76,199	862,572.68	0.09
252	300398	飞凯材料	13,900	858,325.00	0.09
253	002611	东方精工	48,500	856,510.00	0.09
254	000969	安泰科技	34,600	849,084.00	0.09
255	603319	美湖股份	25,500	846,855.00	0.09
256	002151	北斗星通	26,600	844,550.00	0.09
257	300738	奥飞数据	41,000	829,020.00	0.09
258	300468	四方精创	39,100	821,491.00	0.09
259	600821	金开新能	129,900	811,875.00	0.08
260	600057	厦门象屿	149,700	811,374.00	0.08
261	603328	依顿电子	64,700	810,691.00	0.08
262	002807	江阴银行	217,830	808,149.30	0.08
263	002557	洽洽食品	44,900	806,404.00	0.08
264	002320	海峡股份	128,500	805,695.00	0.08
265	600751	海航科技	275,300	801,123.00	0.08
266	688068	热景生物	9,241	800,270.60	0.08
267	688102	斯瑞新材	16,895	797,106.10	0.08
268	688552	航天南湖	28,316	796,529.08	0.08
269	000688	国城矿业	23,100	790,713.00	0.08
270	301550	斯菱智驱	8,600	786,298.00	0.08
271	301291	明阳电气	21,700	780,983.00	0.08
272	605196	华通线缆	29,900	780,390.00	0.08
273	300101	振芯科技	48,000	776,160.00	0.08
274	002979	雷赛智能	13,900	775,342.00	0.08
275	002046	国机精工	10,500	773,325.00	0.08
276	002488	金固股份	86,200	768,042.00	0.08
277	002215	诺普信	92,400	760,452.00	0.08
278	002563	森马服饰	149,800	754,992.00	0.08
279	688147	微导纳米	4,633	749,990.04	0.08
280	300315	掌趣科技	192,000	748,800.00	0.08
281	300303	聚飞光电	67,600	747,656.00	0.08
282	301631	壹连科技	10,400	747,344.00	0.08
283	000813	德展健康	245,600	744,168.00	0.08
284	000690	宝新能源	153,500	721,450.00	0.08
285	300378	鼎捷数智	19,700	711,170.00	0.07
286	603826	坤彩科技	27,700	708,012.00	0.07
287	601020	华钰矿业	29,400	705,306.00	0.07
288	301018	申菱环境	6,000	693,660.00	0.07
289	600933	爱柯迪	45,300	669,534.00	0.07

290	300166	东方国信	37,800	669,438.00	0.07
291	002906	华阳集团	26,300	656,448.00	0.07
292	688300	联瑞新材	2,680	654,992.00	0.07
293	688362	甬矽电子	6,792	654,748.80	0.07
294	688123	聚辰股份	3,078	654,382.80	0.07
295	300811	铂科新材	6,800	645,252.00	0.07
296	301522	上大股份	24,500	641,165.00	0.07
297	002911	佛燃能源	67,400	639,626.00	0.07
298	603915	国茂股份	44,586	632,675.34	0.07
299	603169	兰石重装	88,700	627,996.00	0.07
300	601918	新集能源	72,900	626,211.00	0.07
301	002017	东信和平	42,300	618,849.00	0.06
302	000672	上峰材料	26,000	615,680.00	0.06
303	301215	中汽股份	118,300	613,977.00	0.06
304	002015	协鑫能科	37,600	613,632.00	0.06
305	000685	中山公用	54,800	611,568.00	0.06
306	002847	盐津铺子	13,700	611,020.00	0.06
307	300682	朗新科技	61,700	610,830.00	0.06
308	601137	博威合金	27,300	609,609.00	0.06
309	002531	天顺风能	72,300	609,489.00	0.06
310	603009	北特科技	12,700	609,219.00	0.06
311	600012	皖通高速	38,400	605,184.00	0.06
312	688097	博众精工	9,568	603,262.40	0.06
313	600075	新疆天业	148,800	601,152.00	0.06
314	600963	岳阳林纸	197,400	600,096.00	0.06
315	002258	利尔化学	46,820	595,082.20	0.06
316	002176	江特电机	58,900	589,589.00	0.06
317	600259	中稀有色	5,800	589,338.00	0.06
318	600575	淮河能源	184,400	588,236.00	0.06
319	603599	广信股份	60,800	582,464.00	0.06
320	600649	城投控股	167,700	578,565.00	0.06
321	002237	恒邦股份	39,100	574,379.00	0.06
322	688205	德科立	2,756	573,771.64	0.06
323	002149	西部材料	10,600	572,506.00	0.06
324	300253	卫宁健康	84,800	570,704.00	0.06
325	688596	正帆科技	7,157	565,832.42	0.06
326	603360	百傲化学	34,100	555,148.00	0.06
327	300684	中石科技	9,100	555,100.00	0.06
328	002145	钛能化学	117,700	554,367.00	0.06
329	603678	火炬电子	6,600	547,800.00	0.06
330	300855	图南股份	17,500	547,050.00	0.06

