

富国中证 A500 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：国投证券股份有限公司

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。

基金托管人国投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

§ 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	7
§ 4	管理人报告	9
4.1	基金管理人及基金经理情况	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 5	托管人报告	15
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
§ 6	半年度财务报告（未经审计）	16
6.1	资产负债表	16
6.2	利润表	17
6.3	净资产变动表	18
6.4	报表附注	19
§ 7	投资组合报告	42
7.1	期末基金资产组合情况	42

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	58
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	59
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.....	59
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.....	59
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.12 投资组合报告附注	59
§ 8 基金份额持有人信息	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
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.....	62
§ 9 开放式基金份额变动	63
§ 10 重大事件揭示	64
10.1 基金份额持有人大会决议	64
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.....	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
10.4 基金投资策略的改变	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	64
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.....	65
10.8 其他重大事件	65
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	67
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	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	67
§ 12 备查文件目录	68

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	富国中证 A500ETF
场内简称	A500ETF 富国
基金主代码	563220
交易代码	563220
基金运作方式	契约型，交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 09 月 25 日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	国投证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	5,963,013,687.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2024 年 10 月 15 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 A500 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	国投证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	郭刚
	联系电话	021-20361818	0755-81682162
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	tgfw@sdicsc.com.cn
客户服务电话		95105686、4008880688	0755-81682208
传真		021-20361616	—
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	深圳市福田区福田街道福华一路 119 号安信金融大厦

办公地址	上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	深圳市福田区福田街道福华一路 119 号安信金融大厦 15 层资产托管部
邮政编码	200120	518046
法定代表人	陈戈	王苏望

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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 国投证券股份有限公司 深圳市福田区福田街道福华一路 119 号安信金融大厦 15 层资产托管部

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	1,372,713,224.22
本期利润	1,288,880,722.23
加权平均基金份额本期利润	0.1677
本期加权平均净值利润率	12.91%
本期基金份额净值增长率	12.80%
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	1,738,135,485.95
期末可供分配基金份额利润	0.2915
期末基金资产净值	8,337,488,247.58
期末基金份额净值	1.3982
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	39.82%

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	15.11%	1.40%	14.26%	1.41%	0.85%	-0.01%
过去六个月	12.80%	1.28%	11.91%	1.29%	0.89%	-0.01%
过去一年	38.88%	1.14%	36.38%	1.14%	2.50%	0.00%
自基金合同生效起至今	39.82%	1.20%	62.54%	1.35%	-22.72%	-0.15%

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。

§ 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		
王乐乐	本基金现任基金经理	2024-09-25	—	16	博士，曾任上海证券有限责任公司研究员，华泰联合证券有限责任公司研究员，华泰证券股份有限公司研究员、创新规划团队负责人；自 2015 年 5 月加入富国基金管理有限公司，历任定量基金经理、量化投资部量化投资总监助理、高级定量基金经理、量化投资部 ETF

				投资总监；现任富国基金量化投资部ETF 投资总监兼指数投资部总经理，兼任富国基金高级定量基金经理。自 2019 年 07 月起任富国中证军工龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2019 年 10 月起任富国中证消费 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2019 年 11 月起任富国中证科技 50 策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2020 年 02 月起任富国中证科技 50 策略交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；自 2020 年 03 月起任富国中证消费 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；自 2020 年 03 月起任富国中证医药 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2020 年 07 月起任富国上海金交易型开放式证券投资基金基金经理；自 2020 年 07 月起任富国上海金交易型开放式证券投资基金联接基金基金经理；自 2022 年 07 月起任富国中证上海环交所碳中和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 A100 交易型开放式指数证券投资基金(原富国中证 100 交易型开放式指数证券投资基金)基金经理；自 2022 年 12 月起任富国北证 50 成份指数型证券投资基金基金经理；自 2023 年 06 月起任富国中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；自 2023 年 11 月起任富国中证医药 50 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 06 月起任富国中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(原富国中证 100 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 09 月起任富国中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2024 年 11 月起任富国中证 A500 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 2026 年 03 月起任富国沪深 300ESG 基准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 2026 年 03 月起任富国沪深 300ESG 基准交易型开放式指数证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。
苏华清	本基金现任基金经理	2024-09-25	—	8	硕士，曾任中证指数有限公司研究员；自 2022 年 6 月加入富国基金管理有限公司，历任定量研究员、定量基金经理；现任富国基金指数投资部定量基金经理。自 2023 年 11 月起任富国深证 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2024 年 01 月起任富国深证 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 2024 年 03 月起任富国中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2024 年 04 月起任富国中证 A50 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 06 月起任富国中证通信设备主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2024 年 08 月起任富国中证通信设备主题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 09 月起任富国中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2024 年 11 月起任富国中证 A500 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 月起任富国恒生 A 股专精特新企业交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2025 年 02 月起任富国上证科创板新能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2025 年 04 月起任富国上证科创板新能源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 05 月起任富国恒生 A 股专精特新企业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；自 2025 年 05 月起任富国中证诚通国企数字经济交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2025 年 09 月起任富国创业板软件交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2025 年 09 月起任富国国证机器人产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2026 年 01 月起

