富荣沪深300指数增强型证券投资基金

2026年第3季度报告

2026年09月30日

基金管理人:富荣基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

报告送出日期:2026年10月27日

目录

§1 重要提示 3
§2 基金产品概况 3
§3 主要财务指标和基金净值表现 4
3.1 主要财务指标 4
3.2 基金净值表现 4
§4 管理人报告 7
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介 7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 8
4.3 公平交易专项说明 8
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析 9
4.5 报告期内基金的业绩表现 9
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明 9
§5 投资组合报告 9
5.1 报告期末基金资产组合情况 9
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 10
5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细 12
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合 12
5.5 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债券投资明细 13
5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细 13
5.7 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 13
5.8 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权证投资明细 13
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 13
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 13
5.11 投资组合报告附注 13
§6 开放式基金份额变动 14
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况 15
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况 15
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细 15
§8 影响投资者决策的其他重要信息 15
8.1 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 15
8.2 影响投资者决策的其他重要信息 15
§9 备查文件目录 15
9.1 备查文件目录 15
9.2 存放地点 16
9.3 查阅方式 16

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年7月1日起至2026年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富荣沪深300指数增强
基金主代码	004788
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年01月24日
报告期末基金份额总额	1,012,218,855.75份
投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对沪深300指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金在指数化投资的基础上通过数量化方法进行投资组合优化，在控制与沪深300指数偏离风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。本基金力争控制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%，年跟踪误差不超过8.0%。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	基金为股票型基金，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金，属于证券投资基金中中高等风险、中高等预期收益的品种。本基金为指数基金，主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

基金管理人	富荣基金管理有限公司		
基金托管人	招商银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	富荣沪深300指数增强A	富荣沪深300指数增强C	富荣沪深300指数增强Y
下属分级基金的交易代码	004788	004789	027325
报告期末下属分级基金的份额总额	493,714,913.08份	518,353,443.86份	150,498.81份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2026年07月01日 - 2026年09月30日)		
	富荣沪深300指数增强A	富荣沪深300指数增强C	富荣沪深300指数增强Y
1.本期已实现收益	-5,952,773.11	-7,971,586.71	-4,179.78
2.本期利润	-141,100,240.53	-128,343,908.73	-26,708.56
3.加权平均基金份额本期利润	-0.3076	-0.2835	-0.2598
4.期末基金资产净值	1,261,103,223.18	1,312,194,097.58	384,905.65
5.期末基金份额净值	2.5543	2.5315	2.5575

注：①上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

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

③富荣沪深300指数增强型证券投资基金自2026年5月15日起增加Y类基金份额。

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

富荣沪深300指数增强A净值表现

阶段	净值增长率①	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	①-③	②-④

				④		
过去三个月	-11.33%	1.40%	-11.88%	1.22%	0.55%	0.18%
过去六个月	8.80%	1.53%	-1.92%	1.22%	10.72%	0.31%
过去一年	9.87%	1.35%	-5.72%	1.08%	15.59%	0.27%
过去三年	45.65%	1.22%	17.46%	1.09%	28.19%	0.13%
过去五年	26.25%	1.17%	-9.55%	1.07%	35.80%	0.10%
过去七年	165.38%	1.23%	14.26%	1.12%	151.12%	0.11%
自基金合同生效起至今	254.57%	1.24%	37.54%	1.14%	217.03%	0.10%

富荣沪深300指数增强C净值表现

阶段	净值增长率①	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	-11.35%	1.40%	-11.88%	1.22%	0.53%	0.18%
过去六个月	8.75%	1.53%	-1.92%	1.22%	10.67%	0.31%
过去一年	9.77%	1.35%	-5.72%	1.08%	15.49%	0.27%
过去三年	45.22%	1.22%	17.46%	1.09%	27.76%	0.13%
过去五年	25.62%	1.17%	-9.55%	1.07%	35.17%	0.10%
过去七年	163.51%	1.23%	14.26%	1.12%	149.25%	0.11%
自基金合同生效起至今	251.79%	1.24%	37.54%	1.14%	214.25%	0.10%

富荣沪深300指数增强Y净值表现

阶段	净值增长率①	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	-11.25%	1.40%	-11.88%	1.22%	0.63%	0.18%
自基金合同生效起至今	-4.61%	1.52%	-10.76%	1.26%	6.15%	0.26%

注：①本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

②富荣沪深 300 指数增强型证券投资基金自 2026 年 5 月 15 日起增加 Y 类基金份额。

3.2.2 自基金转型以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较







注：富荣沪深 300 指数增强型证券投资基金自 2026 年 5 月 15 日起增加 Y 类基金份额。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）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		
郎骋成	研究部总经理、权益投资部总经理、基金经理	2020-07-16	-	20	南京大学工业工程硕士研究生，持有基金从业资格证书，中国国籍。曾任锦泰期货有限公司宏观和化工研究员，曾任职于金东矿业股份有限公司主持上市办公室工作，曾任弘业期货股份有限公司投资咨询负责人及研究所所长、摩根士丹利华鑫基金另类投资小组副组长/专户投资经理/专户理财部副总监。2020年6月加入富荣基金，现任富荣基金

