

富国中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

二 0 二六年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：国信证券股份有限公司

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。

基金托管人国信证券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

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	富国中证 500ETF
场内简称	中证 500ETF 富国
基金主代码	159500
交易代码	159500
基金运作方式	契约型，交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 08 月 20 日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	国信证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	129,338,865.00 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	2025 年 8 月 29 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采用完全复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的资产配置策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、可转换债券（含可分离交易可转债）及可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略详见法律文件。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

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	国信证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	薛璐
	联系电话	021-20361818	0755-22940163
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	03339@guosen.com.cn
客户服务电话		95105686、4008880688	0755-61897778
传真		021-20361616	0755-22940165
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址	上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦 19 楼
邮政编码	200120	518000
法定代表人	陈戈	张纳沙

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 国信证券股份有限公司 深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦 19 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

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	18,800,143.55
本期利润	30,136,892.53
加权平均基金份额本期利润	0.2100
本期加权平均净值利润率	17.38%
本期基金份额净值增长率	23.71%
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	29,004,047.96
期末可供分配基金份额利润	0.2242
期末基金资产净值	174,045,931.68
期末基金份额净值	1.3457
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	34.57%

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，开放式基金的申购赎回费、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

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	21.08%	1.64%	18.56%	1.65%	2.52%	-0.01%
过去六个月	23.71%	1.65%	20.97%	1.66%	2.74%	-0.01%
自基金合同生效起至今	34.57%	1.49%	35.70%	1.51%	-1.13%	-0.02%

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



注：1、截止日期为2026年6月30日。

2、本基金于2025年8月20日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。本基金建仓期为自基金合同生效之日起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
金泽宇	本基金现任基金经理	2025-08-20	—	8	博士，自 2018 年 7 月加入富国基金管理有限公司，历任助理定量研究员、初级定量研究员、定量研究员；现任富国基金量化投资部定量基金经理。自 2022 年 07 月起任富国中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2022 年 11 月起任富国中证 1000 交易型开放

					式指数证券投资基金联接基金基金经理；自 2024 年 05 月起任富国沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2024 年 05 月起任富国中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2024 年 07 月起任富国中证中央企业红利交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2024 年 09 月起任富国沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；自 2024 年 10 月起任富国中证中央企业红利交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；自 2024 年 11 月起任富国中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；自 2025 年 01 月起任富国创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2025 年 01 月起任富国上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；自 2025 年 02 月起任富国上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2025 年 04 月起任富国创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；自 2025 年 04 月起任富国上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；自 2025 年 04 月起任富国中证 800 自由现金流交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2025 年 05 月起任富国上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2025 年 08 月起任富国中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；自 2025 年 08 月起任富国中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2025 年 08 月起任富国中证 800 自由现金流交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；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 500 交易型开放式指数证券投资基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险、力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定收益为目标，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。

在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本基金与公司管理的其他投资组合之间，出现 5 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，本基金采用量化和人工管理相结合的方法，处理基金日常运作中的大额申购和赎回等事件，合理安排仓位及头寸，将跟踪误差控制在合理水平，努力为投资者提供更合格的投资工具。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.3457 元；份额累计净值为 1.3457 元；本报告期，本基金份额净值增长率为 23.71%；同期业绩比较基准收益率为 20.97%。

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

报告期内，国信证券股份有限公司（以下称“托管人”）严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定及基金合同的约定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益分配的情况等方面进行了必要的监督、复核和审查。

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

托管人认真复核了本报告中的财务指标、净值表现等财务信息相关内容，认为其不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：富国中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：		
货币资金	2,546,898.40	1,376,949.87
结算备付金	236,768.70	—
存出保证金	214,276.80	—
交易性金融资产	171,882,425.04	97,668,535.82
其中：股票投资	171,873,424.88	97,658,535.67
基金投资	—	—
债券投资	9,000.16	10,000.15
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	—	404.74
应收股利	—	—
应收申购款	—	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	174,880,368.94	99,045,890.43
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	606,832.53	875,007.08
应付赎回款	—	—
应付管理人报酬	21,435.74	13,961.63
应付托管费	7,145.25	4,653.87
应付销售服务费	—	—
应付投资顾问费	—	—
应交税费	—	—

应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	199,023.74	94,849.32
负债合计	834,437.26	988,471.90
净资产：		
实收基金	129,338,865.00	90,138,865.00
未分配利润	44,707,066.68	7,918,553.53
净资产合计	174,045,931.68	98,057,418.53
负债和净资产总计	174,880,368.94	99,045,890.43

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.3457 元，基金份额总额 129,338,865.00 份。

6.2 利润表

会计主体：富国中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

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

单位：人民币元

项目	本期 (2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日)
一、营业总收入	30,453,723.01
1. 利息收入	2,291.26
其中：存款利息收入	2,291.26
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）	19,013,616.02
其中：股票投资收益	17,891,488.29
基金投资收益	—
债券投资收益	33,163.12
资产支持证券投资收益	—
贵金属投资收益	—
衍生工具收益	-40.01
股利收益	1,089,004.62
其他投资收益	—
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	11,336,748.98
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	101,066.75
减：二、营业总支出	316,830.48
1. 管理人报酬	128,245.62
2. 托管费	42,748.50

3. 销售服务费	—
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	—
8. 其他费用	145,836.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	30,136,892.53
减：所得税费用	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	30,136,892.53
五、其他综合收益的税后净额	—
六、综合收益总额	30,136,892.53

注：本基金合同生效日为 2025 年 8 月 20 日, 无上年度同期对比数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：富国中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

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

单位：人民币元

项目	本期 (2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日)		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	90,138,865.00	7,918,553.53	98,057,418.53
二、本期期初净资产	90,138,865.00	7,918,553.53	98,057,418.53
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	39,200,000.00	36,788,513.15	75,988,513.15
（一）、综合收益总额	—	30,136,892.53	30,136,892.53
（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）	39,200,000.00	6,651,620.62	45,851,620.62
其中：1. 基金申购款	198,800,000.00	39,570,485.34	238,370,485.34
2. 基金赎回款	-159,600,000.00	-32,918,864.72	-192,518,864.72
（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	129,338,865.00	44,707,066.68	174,045,931.68

注：本基金合同生效日为 2025 年 8 月 20 日, 无上年度同期对比数据。

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

富国中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可〔2025〕782 号《关于准予富国中证 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人富国基金管理有限公司自 2025 年 8 月 1 日至 2025 年 8 月 15 日止期间向社会公开发发行募集，募集期结束经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具德师报(验)字(25)第 00260 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2025 年 8 月 20 日正式生效。本基金为契约型，交易型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币 571,691,000.00 元，折合 571,691,000.00 份基金份额；有效认购资金在首次募集期间产生的利息为人民币 49,546.91 元，折合基金份额 47,865.00 份，剩余人民币 1,681.91 元不折算为投资者基金份额直接计入基金财产。与首次募集相关的资产总额为人民币 571,740,546.91 元，折合 571,738,865.00 份基金份额。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，基金托管人为国信证券股份有限公司。

本基金的投资范围主要为标的指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含主板、科创板、创业板及其他经中国证监会允许发行的股票）、存托凭证、债券（国债、央行票据、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、衍生工具（股指期货、国债期货、股票期权等）、货币市场工具以及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相关规定）。