331	600971	恒源煤电	79,200	546,480.00	0.06
332	600866	星湖科技	124,400	546,116.00	0.06
333	301339	通行宝	51,100	522,753.00	0.05
334	301061	匠心家居	14,800	519,036.00	0.05
335	603881	数据港	20,760	519,000.00	0.05
336	600550	保变电气	43,700	512,601.00	0.05
337	002405	四维图新	78,600	508,542.00	0.05
338	688088	虹软科技	14,272	507,369.60	0.05
339	688545	兴福电子	3,742	497,910.52	0.05
340	688660	电气风电	57,745	497,761.90	0.05
341	002516	旷达科技	88,624	494,521.92	0.05
342	600986	浙文互联	70,700	493,486.00	0.05
343	600094	大名城	142,600	493,396.00	0.05
344	600757	长江传媒	67,000	489,770.00	0.05
345	300085	银之杰	13,900	486,083.00	0.05
346	600361	创新新材	134,700	484,920.00	0.05
347	300131	英唐智控	25,200	479,556.00	0.05
348	600718	东软集团	65,500	474,220.00	0.05
349	300779	惠城环保	9,444	474,088.80	0.05
350	688333	铂力特	4,628	473,907.20	0.05
351	600301	华锡有色	7,700	472,164.00	0.05
352	300814	中富电路	2,300	470,350.00	0.05
353	601900	南方传媒	43,300	470,238.00	0.05
354	600338	西藏珠峰	30,600	466,344.00	0.05
355	002063	远光软件	90,700	462,570.00	0.05
356	300319	麦捷科技	15,600	462,228.00	0.05
357	000913	钱江摩托	45,000	461,250.00	0.05
358	600113	浙江东日	13,900	461,202.00	0.05
359	002901	大博医疗	11,000	459,580.00	0.05
360	605099	共创草坪	14,100	454,020.00	0.05
361	300098	高新兴	98,000	449,820.00	0.05
362	603267	鸿远电子	5,800	449,384.00	0.05
363	603323	苏农银行	115,960	448,765.20	0.05
364	300007	汉威科技	11,700	446,940.00	0.05
365	300655	晶瑞电材	20,815	445,857.30	0.05
366	002093	国脉科技	70,500	444,150.00	0.05
367	600556	天下秀	100,400	443,768.00	0.05
368	301413	安培龙	6,190	438,747.20	0.05
369	301153	中科江南	26,900	438,201.00	0.05
370	688031	星环科技	3,802	437,914.36	0.05
371	002378	章源钨业	12,894	431,691.12	0.05

372	301127	武汉天源	20,800	430,976.00	0.04
373	300990	同飞股份	4,100	430,787.00	0.04
374	688116	天奈科技	11,236	429,215.20	0.04
375	301050	雷电微力	12,700	424,688.00	0.04
376	000680	山推股份	42,000	422,100.00	0.04
377	600226	亨通股份	44,000	421,960.00	0.04
378	300170	汉得信息	27,400	417,576.00	0.04
379	000885	城发环境	34,600	416,238.00	0.04
380	002859	洁美科技	3,800	416,138.00	0.04
381	300687	赛意信息	13,400	415,400.00	0.04
382	603305	旭升集团	34,200	414,504.00	0.04
383	600996	贵广网络	59,200	410,848.00	0.04
384	000758	中色股份	62,100	407,997.00	0.04
385	688449	联芸科技	4,723	407,642.13	0.04
386	601890	亚星锚链	49,000	400,330.00	0.04
387	002100	天康生物	63,400	400,054.00	0.04
388	301275	汉朔科技	8,900	399,610.00	0.04
389	002338	奥普光电	6,900	394,680.00	0.04
390	300034	钢研高纳	23,000	394,220.00	0.04
391	603530	神马电力	7,700	391,930.00	0.04
392	300083	创世纪	28,700	390,894.00	0.04
393	301268	铭利达	27,900	390,042.00	0.04
394	300113	顺网科技	21,300	387,873.00	0.04
395	002400	省广集团	60,900	384,279.00	0.04
396	002139	拓邦股份	40,200	382,704.00	0.04
397	603297	永新光学	2,600	382,070.00	0.04
398	688252	天德钰	15,860	380,640.00	0.04
399	688586	江航装备	32,436	379,176.84	0.04
400	002985	北摩高科	13,600	376,720.00	0.04
401	002290	禾盛新材	4,100	376,667.00	0.04
402	002324	普利特	31,100	375,377.00	0.04
403	000550	江铃汽车	23,000	373,060.00	0.04
404	002099	海翔药业	70,100	370,128.00	0.04
405	000833	粤桂股份	15,800	370,036.00	0.04
406	002897	意华股份	4,200	369,516.00	0.04
407	600389	江山股份	18,900	368,928.00	0.04
408	600328	中盐化工	61,400	368,400.00	0.04
409	000791	甘肃能源	48,400	367,840.00	0.04
410	002745	木林森	29,000	363,950.00	0.04
411	600459	贵研铂业	12,600	363,888.00	0.04
412	001896	豫能控股	21,900	363,759.00	0.04

413	688182	灿勤科技	8,428	362,993.96	0.04
414	600179	安通控股	82,300	362,120.00	0.04
415	301489	思泉新材	2,200	362,076.00	0.04
416	600151	航天机电	32,200	361,284.00	0.04
417	301381	赛维时代	19,500	359,580.00	0.04
418	300134	大富科技	42,000	359,100.00	0.04
419	301175	中科环保	72,500	358,875.00	0.04
420	000966	长源电力	91,000	356,720.00	0.04
421	688006	杭可科技	9,737	355,887.35	0.04
422	300680	隆盛科技	15,460	351,251.20	0.04
423	688726	拉普拉斯	6,636	350,712.60	0.04
424	000829	天音控股	44,900	350,220.00	0.04
425	002020	京新药业	27,880	348,221.20	0.04
426	600345	长江通信	5,300	347,203.00	0.04
427	000950	重药控股	69,300	347,193.00	0.04
428	002839	张家港行	88,800	346,320.00	0.04
429	300077	国民技术	11,000	344,850.00	0.04
430	600531	豫光金铅	23,300	343,908.00	0.04
431	300045	华力创通	19,900	343,076.00	0.04
432	688591	泰凌微	9,839	338,264.82	0.04
433	300634	彩讯股份	17,200	336,604.00	0.04
434	600063	皖维高新	44,200	335,920.00	0.04
435	600210	紫江企业	54,100	335,420.00	0.03
436	300638	广和通	17,900	331,329.00	0.03
437	002537	海联金汇	62,100	328,509.00	0.03
438	688531	日联科技	1,846	328,292.64	0.03
439	300768	迪普科技	23,500	323,595.00	0.03
440	600285	羚锐制药	16,600	321,708.00	0.03
441	300260	新莱应材	3,200	321,472.00	0.03
442	600888	新疆众和	20,100	319,389.00	0.03
443	300809	华辰装备	11,700	316,485.00	0.03
444	000681	视觉中国	15,600	311,064.00	0.03
445	601069	西部黄金	14,100	310,200.00	0.03
446	300861	美畅股份	12,300	309,837.00	0.03
447	000048	京基智农	14,000	309,260.00	0.03
448	688352	颀中科技	12,662	306,167.16	0.03
449	300153	科泰电源	13,400	303,108.00	0.03
450	600273	嘉化能源	46,400	302,528.00	0.03
451	300576	容大感光	5,900	302,198.00	0.03
452	688549	中巨芯	8,178	301,032.18	0.03
453	002216	三全食品	25,900	298,627.00	0.03