					任富国中证智选船舶产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。
--	--	--	--	--	---

注：1、上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；

首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国中证 A500 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 A500 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 11 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 1.3982 元；份额累计净值为 1.3982 元；本报告期，本基金份额净值增长率为 12.80%；同期业绩比较基准收益率为 11.91%。

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，国投证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现本基金管理人存在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

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况（如有）、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整。

§ 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 A500 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	27,177,013.96	35,371,036.71
结算备付金	2,636,276.01	2,828,477.45
存出保证金	1,668,897.60	3,027,921.60
交易性金融资产	8,317,167,039.34	14,220,465,012.42
其中：股票投资	8,316,660,032.67	14,220,465,012.42
基金投资	—	—
债券投资	507,006.67	—
资产支持证券投资	—	—
贵金属投资	—	—
其他投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收清算款	—	—
应收股利	—	—
应收申购款	—	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	8,348,649,226.91	14,261,692,448.18
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	9,224,208.33	7,701,381.16
应付赎回款	—	—
应付管理人报酬	971,251.26	1,774,489.69
应付托管费	323,750.43	591,496.56
应付销售服务费	—	—
应付投资顾问费	—	—
应交税费	95,699.26	11,482.07

应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	546,070.05	179,884.00
负债合计	11,160,979.33	10,258,733.48
净资产：		
实收基金	5,963,013,687.00	11,498,013,687.00
未分配利润	2,374,474,560.58	2,753,420,027.70
净资产合计	8,337,488,247.58	14,251,433,714.70
负债和净资产总计	8,348,649,226.91	14,261,692,448.18

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.3982 元，基金份额总额 5,963,013,687.00 份。

6.2 利润表

会计主体：富国中证 A500 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)	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	1,299,035,754.75	344,122,491.93
1. 利息收入	97,605.58	255,472.84
其中：存款利息收入	97,605.58	255,472.84
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）	1,377,151,462.71	-47,393,376.12
其中：股票投资收益	1,302,309,575.11	-242,419,301.45
基金投资收益	—	—
债券投资收益	6.49	195,993.10
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具收益	3,751,364.26	399,723.24
股利收益	71,090,516.85	194,430,208.99
其他投资收益	—	—
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-83,832,501.99	379,725,149.56
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	5,619,188.45	11,535,245.65
减：二、营业总支出	10,155,032.52	17,586,338.80
1. 管理人报酬	7,473,736.81	13,044,374.80
2. 托管费	2,491,245.64	4,348,124.98

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	13,516.84	2,429.40
8. 其他费用	176,533.23	191,409.62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	1,288,880,722.23	326,536,153.13
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	1,288,880,722.23	326,536,153.13
五、其他综合收益的税后净额	—	—
六、综合收益总额	1,288,880,722.23	326,536,153.13

6.3 净资产变动表

会计主体：富国中证 A500 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	11,498,013,687.00	2,753,420,027.70	14,251,433,714.70
二、本期期初净资产	11,498,013,687.00	2,753,420,027.70	14,251,433,714.70
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	5,535,000,000.00	-378,945,467.12	5,913,945,467.12
（一）、综合收益总额	—	1,288,880,722.23	1,288,880,722.23
（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）	5,535,000,000.00	1,667,826,189.35	7,202,826,189.35
其中：1. 基金申购款	3,039,000,000.00	907,091,809.00	3,946,091,809.00
2. 基金赎回款	8,574,000,000.00	2,574,917,998.35	11,148,917,998.35
（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	5,963,013,687.00	2,374,474,560.58	8,337,488,247.58
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	16,628,013,687.00	-152,177,984.80	16,475,835,702.20

二、本期期初净资产	16,628,013,687.00	-152,177,984.80	16,475,835,702.20
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,733,000,000.00	246,919,023.34	2,486,080,976.66
（一）、综合收益总额	—	326,536,153.13	326,536,153.13
（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）	2,733,000,000.00	-79,617,129.79	2,812,617,129.79
其中：1. 基金申购款	10,431,000,000.00	-317,161,460.18	10,113,838,539.82
2. 基金赎回款	13,164,000,000.00	237,544,330.39	12,926,455,669.61
（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	13,895,013,687.00	94,741,038.54	13,989,754,725.54