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

基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的比例不得低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

如法律法规对该比例要求有变更的，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 500 指数收益率。

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 第 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	571,726.26
等于：本金	571,665.34
加：应计利息	60.92
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	1,975,172.14
等于：本金	1,975,078.48
加：应计利息	93.66
减：坏账准备	—

合计	2,546,898.40
----	--------------

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

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末（2026年06月30日）			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	154,268,145.55	—	171,873,424.88	17,605,279.33
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—
债券	交易所市场	9,000.00	0.16	9,000.16
	银行间市场	—	—	—
	合计	9,000.00	0.16	9,000.16
资产支持证券	—	—	—	—
基金	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	154,277,145.55	0.16	171,882,425.04	17,605,279.33

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	1,734,600.00	—	—	—
股指期货	1,734,600.00	—	—	—
其他衍生工具	—	—	—	—
合计	1,734,600.00	—	—	—

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
IC2607	IC2607	1.00	1,785,640.00	51,040.00
合计				51,040.00
减：可抵销期货暂收款				51,040.00

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	—
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	—
其中：交易所市场	—
银行间市场	—
应付利息	—
预提信息披露费	60,000.00
预提审计费	54,364.21
IOPV 计算发布费	16,766.31
预提注册登记费	59,507.37
其他	8,385.85
合计	199,023.74

6.4.7.7 实收基金

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	90,138,865.00	90,138,865.00
本期申购	198,800,000.00	198,800,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-159,600,000.00	-159,600,000.00
本期末	129,338,865.00	129,338,865.00

6.4.7.8 未分配利润

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	7,568,039.31	350,514.22	7,918,553.53
本期期初	7,568,039.31	350,514.22	7,918,553.53
本期利润	18,800,143.55	11,336,748.98	30,136,892.53
本期基金份额交易产生的变动数	2,635,865.10	4,015,755.52	6,651,620.62
其中：基金申购款	24,882,042.65	14,688,442.69	39,570,485.34
基金赎回款	-22,246,177.55	-10,672,687.17	-32,918,864.72
本期已分配利润	—	—	—
本期末	29,004,047.96	15,703,018.72	44,707,066.68

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	1,116.33
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	1,129.42
结算备付金利息收入	45.51
其他	—
合计	2,291.26

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期（2026年01月01日至2026年06月30日）
股票投资收益——买卖股票差价收入	10,443,617.60
股票投资收益——赎回差价收入	7,447,870.69
股票投资收益——申购差价收入	—
合计	17,891,488.29

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2026年01月01日至2026年06月30日）
卖出股票成交总额	144,519,375.33
减：卖出股票成本总额	133,941,223.64
减：交易费用	134,534.09
买卖股票差价收入	10,443,617.60

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

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

赎回基金份额对价总额	192,518,864.72
减：现金支付赎回款总额	89,984,554.72
减：赎回股票成本总额	95,086,439.31
减：交易费用	—
赎回差价收入	7,447,870.69

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益——申购差价收入。

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	2.06
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	33,161.06
合计	33,163.12

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	64,365.70
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	31,200.00
减：应计利息总额	2.05
减：交易费用	2.59
买卖债券差价收入	33,161.06

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	-40.01

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2026年01月01日至2026年06月30日）
股票投资产生的股利收益	1,089,004.62
其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	—
合计	1,089,004.62

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	11,285,708.98
股票投资	11,285,708.98
债券投资	—
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	51,040.00
权证投资	—
股指期货	51,040.00
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	11,336,748.98

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	—
替代损益	101,066.75
合计	101,066.75

6.4.7.18 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期（2026年01月01日至2026年06月30日）
审计费用	16,364.21
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	—
其他	69,472.15
合计	145,836.36

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、基金销售机构
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
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	基金托管人、基金代销机构
申万宏源证券承销保荐有限责任公司	基金管理人的股东控制的子公司
富国中证500交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	本基金的联接基金

注：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）	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
国泰海通	311,317,430.02	100.00

注：本基金合同生效日为 2025 年 08 月 20 日，无上年度同期对比数据。

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）	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
国泰海通	64,365.70	100.00

注：本基金合同生效日为 2025 年 08 月 20 日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行回购交易。本基金合同生效日为 2025 年 08 月 20 日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。本基金合同生效日为 2025 年 08 月 20 日，无上年度同期对比数据。

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	42,322.93	100.00	—	—

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。

本基金合同生效日为 2025 年 08 月 20 日，无上年度同期对比数据。

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)
当期发生的基金应支付的管理费	128,245.62
其中：应支付销售机构的客户维护费	18,583.83
应支付基金管理人的净管理费	109,661.79

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

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

本基金合同生效日为2025年8月20日，无上年度同期对比数据。

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）
当期发生的基金应支付的托管费	42,748.50

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.05%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

本基金合同生效日为2025年8月20日，无上年度同期对比数据。

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：本基金本报告期末与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。本基金合同生效日2025年08月20日，无上年度同期对比数据。

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：本基金本报告期末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：本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率从事证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内本基金的基金管理人未运用固有资金投资本基金。本基金合同生效日为 2025 年 8 月 20 日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	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 (%)
富国中证 500 交易 型开放式指数证券 投资基金发起式联 接基金	25,722,563.00	19.89	16,038,863.00	17.79

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）	
	期末余额	当期利息收入
国泰海通证券股份有限公司	1,975,172.14	1,129.42

注：本基金合同生效日为 2025 年 08 月 20 日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额

国泰海通证券股份有限公司	301599	理奇智能	IPO 网下申购	2,497	34,733.27
国泰海通证券股份有限公司	301666	大普微	IPO 网下申购	719	33,131.52
国泰海通证券股份有限公司	301696	三瑞智能	IPO 网下申购	1,258	31,047.44
国泰海通证券股份有限公司	688635	长进光子	IPO 网下申购	743	30,448.14
国泰海通证券股份有限公司	688781	视涯科技	IPO 网下申购	2,575	58,401.00
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	588	40,960.08

注：本基金合同生效日为 2025 年 08 月 20 日，无上年度同期对比数据。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001237	惠康科技	2026-05-15	6 个月	新股限售	53.26	58.74	78	4,154.28	4,581.72	—
001257	盛龙股份	2026-03-24	6 个月	新股限售	7.82	20.74	735	5,747.70	15,243.90	—
001312	福恩股份	2026-04-14	6 个月	新股限售	18.38	16.78	72	1,323.36	1,208.16	—
001365	天海电子	2026-05-11	6 个月	新股限售	27.19	31.31	190	5,166.10	5,948.90	—
001393	维通利	2026-05-08	6 个月	新股限售	30.38	38.99	137	4,162.06	5,341.63	—
001399	惠科股份	2026-06-16	6 个月	新股限售	10.12	27.73	934	9,452.08	25,899.82	—