454	301177	迪阿股份	10,800	297,756.00	0.03
455	600258	首旅酒店	27,000	294,840.00	0.03
456	000628	高新发展	6,200	293,880.00	0.03
457	688153	唯捷创芯	8,978	288,373.36	0.03
458	300457	赢合科技	13,500	284,580.00	0.03
459	301095	广立微	2,400	283,320.00	0.03
460	002941	新疆交建	29,900	282,256.00	0.03
461	600446	金证股份	27,900	280,674.00	0.03
462	603301	振德医疗	3,200	278,912.00	0.03
463	002434	万里扬	45,600	275,880.00	0.03
464	002181	粤传媒	27,700	275,615.00	0.03
465	000762	西藏矿业	10,300	275,010.00	0.03
466	601969	海南矿业	34,500	272,895.00	0.03
467	300593	新雷能	9,000	270,540.00	0.03
468	300185	通裕重工	98,300	268,359.00	0.03
469	002171	楚江新材	19,500	264,615.00	0.03
470	002416	爱施德	29,400	263,424.00	0.03
471	600388	紫金龙净	18,100	263,355.00	0.03
472	002617	露笑科技	25,500	262,395.00	0.03
473	002276	万马股份	25,600	258,816.00	0.03
474	601375	中原证券	64,400	256,956.00	0.03
475	603505	金石资源	12,700	255,905.00	0.03
476	601187	厦门银行	36,800	251,344.00	0.03
477	300747	锐科激光	4,700	249,523.00	0.03
478	301171	易点天下	7,300	247,908.00	0.03
479	000029	深深房A	11,200	246,960.00	0.03
480	002639	雪人集团	17,734	246,679.94	0.03
481	300827	上能电气	8,000	246,320.00	0.03
482	300455	航天智装	11,400	245,556.00	0.03
483	600248	陕建股份	91,900	245,373.00	0.03
484	002668	TCL智家	22,100	244,868.00	0.03
485	600635	大众公用	56,400	241,392.00	0.03
486	002368	太极股份	17,200	240,628.00	0.03
487	002006	精工科技	16,100	236,831.00	0.02
488	000766	通化金马	12,000	232,800.00	0.02
489	300327	中颖电子	7,200	230,760.00	0.02
490	301571	国科天成	3,500	228,130.00	0.02
491	603698	航天工程	5,800	223,648.00	0.02
492	002549	凯美特气	10,600	223,130.00	0.02
493	600416	湘电股份	22,600	221,480.00	0.02
494	603613	国联股份	12,000	221,040.00	0.02

495	002158	汉钟精机	5,900	218,772.00	0.02
496	002768	国恩股份	4,200	218,652.00	0.02
497	002267	陕天然气	33,300	217,782.00	0.02
498	600664	哈药股份	72,700	217,373.00	0.02
499	002550	千红制药	34,500	214,245.00	0.02
500	300363	博腾股份	13,000	211,120.00	0.02
501	688652	京仪装备	1,053	210,779.01	0.02
502	600480	凌云股份	25,300	210,243.00	0.02
503	605333	沪光股份	12,300	209,715.00	0.02
504	600267	海正药业	20,700	209,277.00	0.02
505	000422	湖北宜化	14,700	206,535.00	0.02
506	000901	航天科技	11,600	206,364.00	0.02
507	600916	中国黄金	30,100	205,884.00	0.02
508	600366	宁波韵升	14,009	205,652.12	0.02
509	600216	浙江医药	18,000	205,200.00	0.02
510	603887	城地香江	21,700	202,678.00	0.02
511	300244	迪安诊断	10,600	198,644.00	0.02
512	688523	航天环宇	3,776	197,862.40	0.02
513	301087	可孚医疗	4,100	195,365.00	0.02
514	300573	兴齐眼药	4,770	194,425.20	0.02
515	300119	瑞普生物	13,400	193,362.00	0.02
516	601595	上海电影	11,500	190,900.00	0.02
517	002003	伟星股份	22,200	186,924.00	0.02
518	000727	冠捷科技	67,600	184,548.00	0.02
519	000928	中钢国际	36,700	182,766.00	0.02
520	301078	孩子王	26,700	180,492.00	0.02
521	605020	永和股份	4,400	179,168.00	0.02
522	300443	金雷股份	8,200	176,956.00	0.02
523	600158	中体产业	26,200	176,588.00	0.02
524	002097	山河智能	24,100	174,243.00	0.02
525	002541	鸿路钢构	10,000	173,200.00	0.02
526	301035	润丰股份	3,690	171,216.00	0.02
527	688612	威迈斯	5,785	171,178.15	0.02
528	002226	江南化工	38,000	170,620.00	0.02
529	688001	华兴源创	1,970	168,829.00	0.02
530	600728	佳都科技	39,500	168,270.00	0.02
531	600320	振华重工	40,600	167,678.00	0.02
532	688522	纳睿雷达	8,371	167,587.42	0.02
533	000543	皖能电力	22,100	167,297.00	0.02
534	603108	润达医疗	18,700	166,430.00	0.02
535	300348	长亮科技	18,700	164,560.00	0.02