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

陈 戈

林志松

徐慧

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

富国中证 A500 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”）[2024]1268 号文《关于准予富国中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予公开募集注册。由基金管理人富国基金管理有限公司自 2024 年 9 月 10 日至 2024 年 9 月 20 日止向社会公开发行募集。募集期结束经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具德师报(验)字(24)第 00179 号后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2024 年 09 月 25 日正式生效。本基金为契约型，交易型开放式，存续期限不定。设立时募集的净有效认购金额为人民币 1,999,997,396.00 元，折算成基金份额计 1,999,997,396.00 份（其中，网上现金认购确认净有效认购资金为人民币 1,943,819,258.00 元，折算成基金份额计 1,943,819,258.00 份；网下现金认购确认净有效认购资金为人民币 56,178,138.00 元，折算成基金份额计 56,178,138.00 份）；有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币 704,739.79 元。（其中，根据注册登记机构的记录，网上现金认

购有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币 688,447.81 元，其中，利息折份额部分为人民币 0.00 元，折算成基金份额计 0.00 份；网下现金认购有效认购资金在募集期间产生的折算基金份额的利息为人民币 16,291.98 元，折算成基金份额计 16,291.00 份，剩余部分为人民币 0.98 元，计入基金财产，不折算成投资者基金份额。）。至此，富国中证 A500ETF 募集的实收基金为人民币 2,000,013,687.00 元，折算成基金份额合计 2,000,013,687.00 份。本基金管理人为富国基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为国投证券股份有限公司。

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%。

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 A500 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	204,462.19
等于：本金	204,393.22
加：应计利息	68.97
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	26,972,551.77
等于：本金	26,964,791.86
加：应计利息	7,759.91
减：坏账准备	—
合计	27,177,013.96

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		7,270,518,906.58	—	8,316,660,032.67	1,046,141,126.09
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	507,000.00	6.67	507,006.67	—
	银行间市场	—	—	—	—
	合计	507,000.00	6.67	507,006.67	—
资产支持证券		—	—	—	—
基金		—	—	—	—
其他		—	—	—	—
合计		7,271,025,906.58	6.67	8,317,167,039.34	1,046,141,126.09

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	13,876,820.00	—	—	—
股指期货	13,876,820.00	—	—	—
其他衍生工具	—	—	—	—
合计	13,876,820.00	—	—	—

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
IF2607	IF2607	7.00	10,336,200.00	-17,340.00
IC2607	IC2607	2.00	3,571,280.00	48,000.00
合计				30,660.00
减：可抵销期货暂收款				30,660.00
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	142,108.87
IOPV 计算发布费	29,916.99
预提注册登记费	59,507.37
其他	254,536.82
合计	546,070.05

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	11,498,013,687.00	11,498,013,687.00
本期申购	3,039,000,000.00	3,039,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-8,574,000,000.00	-8,574,000,000.00
本期末	5,963,013,687.00	5,963,013,687.00

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	1,309,852,128.00	1,443,567,899.70	2,753,420,027.70
本期期初	1,309,852,128.00	1,443,567,899.70	2,753,420,027.70
本期利润	1,372,713,224.22	-83,832,501.99	1,288,880,722.23
本期基金份额交易产生的变动数	-944,429,866.27	-723,396,323.08	-1,667,826,189.35
其中：基金申购款	651,566,196.53	255,525,612.47	907,091,809.00
基金赎回款	-1,595,996,062.80	-978,921,935.55	-2,574,917,998.35

本期已分配利润	—	—	—
本期末	1,738,135,485.95	636,339,074.63	2,374,474,560.58

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	7,421.02
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	66,114.41
结算备付金利息收入	24,070.15
其他	—
合计	97,605.58

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	900,743,432.04
股票投资收益——赎回差价收入	401,566,143.07
股票投资收益——申购差价收入	—
合计	1,302,309,575.11

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	6,672,869,084.87
减：卖出股票成本总额	5,766,775,376.47
减：交易费用	5,350,276.36
买卖股票差价收入	900,743,432.04

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	11,148,917,998.35
减：现金支付赎回款总额	5,383,547,884.35
减：赎回股票成本总额	5,363,803,970.93
减：交易费用	—
赎回差价收入	401,566,143.07

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	6.49
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	—
合计	6.49

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无买卖债券差价收入。

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	3,751,364.26

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	71,090,516.85
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	71,090,516.85

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	-83,393,201.99
股票投资	-83,393,201.99
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	-439,300.00
权证投资	—
股指期货	-439,300.00
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	-83,832,501.99