301513	尚水智能	2026-04-10	6 个月	新股限售	26.66	50.96	130	3,465.80	6,624.80	—
301531	春光集团	2026-04-28	6 个月	新股限售	13.30	51.56	223	2,965.90	11,497.88	—
301599	理奇智能	2026-04-22	6 个月	新股限售	13.91	32.47	250	3,477.50	8,117.50	—
301666	大普微	2026-04-08	6 个月	新股限售	46.08	463.33	288	13,271.04	133,439.04	—
301680	固德电材	2026-02-27	6 个月	新股限售	58.00	112.16	50	2,900.00	5,608.00	—
301682	宏明电子	2026-03-18	6 个月	新股限售	69.66	160.06	177	12,329.82	28,330.62	—
301683	慧谷新材	2026-03-24	6 个月	新股限售	78.38	121.77	40	3,135.20	4,870.80	—
301696	三瑞智能	2026-03-31	6 个月	新股限售	24.68	86.80	126	3,109.68	10,936.80	—
603293	埃泰克	2026-04-09	6 个月	新股限售	33.49	33.93	34	1,138.66	1,153.62	—
603407	长裕集团	2026-04-29	6 个月	新股限售	13.86	73.46	129	1,787.94	9,476.34	—
603435	嘉德利	2026-05-15	6 个月	新股限售	15.76	46.71	86	1,355.36	4,017.06	—
603459	红板科技	2026-03-31	6 个月	新股限售	17.70	84.32	127	2,247.90	10,708.64	—
688635	长进光子	2026-05-20	6 个月	新股限售	40.98	308.19	75	3,073.50	23,114.25	—
688781	视涯科技	2026-03-18	9 个月	新股限售	22.68	42.16	1,674	37,966.32	70,575.84	—
688783	西安奕材	2025-10-20	9 个月	新股限售	8.62	57.42	6,286	54,185.32	360,942.12	—
688795	摩尔线程	2025-11-26	9 个月	新股限售	114.28	676.94	394	45,026.32	266,714.36	—
688797	臻宝科技	2026-06-16	6 个月	新股限售	44.56	468.67	69	3,074.64	32,338.23	—
688808	联讯仪器	2026-04-16	6 个月	新股限售	81.88	1,584.33	51	4,175.88	80,800.83	—
688811	有研复材	2026-04-01	6 个月	新股限售	6.41	24.13	589	3,775.49	14,212.57	—
688813	泰金新能	2026-03-24	6 个月	新股限售	26.28	172.09	136	3,574.08	23,404.24	—
688820	盛合晶微	2026-04-13	6 个月	新股限售	19.68	141.49	287	5,648.16	40,607.63	—

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
118071	华峰转债	2026-06-23	1 个月内（含）	认购新发证券	100.00	100.00	90	9,000.00	9,000.16	—

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的

证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%，但标的指数成分券不受此限。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	9,000.16	10,000.15
未评级	—	—
合计	9,000.16	10,000.15

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

6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的15%。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金本报告期末无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为货币资金、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末(2026年06月30日)	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,546,898.40	—	—	—	2,546,898.40

结算备付金	236,768.70	—	—	—	236,768.70
存出保证金	—	—	—	214,276.80	214,276.80
交易性金融资产	9,000.16	—	—	171,873,424.88	171,882,425.04
资产总计	2,792,667.26	—	—	172,087,701.68	174,880,368.94
负债					
应付清算款	—	—	—	606,832.53	606,832.53
应付管理人报酬	—	—	—	21,435.74	21,435.74
应付托管费	—	—	—	7,145.25	7,145.25
其他负债	—	—	—	199,023.74	199,023.74
负债总计	—	—	—	834,437.26	834,437.26
利率敏感度缺口	2,792,667.26	—	—	171,253,264.42	174,045,931.68
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	1,376,949.87	—	—	—	1,376,949.87
交易性金融资产	10,000.15	—	—	97,658,535.67	97,668,535.82
应收清算款	—	—	—	404.74	404.74
资产总计	1,386,950.02	—	—	97,658,940.41	99,045,890.43
负债					
应付清算款	—	—	—	875,007.08	875,007.08
应付管理人报酬	—	—	—	13,961.63	13,961.63
应付托管费	—	—	—	4,653.87	4,653.87
其他负债	—	—	—	94,849.32	94,849.32
负债总计	—	—	—	988,471.90	988,471.90
利率敏感度缺口	1,386,950.02	—	—	96,670,468.51	98,057,418.53

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	171,873,424.88	98.75	97,658,535.67	99.59
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	9,000.16	0.01	10,000.15	0.01
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	171,882,425.04	98.76	97,668,535.82	99.60

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%	1,734,269.61	925,745.10
	2. 业绩比较基准减少 1%	-1,734,269.61	-925,745.10

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	170,667,709.58	97,221,922.36
第二层次	9,000.16	10,000.15
第三层次	1,205,715.30	436,613.31
合计	171,882,425.04	97,668,535.82

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这

些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	171,873,424.88	98.28
	其中：股票	171,873,424.88	98.28
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	9,000.16	0.01
	其中：债券	9,000.16	0.01
	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	2,783,667.10	1.59
8	其他各项资产	214,276.80	0.12
9	合计	174,880,368.94	100.00

注：上表中的股票投资金额含可退替代款估值增值

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	551,914.00	0.32
B	采矿业	5,258,553.20	3.02
C	制造业	128,415,767.45	73.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,150,452.40	2.38
E	建筑业	1,003,375.00	0.58
F	批发和零售业	3,244,002.00	1.86
G	交通运输、仓储和邮政业	2,070,808.00	1.19
H	住宿和餐饮业	122,332.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,054,083.25	6.35
J	金融业	9,343,989.00	5.37
K	房地产业	686,425.00	0.39

L	租赁和商务服务业	1,746,054.00	1.00
M	科学研究和技术服务业	1,234,544.08	0.71
N	水利、环境和公共设施管理业	584,401.20	0.34
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	401,046.00	0.23
R	文化、体育和娱乐业	796,923.00	0.46
S	综合	—	—
	合计	170,664,669.58	98.06

7.2.1.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	15,243.90	0.01
C	制造业	1,190,471.40	0.68
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	1,205,715.30	0.69

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	688498	源杰科技	1,374	2,591,364.00	1.49
2	300604	长川科技	6,700	2,287,514.00	1.31
3	001309	德明利	2,400	2,262,960.00	1.30
4	688347	华虹宏力	6,221	2,092,122.30	1.20
5	688120	华海清科	5,981	1,926,958.58	1.11
6	002281	光迅科技	7,300	1,875,662.00	1.08
7	002008	大族激光	12,400	1,861,364.00	1.07
8	300857	协创数据	5,220	1,774,278.00	1.02
9	300136	信维通信	14,600	1,741,050.00	1.00
10	688361	中科飞测	3,732	1,604,760.00	0.92
11	300475	香农芯创	5,000	1,500,000.00	0.86
12	300223	君正股份	5,900	1,468,510.00	0.84
13	002436	兴森科技	25,700	1,309,415.00	0.75
14	300285	国瓷材料	12,000	1,238,160.00	0.71
15	300054	鼎龙股份	11,500	1,218,655.00	0.70
16	600105	永鼎股份	17,700	1,194,396.00	0.69
17	300666	江丰电子	3,200	1,179,520.00	0.68
18	688200	华峰测控	2,183	1,146,293.30	0.66
19	688777	中控技术	9,655	1,134,462.50	0.65
20	300757	罗博特科	1,800	1,114,200.00	0.64
21	688037	芯源微	2,431	1,067,330.55	0.61
22	000021	深科技	16,600	1,066,882.00	0.61
23	601869	长飞光纤	1,900	1,037,210.00	0.60
24	002851	麦格米特	6,200	1,036,516.00	0.60
25	300548	长芯博创	3,600	1,000,800.00	0.58
26	300346	南大光电	10,500	972,825.00	0.56
27	002409	雅克科技	4,300	965,350.00	0.55
28	688019	安集科技	2,744	931,478.24	0.54
29	300567	精测电子	2,900	921,040.00	0.53
30	600498	烽火通信	12,300	905,280.00	0.52
31	002185	华天科技	40,200	896,862.00	0.52
32	002138	顺络电子	12,200	891,820.00	0.51
33	002407	多氟多	17,500	879,025.00	0.51
34	688002	睿创微纳	5,645	873,225.05	0.50
35	688313	仕佳光子	4,719	871,363.35	0.50
36	300620	光库科技	2,300	869,860.00	0.50
37	600879	航天电子	39,900	849,471.00	0.49
38	300395	菲利华	6,300	842,499.00	0.48
39	300390	天华新能	8,800	822,888.00	0.47
40	688017	绿的谐波	1,936	808,976.96	0.46
41	688469	芯联集成	76,037	806,752.57	0.46