536	002498	汉缆股份	24,100	164,362.00	0.02
537	002023	海特高新	12,500	162,000.00	0.02
538	000506	招金黄金	13,800	161,736.00	0.02
539	002192	融捷股份	1,800	160,920.00	0.02
540	300624	万兴科技	3,100	160,797.00	0.02
541	301293	三博脑科	3,300	158,994.00	0.02
542	600133	东湖高新	20,100	158,790.00	0.02
543	003006	百亚股份	10,900	158,159.00	0.02
544	002221	东华能源	30,000	157,800.00	0.02
545	002891	中宠股份	5,900	157,648.00	0.02
546	002675	东诚药业	12,400	155,620.00	0.02
547	301600	慧翰股份	1,700	155,380.00	0.02
548	300674	宇信科技	10,120	152,306.00	0.02
549	001236	弘业期货	21,900	152,205.00	0.02
550	002073	软控股份	29,500	151,630.00	0.02
551	000065	北方国际	15,200	149,416.00	0.02
552	300702	天宇股份	7,400	149,184.00	0.02
553	603871	嘉友国际	14,600	149,066.00	0.02
554	603337	杰克科技	4,100	148,543.00	0.02
555	603219	富佳股份	9,400	146,452.00	0.02
556	600163	中闽能源	27,900	143,685.00	0.01
557	688062	迈威生物	5,050	142,662.50	0.01
558	600639	浦东金桥	15,500	141,360.00	0.01
559	600461	洪城环境	15,600	141,336.00	0.01
560	688567	孚能科技	13,453	141,256.50	0.01
561	002204	大连重工	26,714	141,049.92	0.01
562	002004	华邦健康	35,700	140,301.00	0.01
563	300761	立华股份	8,500	139,485.00	0.01
564	301327	华宝新能	2,900	139,403.00	0.01
565	002183	怡 亚 通	26,100	139,113.00	0.01
566	002212	天融信	23,200	138,736.00	0.01
567	600997	开滦股份	29,000	137,750.00	0.01
568	688005	容百科技	4,485	137,241.00	0.01
569	300872	天阳科技	8,600	135,880.00	0.01
570	301297	富乐德	2,200	134,728.00	0.01
571	002925	盈趣科技	5,400	133,164.00	0.01
572	300580	贝斯特	6,600	132,726.00	0.01
573	002832	比音勒芬	6,400	132,096.00	0.01
574	300618	寒锐钴业	3,700	132,090.00	0.01
575	688408	中信博	4,107	132,040.05	0.01
576	301662	宏工科技	1,300	131,716.00	0.01

577	002075	沙钢股份	38,700	131,580.00	0.01
578	601096	宏盛华源	30,200	131,068.00	0.01
579	603358	华达科技	3,000	130,500.00	0.01
580	601089	福元医药	7,900	128,612.00	0.01
581	002053	云南能投	13,000	127,790.00	0.01
582	600596	新安股份	8,000	127,680.00	0.01
583	002036	联创电子	16,800	127,176.00	0.01
584	688691	灿芯股份	1,093	126,711.49	0.01
585	603039	泛微网络	3,500	126,245.00	0.01
586	002246	北化股份	6,700	125,960.00	0.01
587	002243	力合科创	19,100	125,487.00	0.01
588	688091	上海谊众	3,107	124,901.40	0.01
589	000682	东方电子	9,815	123,963.45	0.01
590	603027	千禾味业	17,666	123,132.02	0.01
591	603118	共进股份	10,100	122,311.00	0.01
592	002572	索菲亚	16,700	121,910.00	0.01
593	300035	中科电气	8,400	121,128.00	0.01
594	000058	深赛格	19,700	120,958.00	0.01
595	688050	爱博医疗	3,277	119,446.65	0.01
596	600059	古越龙山	16,300	119,316.00	0.01
597	603567	珍宝岛	27,200	119,136.00	0.01
598	600623	华谊集团	14,700	118,629.00	0.01
599	002960	青鸟智控	13,900	117,733.00	0.01
600	688382	益方生物	6,393	115,074.00	0.01
601	688083	中望软件	1,776	114,996.00	0.01
602	300075	数字政通	11,200	114,464.00	0.01
603	300415	伊之密	5,700	113,487.00	0.01
604	000848	承德露露	15,200	112,480.00	0.01
605	603997	继峰股份	9,500	112,385.00	0.01
606	002727	一心堂	11,700	112,203.00	0.01
607	002965	祥鑫科技	2,200	112,090.00	0.01
608	002041	登海种业	14,200	111,754.00	0.01
609	002250	联化科技	8,100	110,727.00	0.01
610	300008	天海防务	18,100	109,686.00	0.01
611	002882	金龙羽	5,800	109,562.00	0.01
612	600643	爱建集团	29,400	109,074.00	0.01
613	300341	麦克奥迪	8,100	107,325.00	0.01
614	002101	广东鸿图	11,200	106,848.00	0.01
615	688698	伟创电气	2,027	106,316.15	0.01
616	300080	易成新能	28,200	106,032.00	0.01
617	300660	江苏雷利	3,800	105,868.00	0.01

618	600399	抚顺特钢	25,700	105,627.00	0.01
619	000767	晋控电力	27,000	103,410.00	0.01
620	600726	华电能源	14,500	103,240.00	0.01
621	002389	航天彩虹	5,800	103,066.00	0.01
622	300459	汤姆猫	30,300	102,717.00	0.01
623	688443	智翔金泰	4,412	102,579.00	0.01
624	601606	长城军工	3,700	101,713.00	0.01
625	600618	氯碱化工	10,100	101,505.00	0.01
626	002249	大洋电机	13,400	100,500.00	0.01
627	002929	润建股份	1,500	100,320.00	0.01
628	002681	奋达科技	22,400	100,128.00	0.01
629	301622	英思特	2,100	98,910.00	0.01
630	300181	佐力药业	7,000	98,700.00	0.01
631	603026	石大胜华	1,100	98,307.00	0.01
632	002081	金螳螂	22,500	97,425.00	0.01
633	603556	海兴电力	4,400	96,800.00	0.01
634	603496	恒为科技	4,200	96,516.00	0.01
635	000930	中粮科技	22,700	96,475.00	0.01
636	000917	电广传媒	14,400	96,336.00	0.01
637	688400	凌云光	1,453	96,188.60	0.01
638	600428	中远海特	12,300	96,063.00	0.01
639	603279	景津装备	8,000	96,000.00	0.01
640	002961	瑞达期货	4,900	95,942.00	0.01
641	601952	苏垦农发	12,700	95,123.00	0.01
642	605116	奥锐特	5,000	94,600.00	0.01
643	603093	南华期货	5,100	92,565.00	0.01
644	000503	国新健康	15,000	92,250.00	0.01
645	600771	广誉远	7,100	91,945.00	0.01
646	000099	中信海直	6,200	90,272.00	0.01
647	301155	海力风电	2,100	90,090.00	0.01
648	002588	史丹利	11,400	90,060.00	0.01
649	600572	康恩贝	22,800	89,376.00	0.01
650	600872	中炬高新	5,100	88,536.00	0.01
651	603730	岱美股份	7,800	87,126.00	0.01
652	300322	硕贝德	3,400	85,680.00	0.01
653	603166	福达股份	6,400	85,568.00	0.01
654	002239	奥特佳	34,500	85,215.00	0.01
655	300133	华策影视	11,900	84,252.00	0.01
656	600682	南京新百	15,300	78,795.00	0.01
657	600746	江苏索普	14,700	76,881.00	0.01