					管理有限公司研究部总经理、权益投资部总经理、基金经理。
孟亚强	权益投资部副总经理、基金经理	2025-08-01	-	17	南开大学保险精算硕士研究生，持有基金从业资格证书，中国国籍。曾任博时基金管理有限公司股票投资部量化研究员、基金经理助理、投资经理，九泰基金管理有限公司绝对收益部基金经理、天元量化投资部总经理、权益投资部联席总监、基金经理。2025年2月加入富荣基金，现任富荣基金管理有限公司权益投资部副总经理、基金经理。

注：1、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、证券从业的含义遵从中国证监会及行业协会的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
郎骋成	公募基金	2	2,580,258,024.46	2020-07-16
	私募资产管理计划	1	101,788,317.06	2020-09-22
	其他组合	-	-	-
	合计	3	2,682,046,341.52	-

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度，在研究分析、投资决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合。

公司利用统计分析的方法和工具，按照不同的时间窗口（包括当日内、3日内、5日内），对旗下所有投资组合的同向交易价差情况进行分析，报告期内未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内，A股市场整体呈现下跌走势，但分化极大，其中科创50下跌超过30%，但同花顺全A(沪深)指数跌幅不到1%。在风格指数方面，申万成长指数跑输价值指数，中小盘指数落后大盘指数。本基金采用量化多因子模型选股，在有效控制组合风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的收益，追求基金资产的长期稳定增值。在具体操作上，考虑到短期动量风格的潜在风险，7月份之后模型整体大幅降低跟踪误差，一直延续到9月中下旬，期间组合严格控制了组合的风格暴露，以防止风格轮动带来净值回撤的风险。行业上超配基础化工和银行等，低配食品饮料和医药等行业。结合国内经济发展底色与产业转型趋势综合判断，多重积极支撑因素持续显现，我们对市场短期保持乐观。但长期来看，市场已经进入持续调整区间。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富荣沪深300指数增强A基金份额净值为2.5543元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-11.33%，同期业绩比较基准收益率为-11.88%；截至报告期末富荣沪深300指数增强C基金份额净值为2.5315元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-11.35%，同期业绩比较基准收益率为-11.88%；截至报告期末富荣沪深300指数增强Y基金份额净值为2.5575元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-11.25%，同期业绩比较基准收益率为-11.88%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例（%）

1	权益投资	2,403,862,734.31	92.85
	其中：股票	2,403,862,734.31	92.85
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	171,038,845.12	6.61
8	其他资产	13,999,779.11	0.54
9	合计	2,588,901,358.54	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	33,545,660.00	1.30
C	制造业	1,116,147,413.03	43.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	52,825,626.00	2.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	788,716,852.90	30.65
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	122,988.00	0.00

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,991,358,539.93	77.37

5.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	37,173,969.96	1.44
C	制造业	375,330,224.42	14.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	412,504,194.38	16.03

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金报告期末未持有港股通股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	463,923	135,052,624.53	5.25
2	600030	中信证券	3,271,000	84,588,060.00	3.29
3	601328	交通银行	10,653,000	82,560,750.00	3.21
4	300308	中际旭创	99,699	80,600,659.56	3.13
5	688012	中微公司	252,383	80,396,604.65	3.12
6	603986	兆易创新	223,600	79,132,040.00	3.07
7	002142	宁波银行	2,067,410	73,248,336.30	2.85
8	000001	平安银行	6,273,500	72,584,395.00	2.82
9	002415	海康威视	2,216,800	71,957,328.00	2.80
10	601939	建设银行	6,377,200	70,531,832.00	2.74

5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	601869	长飞光纤	151,501	62,291,151.16	2.42
2	688002	睿创微纳	341,153	59,162,753.26	2.30
3	300857	协创数据	227,205	57,064,807.80	2.22
4	000703	恒逸石化	3,539,300	55,319,259.00	2.15
5	688525	佰维存储	286,790	55,164,056.50	2.14

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，平安银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾被国家金融监督管理总局罚款1880万元；宁波银行在报告编制日前一年内曾被中国人民银行处罚款98.8万元；交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾被金融监管总局罚款80万元，曾被中国人民银行警告、没收违法所得23.982116万元、罚款6783.43万元；中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾被金融监管总局罚款70万元，曾被国家外汇管理局北京市分局警告、罚款15770600元、没收违法所得，曾

被中国人民银行警告、没收违法所得55.097567万元、罚款4295.51万元，合计罚没4350.607567万元。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有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。

5.11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	748,597.87
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	13,251,181.24
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	13,999,779.11

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限股票。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

	富荣沪深300指数增	富荣沪深300指数增	富荣沪深300指数增

	强A	强C	强Y
报告期期初基金份额总额	390,885,007.67	269,913,272.49	27,442.00
报告期期间基金总申购份额	138,669,757.93	326,527,668.60	145,940.08
减：报告期期间基金总赎回份额	35,839,852.52	78,087,497.23	22,883.27
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-	-
报告期期末基金份额总额	493,714,913.08	518,353,443.86	150,498.81

注：申购含转换入份额、红利再投资份额；赎回含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，无影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

9.1.1 中国证监会批准富荣沪深300指数增强型证券投资基金设立的文件；

9.1.2《富荣沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》；

9.1.3《富荣沪深300指数增强型证券投资基金托管协议》；

9.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；

9.1.5 报告期内富荣沪深300指数增强型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富荣基金管理有限公司，客服热线：4006855600。

富荣基金管理有限公司

2026年10月27日