42	301526	国际复材	17,100	798,057.00	0.46
43	300373	扬杰科技	5,000	786,150.00	0.45
44	300058	蓝色光标	54,300	747,168.00	0.43
45	300037	新宙邦	8,000	742,800.00	0.43
46	002273	水晶光电	20,500	727,340.00	0.42
47	688702	盛科通信	1,855	723,431.45	0.42
48	688172	燕东微	8,624	721,483.84	0.41
49	603256	宏和科技	2,700	716,391.00	0.41
50	301377	鼎泰高科	1,300	716,170.00	0.41
51	300751	迈为股份	2,500	706,150.00	0.41
52	605358	立昂微	9,000	698,400.00	0.40
53	688099	晶晨股份	6,444	663,087.60	0.38
54	600988	赤峰黄金	25,100	660,632.00	0.38
55	605589	圣泉集团	10,200	648,414.00	0.37
56	600885	宏发股份	18,700	644,963.00	0.37
57	002126	银轮股份	12,800	637,440.00	0.37
58	000960	锡业股份	14,900	636,081.00	0.37
59	002738	中矿资源	10,700	631,193.00	0.36
60	600392	盛和资源	21,200	631,124.00	0.36
61	600601	方正科技	45,100	624,184.00	0.36
62	000831	中国稀土	11,200	621,488.00	0.36
63	600141	兴发集团	12,700	596,519.00	0.34
64	002812	恩捷股份	8,900	595,499.00	0.34
65	001389	广合科技	2,500	593,125.00	0.34
66	300570	太辰光	2,400	592,104.00	0.34
67	600378	昊华科技	7,800	587,964.00	0.34
68	601179	中国西电	38,700	577,404.00	0.33
69	301358	湖南裕能	7,600	576,612.00	0.33
70	688234	天岳先进	3,240	562,172.40	0.32
71	002195	岩山科技	85,700	560,478.00	0.32
72	600497	驰宏锌锗	45,700	553,427.00	0.32
73	002850	科达利	2,900	548,970.00	0.32
74	002261	拓维信息	19,100	534,991.00	0.31
75	600157	永泰能源	329,900	531,139.00	0.31
76	688629	华丰科技	2,783	521,840.33	0.30
77	688027	国盾量子	1,027	517,618.27	0.30
78	600711	盛屯矿业	46,800	513,396.00	0.29
79	002340	格林美	77,200	510,292.00	0.29
80	600909	华安证券	45,580	506,393.80	0.29
81	688411	海博思创	1,731	504,067.20	0.29
82	688052	纳芯微	1,739	501,371.09	0.29

83	600143	金发科技	32,400	500,580.00	0.29
84	300017	网宿科技	37,800	491,778.00	0.28
85	000783	长江证券	50,200	489,450.00	0.28
86	003031	中瓷电子	2,700	486,810.00	0.28
87	002131	利欧股份	102,400	486,400.00	0.28
88	002821	凯莱英	3,000	486,000.00	0.28
89	601555	东吴证券	60,100	475,992.00	0.27
90	600352	浙江龙盛	39,300	475,923.00	0.27
91	002203	海亮股份	20,800	475,280.00	0.27
92	002966	苏州银行	67,600	470,496.00	0.27
93	301200	大族数控	1,300	468,845.00	0.27
94	301611	珂玛科技	2,600	468,182.00	0.27
95	603659	璞泰来	16,100	465,773.00	0.27
96	601233	桐昆股份	21,500	465,475.00	0.27
97	300339	润和软件	12,000	462,120.00	0.27
98	688220	翱捷科技	3,702	460,232.64	0.26
99	300759	康龙化成	15,600	451,308.00	0.26
100	688213	思特威	4,178	447,338.46	0.26
101	688235	百济神州	1,737	442,257.57	0.25
102	688578	艾力斯	3,998	436,581.60	0.25
103	688122	西部超导	6,942	436,027.02	0.25
104	603308	应流股份	7,200	434,880.00	0.25
105	002472	双环传动	10,400	431,704.00	0.25
106	601108	财通证券	49,100	424,715.00	0.24
107	300207	欣旺达	22,300	423,477.00	0.24
108	300001	特锐德	11,100	419,913.00	0.24
109	002517	恺英网络	25,800	419,250.00	0.24
110	002797	第一创业	63,600	417,852.00	0.24
111	300458	全志科技	10,580	417,486.80	0.24
112	601958	金钼股份	14,600	410,406.00	0.24
113	688387	信科移动	20,634	409,378.56	0.24
114	603129	春风动力	1,600	409,280.00	0.24
115	688385	复旦微电	5,714	407,351.06	0.23
116	002601	龙佰集团	24,600	405,408.00	0.23
117	300115	长盈精密	14,400	402,336.00	0.23
118	601991	大唐发电	56,300	398,604.00	0.23
119	601198	东兴证券	29,300	398,187.00	0.23
120	688322	奥比中光	3,030	395,566.50	0.23
121	002155	湖南黄金	16,500	393,855.00	0.23
122	688301	奕瑞科技	3,130	388,120.00	0.22
123	000703	恒逸石化	28,300	384,031.00	0.22