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	002466	天齐锂业	79,200	4,856,544.00	0.51
2	300223	君正股份	17,600	4,380,640.00	0.46
3	002738	中矿资源	65,600	3,869,744.00	0.40
4	300308	中际旭创	2,600	3,302,000.00	0.34
5	300475	香农芯创	10,700	3,210,000.00	0.33
6	688525	佰维存储	6,206	3,070,294.38	0.32
7	002558	巨人网络	106,700	2,940,652.00	0.31
8	603986	兆易创新	3,500	2,852,500.00	0.30
9	600595	中孚实业	482,000	2,708,840.00	0.28
10	688795	摩尔线程	3,987	2,698,959.78	0.28
11	301308	江波龙	3,700	2,604,060.00	0.27
12	300033	同花顺	10,700	2,578,700.00	0.27
13	002709	天赐材料	49,700	2,556,071.00	0.27
14	688783	西安奕材	44,370	2,547,725.40	0.27
15	688802	沐曦股份	3,062	2,354,341.18	0.25
16	002653	海思科	34,500	2,288,730.00	0.24
17	002414	高德红外	168,800	2,238,288.00	0.23
18	002384	东山精密	7,900	2,072,565.00	0.22
19	300953	震裕科技	15,500	2,072,350.00	0.22
20	001389	广合科技	8,200	1,945,450.00	0.20
21	688202	美迪西	23,337	1,883,529.27	0.20
22	300681	英搏尔	62,900	1,800,198.00	0.19
23	603799	华友钴业	36,400	1,756,664.00	0.18
24	688111	金山办公	8,244	1,756,384.20	0.18
25	300502	新易盛	2,820	1,711,740.00	0.18
26	688498	源杰科技	818	1,542,748.00	0.16
27	001309	德明利	1,220	1,150,338.00	0.12
28	688072	拓荆科技	1,248	1,038,336.00	0.11
29	001314	亿道信息	16,600	1,025,880.00	0.11
30	688331	荣昌生物	7,839	1,021,108.14	0.11
31	300444	双杰电气	83,500	1,019,535.00	0.11
32	688045	必易微	12,613	1,018,878.14	0.11
33	603259	药明康德	8,000	996,080.00	0.10
34	002460	赣锋锂业	15,100	987,540.00	0.10
35	600176	中国巨石	13,500	983,880.00	0.10
36	688008	澜起科技	3,075	952,942.50	0.10
37	300232	洲明科技	165,500	948,315.00	0.10

38	002079	苏州固锴	62,700	942,381.00	0.10
39	688578	艾力斯	8,606	939,775.20	0.10
40	688256	寒武纪	587	936,587.85	0.10
41	688221	前沿生物	41,095	920,528.00	0.10
42	002240	盛新锂能	20,000	896,600.00	0.09
43	603507	振江股份	26,600	874,874.00	0.09
44	300476	胜宏科技	2,400	831,432.00	0.09
45	688472	阿特斯	76,746	830,391.72	0.09
46	688428	诺诚健华	28,974	824,889.78	0.09
47	688095	福昕软件	13,871	824,353.53	0.09
48	301246	宏源药业	30,500	820,450.00	0.09
49	300769	德方纳米	12,000	798,000.00	0.08
50	603538	美诺华	24,400	794,220.00	0.08
51	688002	睿创微纳	5,114	791,084.66	0.08
52	300661	圣邦股份	5,500	789,140.00	0.08
53	300724	捷佳伟创	9,800	691,880.00	0.07
54	300938	信测标准	13,820	689,341.60	0.07
55	300757	罗博特科	1,100	680,900.00	0.07
56	002850	科达利	3,400	643,620.00	0.07
57	688556	高测股份	48,414	642,937.92	0.07
58	301150	中一科技	10,100	637,411.00	0.07
59	688090	瑞松科技	5,965	634,974.25	0.07
60	301536	星宸科技	4,900	630,679.00	0.07
61	688235	百济神州	2,473	629,650.53	0.07
62	000988	华工科技	3,249	599,797.89	0.06
63	300164	通源石油	74,800	598,400.00	0.06
64	002134	天津普林	19,500	593,190.00	0.06
65	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.06
66	603186	华正新材	2,500	563,250.00	0.06
67	600418	江淮汽车	21,800	563,094.00	0.06
68	603061	金海通	1,100	552,442.00	0.06
69	300857	协创数据	1,600	543,840.00	0.06
70	002273	水晶光电	15,300	542,844.00	0.06
71	300201	海伦哲	25,600	539,392.00	0.06
72	300151	昌红科技	21,600	538,920.00	0.06
73	300511	雪榕生物	106,100	533,683.00	0.06
74	002131	利欧股份	112,000	532,000.00	0.06
75	688568	中科星图	12,526	519,453.22	0.05
76	300055	万邦达	78,600	505,398.00	0.05
77	002463	沪电股份	3,200	488,960.00	0.05
78	603626	科森科技	26,400	488,400.00	0.05

79	600875	东方电气	16,700	480,459.00	0.05
80	002455	百川股份	65,900	474,480.00	0.05
81	002780	三夫户外	39,000	473,460.00	0.05
82	002969	嘉美包装	32,900	463,232.00	0.05
83	301338	凯格精机	2,840	462,607.60	0.05
84	001248	华润新能源	43,846	443,283.06	0.05
85	600256	广汇能源	88,800	438,672.00	0.05
86	002851	麦格米特	2,600	434,668.00	0.05
87	300057	万顺新材	49,800	432,264.00	0.05
88	300842	帝科股份	4,800	428,016.00	0.04
89	605117	德业股份	3,900	414,102.00	0.04
90	603629	利通电子	2,300	411,263.00	0.04
91	002803	吉宏股份	15,800	408,272.00	0.04
92	688266	泽璟制药	3,489	407,026.74	0.04
93	300139	晓程科技	11,100	405,705.00	0.04
94	688052	纳芯微	1,384	399,021.04	0.04
95	300191	潜能恒信	14,300	395,395.00	0.04
96	300986	志特新材	22,900	392,735.00	0.04
97	301377	鼎泰高科	700	385,630.00	0.04
98	688007	光峰科技	28,699	381,696.70	0.04
99	300136	信维通信	3,200	381,600.00	0.04
100	300972	万辰集团	2,200	381,502.00	0.04
101	600722	金牛化工	46,700	379,204.00	0.04
102	000933	神火股份	17,600	373,120.00	0.04
103	301200	大族数控	1,000	360,650.00	0.04
104	000987	越秀资本	45,800	358,156.00	0.04
105	601100	恒立液压	3,300	354,948.00	0.04
106	300483	首华燃气	19,900	349,842.00	0.04
107	000967	盈峰环境	33,200	349,596.00	0.04
108	002865	钧达股份	5,800	346,144.00	0.04
109	603993	洛阳钼业	19,700	345,735.00	0.04
110	300740	水羊股份	18,712	344,487.92	0.04
111	600363	联创光电	9,600	343,488.00	0.04
112	001212	中旗新材	7,100	336,398.00	0.04
113	002281	光迅科技	1,300	334,022.00	0.03
114	600115	中国东航	87,600	333,756.00	0.03
115	002475	立讯精密	4,700	330,880.00	0.03
116	000426	兴业银锡	9,900	326,304.00	0.03
117	688041	海光信息	873	323,271.90	0.03
118	300943	春晖智控	7,100	319,145.00	0.03
119	600547	山东黄金	13,800	318,642.00	0.03

120	600988	赤峰黄金	12,100	318,472.00	0.03
121	002402	和而泰	12,200	315,126.00	0.03
122	002970	锐明技术	5,800	309,894.00	0.03
123	601872	招商轮船	17,600	309,232.00	0.03
124	600026	中远海能	17,200	308,568.00	0.03
125	300677	英科医疗	7,700	301,609.00	0.03
126	688790	昂瑞微	2,319	293,237.55	0.03
127	002885	京泉华	7,100	290,106.00	0.03
128	301188	力诺药包	4,300	287,670.00	0.03
129	000510	新金路	11,500	285,660.00	0.03
130	300347	泰格医药	5,900	283,200.00	0.03
131	001203	大中矿业	9,400	281,530.00	0.03
132	688387	信科移动	13,992	277,601.28	0.03
133	300056	中创环保	37,900	275,533.00	0.03
134	600489	中金黄金	14,900	268,945.00	0.03
135	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.03
136	688301	奕瑞科技	2,134	264,616.00	0.03
137	002931	锋龙股份	3,800	262,124.00	0.03
138	002353	杰瑞股份	1,700	259,250.00	0.03
139	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.03
140	000975	山金国际	15,100	256,700.00	0.03
141	002436	兴森科技	5,000	254,750.00	0.03
142	600118	中国卫星	3,100	254,355.00	0.03
143	688820	盛合晶微	1,773	250,861.77	0.03
144	600601	方正科技	17,800	246,352.00	0.03
145	688196	卓越新能	6,825	245,017.50	0.03
146	300054	鼎龙股份	2,300	243,731.00	0.03
147	002649	博彦科技	28,800	234,432.00	0.02
148	300079	数码视讯	53,700	225,540.00	0.02
149	688226	威腾电气	5,201	222,758.83	0.02
150	601869	长飞光纤	400	218,360.00	0.02
151	000408	藏格矿业	3,100	214,892.00	0.02
152	603290	斯达半导	1,400	214,116.00	0.02
153	688173	希荻微	10,924	209,085.36	0.02
154	000039	中集集团	25,600	207,616.00	0.02
155	600100	同方股份	30,300	207,555.00	0.02
156	605287	德才股份	5,000	207,450.00	0.02
157	000932	华菱钢铁	59,200	205,424.00	0.02
158	002390	信邦制药	78,100	203,841.00	0.02
159	301099	雅创电子	2,100	200,550.00	0.02
160	002440	闰土股份	19,500	199,875.00	0.02