124	002465	海格通信	30,000	383,100.00	0.22
125	600563	法拉电子	2,000	381,600.00	0.22
126	601665	齐鲁银行	65,200	376,204.00	0.22
127	603179	新泉股份	7,560	375,354.00	0.22
128	300454	深信服	3,900	375,180.00	0.22
129	002056	横店东磁	12,300	374,904.00	0.22
130	603156	养元饮品	7,600	372,932.00	0.21
131	600884	杉杉股份	27,200	368,560.00	0.21
132	600707	彩虹股份	21,700	366,513.00	0.21
133	300024	机器人	18,900	365,337.00	0.21
134	603650	彤程新材	3,700	362,526.00	0.21
135	002130	沃尔核材	19,100	362,136.00	0.21
136	601162	天风证券	106,600	359,242.00	0.21
137	002402	和而泰	13,900	359,037.00	0.21
138	000060	中金岭南	47,000	355,790.00	0.20
139	002429	兆驰股份	34,200	355,338.00	0.20
140	002432	九安医疗	5,000	353,400.00	0.20
141	300496	中科创达	5,700	352,203.00	0.20
142	300012	华测检测	25,400	352,044.00	0.20
143	000878	云南铜业	22,000	349,360.00	0.20
144	688331	荣昌生物	2,681	349,227.06	0.20
145	603379	三美股份	4,600	349,094.00	0.20
146	601099	太平洋	103,100	347,447.00	0.20
147	688676	金盘科技	4,089	346,092.96	0.20
148	600109	国金证券	39,200	344,176.00	0.20
149	000893	亚钾国际	8,400	343,476.00	0.20
150	002271	东方雨虹	28,900	343,043.00	0.20
151	002414	高德红外	25,800	342,108.00	0.20
152	002487	大金重工	5,900	342,023.00	0.20
153	000034	神州数码	12,300	341,325.00	0.20
154	002444	巨星科技	10,900	338,990.00	0.19
155	603688	石英股份	4,100	338,701.00	0.19
156	300623	捷捷微电	7,500	337,425.00	0.19
157	603979	金诚信	5,700	336,471.00	0.19
158	689009	九号公司	8,798	335,643.70	0.19
159	600256	广汇能源	67,700	334,438.00	0.19
160	000733	振华科技	5,900	334,176.00	0.19
161	002335	科华数据	7,865	333,869.25	0.19
162	600298	安琪酵母	9,200	333,040.00	0.19
163	000661	长春高新	5,000	333,000.00	0.19
164	300474	景嘉微	5,500	332,640.00	0.19

165	688728	格科微	15,732	331,001.28	0.19
166	600060	海信视像	11,800	328,866.00	0.19
167	002756	永兴材料	5,800	328,512.00	0.19
168	688266	泽璟制药	2,792	325,714.72	0.19
169	300763	锦浪科技	3,600	325,260.00	0.19
170	301536	星宸科技	2,500	321,775.00	0.18
171	601128	常熟银行	55,210	321,322.20	0.18
172	600021	上海电力	21,300	320,991.00	0.18
173	300748	金力永磁	10,400	320,840.00	0.18
174	600699	均胜电子	14,800	319,828.00	0.18
175	601577	长沙银行	36,500	317,915.00	0.18
176	601696	中银证券	25,100	317,515.00	0.18
177	300073	当升科技	6,600	317,064.00	0.18
178	002078	太阳纸业	25,300	315,997.00	0.18
179	601615	明阳智能	27,300	315,861.00	0.18
180	300142	沃森生物	24,200	314,358.00	0.18
181	002025	航天电器	4,100	312,502.00	0.18
182	603920	世运电路	6,500	312,260.00	0.18
183	603087	甘李药业	5,500	312,180.00	0.18
184	300432	富临精工	15,500	311,395.00	0.18
185	603606	东方电缆	7,500	311,325.00	0.18
186	300919	中伟新材	7,100	310,625.00	0.18
187	000423	东阿阿胶	6,800	308,448.00	0.18
188	002157	正邦科技	109,400	307,414.00	0.18
189	688343	云天励飞	3,714	303,285.24	0.17
190	002252	上海莱士	69,800	302,932.00	0.17
191	688599	天合光能	21,311	300,911.32	0.17
192	688608	恒玄科技	1,779	297,431.01	0.17
193	688169	石头科技	3,128	297,066.16	0.17
194	000728	国元证券	39,600	296,604.00	0.17
195	300724	捷佳伟创	4,200	296,520.00	0.17
196	300953	震裕科技	2,200	294,140.00	0.17
197	603119	浙江荣泰	4,330	287,252.20	0.17
198	002064	华峰化学	30,000	284,700.00	0.16
199	688375	国博电子	2,690	280,567.00	0.16
200	000786	北新建材	15,400	278,586.00	0.16
201	001203	大中矿业	9,300	278,535.00	0.16
202	603290	斯达半导	1,800	275,292.00	0.16
203	600171	上海贝岭	8,600	274,684.00	0.16
204	002831	裕同科技	7,652	272,105.12	0.16
205	300677	英科医疗	6,920	271,056.40	0.16

206	688018	乐鑫科技	2, 117	270, 806. 64	0. 16
207	688180	君实生物	7, 995	270, 390. 90	0. 16
208	688187	时代电气	3, 933	270, 039. 78	0. 16
209	300679	电连技术	4, 500	269, 955. 00	0. 16
210	300383	光环新网	21, 700	269, 948. 00	0. 16
211	000519	中兵红箭	12, 600	265, 482. 00	0. 15
212	603806	福斯特	15, 800	265, 282. 00	0. 15
213	002673	西部证券	40, 500	262, 845. 00	0. 15
214	600516	方大炭素	42, 600	262, 842. 00	0. 15
215	600177	雅戈尔	34, 900	262, 797. 00	0. 15
216	688188	柏楚电子	2, 451	261, 521. 70	0. 15
217	688065	凯赛生物	5, 456	261, 069. 60	0. 15
218	300972	万辰集团	1, 500	260, 115. 00	0. 15
219	603160	汇顶科技	4, 200	259, 182. 00	0. 15
220	000559	万向钱潮	20, 000	258, 600. 00	0. 15
221	601699	潞安环能	18, 100	258, 468. 00	0. 15
222	600642	申能股份	29, 500	257, 535. 00	0. 15
223	688568	中科星图	6, 166	255, 704. 02	0. 15
224	600637	东方明珠	30, 500	253, 455. 00	0. 15
225	001696	宗申动力	12, 100	251, 801. 00	0. 14
226	000623	吉林敖东	14, 200	251, 766. 00	0. 14
227	603444	吉比特	700	250, 894. 00	0. 14
228	603225	新凤鸣	12, 700	249, 555. 00	0. 14
229	002085	万丰奥威	22, 500	249, 525. 00	0. 14
230	000983	山西焦煤	42, 900	248, 820. 00	0. 14
231	000750	国海证券	67, 600	248, 768. 00	0. 14
232	603345	安井食品	3, 100	248, 589. 00	0. 14
233	002318	久立特材	10, 400	248, 560. 00	0. 14
234	002624	完美世界	20, 000	248, 400. 00	0. 14
235	300699	光威复材	8, 600	246, 390. 00	0. 14
236	002739	儒意电影	25, 500	244, 800. 00	0. 14
237	600100	同方股份	35, 400	242, 490. 00	0. 14
238	600369	西南证券	60, 300	242, 406. 00	0. 14
239	002065	东华软件	33, 900	242, 046. 00	0. 14
240	300558	贝达药业	3, 700	240, 759. 00	0. 14
241	600499	科达制造	17, 400	240, 120. 00	0. 14
242	002266	浙富控股	47, 300	239, 338. 00	0. 14
243	600536	中国软件	8, 500	239, 020. 00	0. 14
244	300627	华测导航	8, 400	238, 560. 00	0. 14
245	002044	美年健康	47, 400	238, 422. 00	0. 14
246	600595	中孚实业	42, 400	238, 288. 00	0. 14