161	000807	云铝股份	9,000	199,260.00	0.02
162	688308	欧科亿	1,093	198,718.33	0.02
163	002645	华宏科技	7,200	198,072.00	0.02
164	002674	兴业科技	6,800	194,004.00	0.02
165	300394	天孚通信	640	193,715.20	0.02
166	600989	宝丰能源	9,400	191,102.00	0.02
167	600714	金瑞矿业	9,300	190,929.00	0.02
168	000338	潍柴动力	7,000	190,750.00	0.02
169	000593	德龙汇能	8,800	188,144.00	0.02
170	002916	深南电路	400	183,160.00	0.02
171	601456	国联民生	20,600	182,104.00	0.02
172	603229	奥翔药业	23,000	178,020.00	0.02
173	002697	红旗连锁	40,000	166,400.00	0.02
174	603122	合富中国	14,900	163,304.00	0.02
175	000729	燕京啤酒	16,000	162,080.00	0.02
176	002429	兆驰股份	15,500	161,045.00	0.02
177	301526	国际复材	3,400	158,678.00	0.02
178	002348	高乐股份	15,000	158,100.00	0.02
179	002028	思源电气	900	155,700.00	0.02
180	688518	联赢激光	4,968	153,511.20	0.02
181	300129	泰胜风能	17,700	151,335.00	0.02
182	002955	鸿合科技	4,200	150,150.00	0.02
183	002903	宇环数控	3,300	149,886.00	0.02
184	002782	可立克	7,100	149,455.00	0.02
185	601231	环旭电子	4,600	149,040.00	0.02
186	600105	永鼎股份	2,200	148,456.00	0.02
187	002446	盛路通信	13,600	146,064.00	0.02
188	603228	景旺电子	2,000	144,820.00	0.02
189	688155	先惠技术	1,777	143,741.53	0.01
190	001399	惠科股份	5,119	141,949.87	0.01
191	000960	锡业股份	3,300	140,877.00	0.01
192	000533	顺钠股份	14,700	139,797.00	0.01
193	600663	陆家嘴	22,100	138,788.00	0.01
194	600183	生益科技	800	138,720.00	0.01
195	300432	富临精工	6,900	138,621.00	0.01
196	601106	中国一重	41,500	136,950.00	0.01
197	688678	福立旺	5,662	136,850.54	0.01
198	688191	智洋创新	3,769	134,553.30	0.01
199	002532	天山铝业	12,500	134,125.00	0.01
200	605208	永茂泰	8,400	133,980.00	0.01
201	002602	世纪华通	9,500	133,950.00	0.01

202	300408	三环集团	800	133,520.00	0.01
203	000756	新华制药	9,400	133,198.00	0.01
204	002943	宇晶股份	3,000	132,690.00	0.01
205	603938	三孚股份	1,800	128,970.00	0.01
206	000060	中金岭南	16,800	127,176.00	0.01
207	300586	美联新材	8,100	126,684.00	0.01
208	300843	胜蓝股份	800	125,000.00	0.01
209	002049	紫光国微	1,400	124,250.00	0.01
210	001330	博纳影业	22,000	123,640.00	0.01
211	001316	润贝航科	3,700	122,026.00	0.01
212	601179	中国西电	8,100	120,852.00	0.01
213	301307	美利信	1,600	120,464.00	0.01
214	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.01
215	688059	华锐精密	600	119,826.00	0.01
216	002195	岩山科技	18,300	119,682.00	0.01
217	688257	新锐股份	1,170	119,223.00	0.01
218	688521	芯原股份	317	117,651.38	0.01
219	301251	威尔高	2,200	117,216.00	0.01
220	301529	福赛科技	1,200	115,632.00	0.01
221	603861	白云电器	8,900	114,899.00	0.01
222	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.01
223	002438	江苏神通	7,600	113,468.00	0.01
224	600125	铁龙物流	21,900	111,033.00	0.01
225	300658	延江股份	9,700	110,871.00	0.01
226	301117	佳缘科技	4,740	110,679.00	0.01
227	603920	世运电路	2,300	110,492.00	0.01
228	600498	烽火通信	1,500	110,400.00	0.01
229	688378	奥来德	1,761	109,182.00	0.01
230	002734	利民股份	6,300	108,171.00	0.01
231	600499	科达制造	7,800	107,640.00	0.01
232	603090	宏盛股份	2,100	107,226.00	0.01
233	688418	震有科技	2,224	106,929.92	0.01
234	600121	郑州煤电	29,800	106,684.00	0.01
235	301086	鸿富瀚	500	104,640.00	0.01
236	688663	新风光	1,174	103,852.04	0.01
237	002225	濮耐股份	21,800	103,114.00	0.01
238	688307	中润光学	1,283	102,575.85	0.01
239	605299	舒华体育	7,500	100,125.00	0.01
240	002733	雄韬股份	3,200	99,136.00	0.01
241	002156	通富微电	1,300	98,631.00	0.01
242	605289	罗曼股份	680	98,600.00	0.01

243	002796	世嘉科技	2,400	97,872.00	0.01
244	300745	欣锐科技	2,300	97,106.00	0.01
245	002600	领益智造	5,600	97,104.00	0.01
246	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.01
247	002235	安妮股份	12,400	96,100.00	0.01
248	603660	苏州科达	7,800	95,550.00	0.01
249	688035	德邦科技	1,037	95,196.60	0.01
250	002064	华峰化学	10,000	94,900.00	0.01
251	002471	中超控股	15,100	91,053.00	0.01
252	002379	宏桥控股	6,100	90,097.00	0.01
253	000830	鲁西化工	7,500	90,000.00	0.01
254	002080	中材科技	1,000	90,000.00	0.01
255	600792	云煤能源	28,200	89,394.00	0.01
256	002648	卫星化学	3,800	89,262.00	0.01
257	300922	天秦装备	5,700	86,355.00	0.01
258	688311	盟升电子	3,265	85,510.35	0.01
259	688210	统联精密	2,017	81,708.67	0.01
260	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.01
261	300984	金沃股份	1,000	53,730.00	0.01
262	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.01
263	603909	建发合诚	5,100	43,503.00	0.00
264	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
265	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
266	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
267	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
268	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
269	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
270	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
271	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
272	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
273	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
274	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
275	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
276	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
277	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
278	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
279	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
280	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
281	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
282	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
283	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00