247	603596	伯特利	9,572	237,768.48	0.14
248	603699	纽威股份	4,700	236,410.00	0.14
249	000155	川能动力	19,600	234,808.00	0.13
250	688772	珠海冠宇	11,953	234,637.39	0.13
251	000629	钒钛股份	70,200	234,468.00	0.13
252	000400	许继电气	10,800	234,360.00	0.13
253	002223	鱼跃医疗	9,100	233,506.00	0.13
254	688692	达梦数据	955	233,296.95	0.13
255	688617	惠泰医疗	1,280	232,396.80	0.13
256	300002	神州泰岳	29,700	231,957.00	0.13
257	300003	乐普医疗	19,500	231,075.00	0.13
258	601016	节能风电	59,400	230,472.00	0.13
259	000032	深桑达A	9,200	229,540.00	0.13
260	002430	杭氧股份	7,400	229,104.00	0.13
261	600985	淮北矿业	16,300	229,015.00	0.13
262	000415	渤海租赁	56,100	228,327.00	0.13
263	601216	君正集团	51,100	227,906.00	0.13
264	601212	白银有色	44,800	227,584.00	0.13
265	600521	华海药业	15,800	227,520.00	0.13
266	600862	中航高科	12,600	227,178.00	0.13
267	601997	贵阳银行	44,200	226,746.00	0.13
268	601717	中创智领	16,300	226,733.00	0.13
269	000683	博源化工	39,300	226,368.00	0.13
270	000039	中集集团	27,900	226,269.00	0.13
271	300487	蓝晓科技	3,800	223,630.00	0.13
272	600863	华能蒙电	47,300	222,310.00	0.13
273	603766	隆鑫通用	18,600	221,898.00	0.13
274	600704	物产中大	47,000	221,840.00	0.13
275	601001	晋控煤业	12,600	219,114.00	0.13
276	000050	深天马A	22,100	219,011.00	0.13
277	601990	南京证券	33,300	218,781.00	0.13
278	600873	梅花生物	29,600	217,560.00	0.13
279	002841	视源股份	6,300	217,539.00	0.12
280	688538	和辉光电	83,596	217,349.60	0.12
281	600312	平高电气	12,300	217,218.00	0.12
282	603077	和邦生物	93,500	216,920.00	0.12
283	000729	燕京啤酒	21,300	215,769.00	0.12
284	603605	珀莱雅	3,600	215,712.00	0.12
285	000967	盈峰环境	20,300	213,759.00	0.12
286	000887	中鼎股份	11,900	212,891.00	0.12
287	600332	白云山	10,600	212,424.00	0.12

288	600765	中航重机	16,400	211,888.00	0.12
289	688297	中无人机	5,087	211,364.85	0.12
290	600166	福田汽车	71,800	208,938.00	0.12
291	600348	华阳股份	27,300	208,845.00	0.12
292	600153	建发股份	26,300	208,559.00	0.12
293	000830	鲁西化工	17,300	207,600.00	0.12
294	000062	深圳华强	6,400	203,648.00	0.12
295	002939	长城证券	24,400	203,496.00	0.12
296	002410	广联达	24,900	203,184.00	0.12
297	601611	中国核建	18,200	202,930.00	0.12
298	002007	华兰生物	16,600	202,354.00	0.12
299	002683	广东宏大	6,900	202,101.00	0.12
300	600901	江苏金租	35,000	201,250.00	0.12
301	601799	星宇股份	2,200	199,364.00	0.11
302	600737	中粮糖业	16,100	198,513.00	0.11
303	688615	合合信息	1,754	198,377.40	0.11
304	688582	芯动联科	3,039	197,535.00	0.11
305	600578	京能电力	30,300	195,435.00	0.11
306	603728	鸣志电器	3,200	194,944.00	0.11
307	002926	华西证券	23,800	194,446.00	0.11
308	600363	联创光电	5,400	193,212.00	0.11
309	000921	海信家电	7,000	191,240.00	0.11
310	000737	北方铜业	14,400	190,368.00	0.11
311	000591	太阳能	41,300	189,980.00	0.11
312	600398	海澜之家	36,300	189,849.00	0.11
313	603568	伟明环保	12,340	189,789.20	0.11
314	603298	杭叉集团	7,900	188,494.00	0.11
315	600486	扬农化工	3,700	187,590.00	0.11
316	601000	唐山港	44,800	185,920.00	0.11
317	000528	柳工	24,600	185,730.00	0.11
318	002603	以岭药业	12,300	184,500.00	0.11
319	688114	华大智造	3,583	183,019.64	0.11
320	603341	龙旗科技	4,300	182,707.00	0.10
321	600208	衢州发展	64,400	182,252.00	0.10
322	600316	洪都航空	6,500	181,610.00	0.10
323	600008	首创环保	66,600	181,152.00	0.10
324	000738	航发控制	9,900	181,071.00	0.10
325	600435	北方导航	16,000	179,200.00	0.10
326	600170	上海建工	80,600	178,932.00	0.10
327	600998	九州通	38,100	178,689.00	0.10
328	600995	南网储能	14,500	178,350.00	0.10

329	000987	越秀资本	22,800	178,296.00	0.10
330	603486	科沃斯	3,500	177,625.00	0.10
331	688248	南网科技	2,556	176,824.08	0.10
332	002152	广电运通	18,800	176,344.00	0.10
333	000932	华菱钢铁	50,700	175,929.00	0.10
334	000997	新大陆	10,700	174,410.00	0.10
335	002262	恩华药业	9,300	174,375.00	0.10
336	600161	天坛生物	15,000	173,700.00	0.10
337	000951	中国重汽	8,900	173,639.00	0.10
338	600820	隧道股份	33,300	173,493.00	0.10
339	600483	福能股份	16,860	171,803.40	0.10
340	600282	南钢股份	37,300	171,207.00	0.10
341	601106	中国一重	51,800	170,940.00	0.10
342	000009	中国宝安	27,300	170,079.00	0.10
343	603885	吉祥航空	16,500	169,785.00	0.10
344	600583	海油工程	33,500	168,505.00	0.10
345	002500	山西证券	32,600	168,216.00	0.10
346	688778	厦钨新能	3,044	165,593.60	0.10
347	603816	顾家家居	7,400	165,464.00	0.10
348	603939	益丰药房	9,200	165,416.00	0.10
349	688295	中复神鹰	2,712	164,184.48	0.09
350	000582	北部湾港	15,300	164,169.00	0.09
351	600546	山煤国际	15,000	163,950.00	0.09
352	600763	通策医疗	4,800	162,624.00	0.09
353	603338	浙江鼎力	3,800	161,500.00	0.09
354	601666	平煤股份	22,400	160,160.00	0.09
355	600329	达仁堂	4,300	160,046.00	0.09
356	600562	国睿科技	7,500	159,150.00	0.09
357	601567	三星电气	10,600	158,364.00	0.09
358	688166	博瑞医药	4,515	158,070.15	0.09
359	003022	联泓新科	6,100	157,990.00	0.09
360	600685	中船防务	6,200	157,728.00	0.09
361	600038	中直股份	6,200	156,798.00	0.09
362	601156	东航物流	9,700	156,364.00	0.09
363	600380	健康元	16,592	156,296.64	0.09
364	600602	云赛智联	9,700	155,976.00	0.09
365	600390	五矿资本	34,000	155,040.00	0.09
366	603565	中谷物流	15,800	154,998.00	0.09
367	300676	华大基因	4,400	154,264.00	0.09
368	688318	财富趋势	2,156	153,744.36	0.09
369	601880	辽港股份	111,300	153,594.00	0.09

370	002312	川发龙蟒	16,700	153,139.00	0.09
371	000513	丽珠集团	5,300	153,117.00	0.09
372	601399	国机重装	43,700	152,950.00	0.09
373	000723	美锦能源	45,600	152,760.00	0.09
374	601865	福莱特	14,400	151,344.00	0.09
375	600535	天士力	11,300	149,499.00	0.09
376	600132	重庆啤酒	3,600	148,680.00	0.09
377	600511	国药股份	5,700	148,428.00	0.09
378	000739	普洛药业	8,800	146,608.00	0.08
379	600906	财达证券	19,600	146,216.00	0.08
380	601236	红塔证券	21,400	145,948.00	0.08
381	600816	建元信托	59,600	145,424.00	0.08
382	688281	华秦科技	2,889	145,114.47	0.08
383	600977	中国电影	11,200	144,704.00	0.08
384	300100	双林股份	5,200	144,456.00	0.08
385	000598	兴蓉环境	22,500	144,450.00	0.08
386	002299	圣农发展	9,500	144,020.00	0.08
387	002244	滨江集团	18,845	143,222.00	0.08
388	688336	三生国健	2,690	142,839.00	0.08
389	600970	中材国际	19,900	141,887.00	0.08
390	601155	新城控股	13,700	140,562.00	0.08
391	600967	内蒙一机	12,900	139,965.00	0.08
392	002120	韵达股份	21,900	139,284.00	0.08
393	300146	汤臣倍健	15,400	139,216.00	0.08
394	000883	湖北能源	32,200	139,104.00	0.08
395	300735	光弘科技	6,100	138,714.00	0.08
396	300144	宋城演艺	23,800	138,278.00	0.08
397	688363	华熙生物	3,844	137,499.88	0.08
398	300718	长盛轴承	2,200	134,134.00	0.08
399	688278	特宝生物	2,460	133,824.00	0.08
400	000027	深圳能源	21,500	133,300.00	0.08
401	600131	国网信通	9,100	132,860.00	0.08
402	601608	中信重工	27,700	132,129.00	0.08
403	603737	三棵树	5,440	131,104.00	0.08
404	003021	兆威机电	1,500	131,025.00	0.08
405	601866	中远海发	59,000	130,390.00	0.07
406	600095	湘财股份	17,300	130,269.00	0.07
407	000800	一汽解放	21,800	129,710.00	0.07
408	000088	盐田港	31,500	128,835.00	0.07
409	002568	百润股份	7,600	128,592.00	0.07
410	601118	海南橡胶	25,900	127,428.00	0.07

411	600566	济川药业	5,700	126,483.00	0.07
412	600801	华新建材	8,100	126,360.00	0.07
413	600126	杭钢股份	20,400	125,052.00	0.07
414	600871	石化油服	61,400	124,642.00	0.07
415	603000	人民网	8,400	124,236.00	0.07
416	002583	海能达	16,100	123,809.00	0.07
417	600754	锦江酒店	6,800	122,332.00	0.07
418	000709	河钢股份	62,600	121,444.00	0.07
419	600517	国网英大	25,900	121,212.00	0.07
420	600655	豫园股份	29,400	120,834.00	0.07
421	002984	森麒麟	9,197	120,204.79	0.07
422	603589	口子窖	6,400	119,552.00	0.07
423	000825	太钢不锈	34,400	117,304.00	0.07
424	600598	北大荒	10,800	117,072.00	0.07
425	603858	步长制药	8,000	116,800.00	0.07
426	601598	中国外运	23,400	116,064.00	0.07
427	301606	绿联科技	1,900	115,938.00	0.07
428	600350	山东高速	10,300	114,639.00	0.07
429	001286	陕西能源	11,300	114,582.00	0.07
430	002773	康弘药业	5,600	114,520.00	0.07
431	002423	中粮资本	13,900	114,397.00	0.07
432	603899	晨光股份	5,500	113,465.00	0.07
433	600004	白云机场	15,500	112,530.00	0.06
434	601966	玲珑轮胎	11,000	112,090.00	0.06
435	688192	迪哲医药	2,807	112,083.51	0.06
436	600663	陆家嘴	17,800	111,784.00	0.06
437	600582	天地科技	25,000	111,250.00	0.06
438	688349	三一重能	7,256	110,146.08	0.06
439	688709	成都华微	2,860	108,937.40	0.06
440	600848	上海临港	14,500	108,605.00	0.06
441	000429	粤高速A	7,900	107,835.00	0.06
442	601098	中南传媒	10,900	107,256.00	0.06
443	688563	航材股份	2,048	104,919.04	0.06
444	002508	老板电器	7,100	103,802.00	0.06
445	603233	大参林	6,900	103,707.00	0.06
446	600968	海油发展	30,700	102,231.00	0.06
447	601928	凤凰传媒	11,500	101,085.00	0.06
448	600062	华润双鹤	6,300	101,052.00	0.06
449	300957	贝泰妮	3,200	100,832.00	0.06
450	003035	南网能源	17,200	100,104.00	0.06
451	688561	奇安信	4,108	98,509.84	0.06

452	300888	稳健医疗	3,500	97,965.00	0.06
453	600688	上海石化	33,300	97,569.00	0.06
454	688425	铁建重工	24,230	97,404.60	0.06
455	601808	中海油服	9,000	97,290.00	0.06
456	002670	国盛证券	8,800	96,800.00	0.06
457	600295	鄂尔多斯	9,000	96,480.00	0.06
458	002032	苏泊尔	2,400	95,040.00	0.05
459	600098	广州发展	15,800	93,378.00	0.05
460	688708	佳驰科技	1,811	91,998.80	0.05
461	000539	粤电力A	13,500	91,935.00	0.05
462	000537	绿发电力	12,400	90,644.00	0.05
463	600808	马钢股份	36,100	90,250.00	0.05
464	600377	宁沪高速	7,500	86,775.00	0.05
465	002153	石基信息	12,000	86,760.00	0.05
466	600292	电投水电	7,200	86,688.00	0.05
467	601298	青岛港	10,600	85,330.00	0.05
468	000959	首钢股份	23,500	82,485.00	0.05
469	002265	建设工业	4,700	81,780.00	0.05
470	603833	欧派家居	2,700	81,297.00	0.05
471	301301	川宁生物	10,100	80,194.00	0.05
472	002608	江苏国信	11,500	79,350.00	0.05
473	603786	科博达	1,900	77,729.00	0.04
474	600339	中油工程	25,300	77,671.00	0.04
475	600032	浙江新能	11,000	77,550.00	0.04
476	600606	绿地控股	63,300	76,593.00	0.04
477	603529	爱玛科技	3,900	76,089.00	0.04
478	000785	居然智家	37,800	75,600.00	0.04
479	603658	安图生物	2,600	75,452.00	0.04
480	600764	中国海防	4,300	74,949.00	0.04
481	601139	深圳燃气	13,000	73,580.00	0.04
482	301498	乖宝宠物	1,800	73,062.00	0.04
483	688520	神州细胞	2,120	72,525.20	0.04
484	000937	冀中能源	17,590	70,008.20	0.04
485	300140	节能环保	13,800	68,586.00	0.04
486	000898	鞍钢股份	36,100	67,507.00	0.04
487	603049	中策橡胶	1,500	67,215.00	0.04
488	688475	萤石网络	2,370	64,819.50	0.04
489	601228	广州港	22,800	64,296.00	0.04
490	603175	超颖电子	700	62,363.00	0.04
491	601019	山东出版	9,500	60,800.00	0.03
492	002945	华林证券	4,100	55,063.00	0.03