284	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
285	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
286	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
287	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
288	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	300170	汉得信息	19,862,296.00	1.68
2	603083	剑桥科技	18,840,652.00	1.59
3	688110	东芯股份	17,498,783.08	1.48
4	688498	源杰科技	16,774,021.67	1.42
5	301171	易点天下	16,519,136.00	1.40
6	688536	思瑞浦	16,185,674.90	1.37
7	300438	鹏辉能源	15,935,652.86	1.35
8	001309	德明利	15,745,794.00	1.33
9	002400	省广集团	15,337,196.00	1.30
10	600577	精达股份	14,686,190.00	1.24
11	300762	上海瀚讯	14,355,071.04	1.21
12	300475	香农芯创	14,313,509.00	1.21
13	002163	海南发展	13,856,904.00	1.17
14	002222	福晶科技	13,415,360.46	1.13
15	002497	雅化集团	13,173,974.00	1.11
16	600151	航天机电	12,965,359.00	1.10
17	605111	新洁能	12,948,220.20	1.09
18	300953	震裕科技	12,896,777.39	1.09
19	300548	长芯博创	12,752,339.00	1.08
20	000970	中科三环	12,721,433.99	1.08

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	001309	德明利	22,123,340.00	1.87
2	688498	源杰科技	21,915,970.93	1.85
3	300170	汉得信息	21,023,031.00	1.78
4	002913	奥士康	18,879,810.00	1.60
5	603588	高能环境	17,498,005.02	1.48

6	688127	蓝特光学	17,142,976.46	1.45
7	600577	精达股份	16,968,780.00	1.43
8	600100	同方股份	16,129,421.00	1.36
9	300548	长芯博创	16,062,301.00	1.36
10	301171	易点天下	15,832,335.00	1.34
11	600986	浙文互联	15,546,729.65	1.31
12	300762	上海瀚讯	15,419,468.14	1.30
13	002222	福晶科技	15,145,164.16	1.28
14	603083	剑桥科技	15,097,232.00	1.28
15	300475	香农芯创	14,644,592.67	1.24
16	300199	翰宇药业	14,473,460.00	1.22
17	601869	长飞光纤	14,395,153.00	1.22
18	605111	新洁能	14,373,376.84	1.21
19	002400	省广集团	14,262,571.00	1.21
20	603118	共进股份	13,742,526.00	1.16

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	4,043,614,645.89
卖出股票收入（成交）总额	4,353,273,873.59

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	—	—
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）	352,788.35	0.04
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	352,788.35	0.04

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	123272	中汽转债	1,251	196,780.76	0.02
2	118070	南芯转债	790	79,004.50	0.01
3	118072	鼎通转债	560	56,001.72	0.01
4	113705	豪 26 转债	190	19,001.33	0.00
5	118071	华峰转债	20	2,000.04	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。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

本基金根据基金合同的约定，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，上海剑桥科技股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中华人民共和国海关的处罚。

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	5,715,984.77
2	应收清算款	538,233.36
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	5,225,761.48
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	11,479,979.61

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 1000 指数增强 (LOF) A	40,264	5,586.07	11,236,759.95	5.00	213,680,843.90	95.00
富国中证 1000 指数增强 (LOF) C	25,881	3,511.18	31,706,196.54	34.89	59,166,524.14	65.11
合计	66,145	4,774.21	42,942,956.49	13.60	272,847,368.04	86.40

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 1000 指数增强 (LOF) A	223,837.22	0.0995
	富国中证 1000 指数增强 (LOF) C	119,955.85	0.1320
	合计	343,793.07	0.1089

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 1000 指数增强 (LOF) A	0~10
	富国中证 1000 指数增强 (LOF) C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	富国中证 1000 指数增强 (LOF) A	0~10
	富国中证 1000 指数增强 (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 1000 指数增强 (LOF) A	富国中证 1000 指数增强 (LOF) C
基金合同生效日 (2018 年 05 月 31 日) 基金份额总额	512,114,043.76	—
本报告期期初基金份额总额	287,427,380.41	168,440,725.27
本报告期基金总申购份额	66,996,269.65	97,819,154.74
减：本报告期基金总赎回份额	129,506,046.21	175,387,159.33
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	224,917,603.85	90,872,720.68

§ 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 (%)	
东北证券	2	—	—	—	—	—
东方证券	4	462,071,459.13	5.50	62,795.65	5.50	—
广发证券	2	1,577,843,726.54	18.80	214,448.24	18.80	—
国海证券	2	—	—	—	—	—
国联民生	1	—	—	—	—	—
国泰海通	2	2,235,291,607.49	26.63	303,781.31	26.63	—
国投证券	1	—	—	—	—	—
国信证券	2	863,662,956.18	10.29	117,390.28	10.29	—
华泰证券	2	654,874,373.99	7.80	88,997.90	7.80	—
华兴证券	1	—	—	—	—	—
汇丰前海	2	—	—	—	—	—
开源证券	2	—	—	—	—	—
申万宏源	3	256,129,132.40	3.05	34,806.31	3.05	—
兴业证券	2	—	—	—	—	—
银河证券	2	334,148,609.44	3.98	45,411.55	3.98	—
浙商证券	1	—	—	—	—	—
中金公司	2	579,600,725.39	6.91	78,767.92	6.90	—
中泰证券	1	—	—	—	—	—
中信建投	2	—	—	—	—	—
中信证券	3	1,430,113,823.10	17.04	194,363.57	17.04	—

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（074001）。

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（%）
东北证券	—	—	—	—	—	—
东方证券	—	—	—	—	—	—
广发证券	279,161.18	28.60	—	—	—	—
国海证券	—	—	—	—	—	—
国联民生	—	—	—	—	—	—
国泰海通	267,517.14	27.41	—	—	—	—
国投证券	—	—	—	—	—	—
国信证券	—	—	—	—	—	—
华泰证券	—	—	—	—	—	—
华兴证券	—	—	—	—	—	—
汇丰前海	—	—	—	—	—	—
开源证券	—	—	—	—	—	—
申万宏源	—	—	—	—	—	—
兴业证券	—	—	—	—	—	—
银河证券	—	—	—	—	—	—
浙商证券	—	—	—	—	—	—
中金公司	—	—	—	—	—	—
中泰证券	—	—	—	—	—	—
中信建投	—	—	—	—	—	—
中信证券	429,399.62	43.99	—	—	—	—

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	规定披露媒介	2026年02月04日

	销期内承销证券的公告		
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

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1000 指数增强型证券投资基金（LOF）的文件 2、富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同 3、富国中证 1000 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 1000 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 。