493	600927	永安期货	4,400	54,780.00	0.03
494	601112	振石股份	2,900	52,867.00	0.03
495	002461	珠江啤酒	6,600	49,962.00	0.03
496	600299	安迪苏	6,100	47,885.00	0.03
497	688819	天能股份	2,032	45,110.40	0.03
498	603092	德力佳	500	26,985.00	0.02
499	001221	悍高集团	600	24,132.00	0.01
500	001386	马可波罗	1,600	22,656.00	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	688783	西安奕材	6,286	360,942.12	0.21
2	688795	摩尔线程	394	266,714.36	0.15
3	301666	大普微	288	133,439.04	0.08
4	688808	联讯仪器	51	80,800.83	0.05
5	688781	视涯科技	1,674	70,575.84	0.04
6	688820	盛合晶微	287	40,607.63	0.02
7	688797	臻宝科技	69	32,338.23	0.02
8	301682	宏明电子	177	28,330.62	0.02
9	001399	惠科股份	934	25,899.82	0.01
10	688813	泰金新能	136	23,404.24	0.01
11	688635	长进光子	75	23,114.25	0.01
12	001257	盛龙股份	735	15,243.90	0.01
13	688811	有研复材	589	14,212.57	0.01
14	301531	春光集团	223	11,497.88	0.01
15	301696	三瑞智能	126	10,936.80	0.01
16	603459	红板科技	127	10,708.64	0.01
17	603407	长裕集团	129	9,476.34	0.01
18	301599	理奇智能	250	8,117.50	0.00
19	301513	尚水智能	130	6,624.80	0.00
20	001365	天海电子	190	5,948.90	0.00
21	301680	固德电材	50	5,608.00	0.00
22	001393	维通利	137	5,341.63	0.00
23	301683	慧谷新材	40	4,870.80	0.00
24	001237	惠康科技	78	4,581.72	0.00
25	603435	嘉德利	86	4,017.06	0.00
26	001312	福恩股份	72	1,208.16	0.00
27	603293	埃泰克	34	1,153.62	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	688525	佰维存储	3,777,856.73	3.85
2	688498	源杰科技	2,630,472.46	2.68
3	688347	华虹宏力	2,418,684.33	2.47
4	600487	亨通光电	2,033,615.00	2.07
5	688002	睿创微纳	1,938,338.26	1.98
6	001309	德明利	1,860,226.00	1.90
7	688099	晶晨股份	1,738,677.40	1.77
8	600549	厦门钨业	1,694,933.00	1.73
9	688213	思特威	1,636,938.14	1.67
10	688676	金盘科技	1,624,824.74	1.66
11	688578	艾力斯	1,613,444.80	1.65
12	600879	航天电子	1,565,608.00	1.60
13	600988	赤峰黄金	1,405,018.00	1.43
14	688385	复旦微电	1,272,592.15	1.30
15	688122	西部超导	1,267,709.00	1.29
16	600118	中国卫星	1,250,415.00	1.28
17	688027	国盾量子	1,236,414.22	1.26
18	600580	卧龙电驱	1,211,134.00	1.24
19	601799	星宇股份	1,138,905.00	1.16
20	601168	西部矿业	1,126,255.00	1.15

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	688525	佰维存储	5,250,085.90	5.35
2	600487	亨通光电	5,037,399.00	5.14
3	600549	厦门钨业	2,467,995.00	2.52
4	301308	江波龙	2,272,227.00	2.32
5	688347	华虹宏力	2,144,336.73	2.19
6	688002	睿创微纳	1,729,553.69	1.76
7	600118	中国卫星	1,670,116.00	1.70
8	601168	西部矿业	1,624,199.00	1.66
9	600673	东阳光	1,622,771.00	1.65
10	002353	杰瑞股份	1,502,024.00	1.53

11	600580	卧龙电驱	1,500,069.00	1.53
12	688213	思特威	1,451,488.48	1.48
13	688578	艾力斯	1,421,519.80	1.45
14	688676	金盘科技	1,404,393.50	1.43
15	688099	晶晨股份	1,388,766.21	1.42
16	603228	景旺电子	1,368,598.00	1.40
17	600096	云天化	1,331,561.00	1.36
18	000657	中钨高新	1,206,796.00	1.23
19	002156	通富微电	1,185,289.00	1.21
20	600879	航天电子	1,181,067.00	1.20

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	167,518,937.18
卖出股票收入（成交）总额	144,519,375.33

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）	9,000.16	0.01
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	9,000.16	0.01

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	118071	华峰转债	90	9,000.16	0.01

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场定性和定量的分析，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控，主要选择流动性好、交易活跃的国债期货合约，以降低交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	214,276.80
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	214,276.80

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未持有流通受限的股票。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688783	西安奕材	360,942.12	0.21	新股限售
2	688795	摩尔线程	266,714.36	0.15	新股限售
3	301666	大普微	133,439.04	0.08	新股限售
4	688808	联讯仪器	80,800.83	0.05	新股限售
5	688781	视涯科技	70,575.84	0.04	新股限售

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

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		富国中证 500 交易型开放 式指数证券投资基金发起 式联接基金	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
4,232	30,562.11	38,479,720 .00	29.75	90,859,145 .00	70.25	25,722,563 .00	19.89

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“富国中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	—	—

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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2025 年 08 月 20 日）基金份额总额	571,738,865.00
本报告期期初基金份额总额	90,138,865.00
本报告期基金总申购份额	198,800,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	159,600,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	129,338,865.00

§ 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、基金财产的诉讼。

本报告期内无涉及本基金托管业务的诉讼事项。

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：本报告期无托管人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：本报告期无托管人相关从业人员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（%）	
国泰海通	6	311,317,430.02	100.00	42,322.93	100.00	—

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

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例（%）	成交金额	占当期权证成交总额的比例（%）
国泰海通	64,365.70	100.00	—	—	—	—

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2026年03月19日
2	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2026年03月19日
3	关于富国基金管理有限公司旗下部分深交所上市基金变更场内简称的公告	规定披露媒介	2026年03月20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 04 月 01 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 09 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 23 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 05 月 21 日
8	富国基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	规定披露媒介	2026 年 06 月 27 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期无单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

一、本报告期内，经向深圳证券交易所申请并获得同意，本基金管理人决定自 2026 年 3 月 20 日起将本基金的场内简称由“500ETF”变更为“中证 500ETF 富国”。具体可参见基金管理人于 2026 年 3 月 20 日发布的《关于富国基金管理有限公司旗下部分深交所上市基金变更场内简称的公告》。

二、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500 交易型开放式指数证券投资基金的文件 2、富国中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同 3、富国中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议 4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件 5、富国中证 500 交易型开放式指数证券投资基金财务报表及报表附注 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费）公司网址： http://www.fullgoal.com.cn 。