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	5,619,188.45
合计	5,619,188.45

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	47,108.87
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	—
其他	69,424.36
合计	176,533.23

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
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
国投证券股份有限公司（“国投证券”）	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 A500 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：（1）关联方国泰海通证券股份有限公司（简称“国泰海通”）是由原国泰君安证券股份有限公司与原关联方海通证券股份有限公司于 2025 年 3 月 14 日合并组建而成。

（2）以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2026年01月01日至2026年06月30日）	上年度可比期间（2025年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	7,473,736.81	13,044,374.80
其中：应支付销售机构的客户维护费	649,670.21	2,027,853.41
应支付基金管理人的净管理费	6,824,066.60	11,016,521.39

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。

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	2,491,245.64	4,348,124.98

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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 (%)
国泰海通证券股份有限公司	24,239,441.00	0.41	27,268,657.00	0.24
国投证券股份有限公司	6,032,146.00	0.10	96,980,714.00	0.84
申万宏源证券有限公司	25,585,180.00	0.43	1,138,601,145.00	9.90

富国中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1,527,992,730.00	25.62	1,827,242,730.00	15.89
---------------------------------	------------------	-------	------------------	-------

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未发生关联方银行存款业务。

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	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	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

为更紧密地跟踪标的指数，降低跟踪误差，经与基金托管人协商一致，本基金在报告期内根据基金合同约定的投资策略投资于基金管理人股东发行的股票国泰海通（601211.SH）、基金托管人关联方发行的股票国投电力（600886.SH）、瀚蓝环境（600323.SH）。

本报告期末，本基金持有国泰海通 2,828,447 股，占基金资产净值比例 0.62%。上年度末，本基金持有国泰海通 5,602,336 股，占基金资产净值比例 0.81%。

本报告期末，本基金持有国投电力 600,000 股，占基金资产净值比例 0.10%。上年度末，本基金持有国投电力 1,190,200 股，占基金资产净值比例 0.11%。

本报告期末，本基金持有瀚蓝环境 125,200 股，占基金资产净值比例 0.04%。上年度末，本基金持有瀚蓝环境 245,900 股，占基金资产净值比例 0.05%。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

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
001312	福恩股份	2026-04-14	6 个月	新股限售	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	—
001365	天海电子	2026-05-11	6 个月	新股限售	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	—
001393	维通利	2026-05-08	6 个月	新股限售	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	—
001399	惠科股份	2026-06-16	6 个月	新股限售	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	—
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-	6 个月	新股限售	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	—

		22								
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	—
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	2026-05-20	6 个月	新股限售	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	—
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	—
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	10,828	1,237,423.84	7,329,906.32	—
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	3,994	418,012.04	3,070,946.66	—
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-	6 个月	新股限售	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	—

		01								
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	—
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	2,391	47,054.88	338,302.59	—

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
111025	圣泉转债	2026-06-25	1 个月内（含）	认购新发证券	100.00	100.00	5,070	507,000.00	507,006.67	—

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	49,743.00	16,115,794.16	41,386,176.00	—

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	507,006.67	—
未评级	—	—
合计	507,006.67	—

注：本基金上年度末未持有按长期信用评级列示的信用债。本表主要列示除短融和超短融之外的信用债，债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本基金本报告期末无重大流动性风险。

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	27,177,013.96	—	—	—	27,177,013.96
结算备付金	2,636,276.01	—	—	—	2,636,276.01
存出保证金	—	—	—	1,668,897.60	1,668,897.60
交易性金融资产	507,006.67	—	—	8,316,660,032.67	8,317,167,039.34
资产总计	30,320,296.64	—	—	8,318,328,930.27	8,348,649,226.91
负债					
应付清算款	—	—	—	9,224,208.33	9,224,208.33
应付管理人报酬	—	—	—	971,251.26	971,251.26
应付托管费	—	—	—	323,750.43	323,750.43
应交税费	—	—	—	95,699.26	95,699.26
其他负债	—	—	—	546,070.05	546,070.05
负债总计	—	—	—	11,160,979.33	11,160,979.33
利率敏感度缺口	30,320,296.64	—	—	8,307,167,950.94	8,337,488,247.58
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	35,371,036.71	—	—	—	35,371,036.71
结算备付金	2,828,477.45	—	—	—	2,828,477.45
存出保证金	—	—	—	3,027,921.60	3,027,921.60
交易性金融资产	—	—	—	14,220,465,012.42	14,220,465,012.42
资产总计	38,199,514.16	—	—	14,223,492,934.02	14,261,692,448.18
负债					
应付清算款	—	—	—	7,701,381.16	7,701,381.16
应付管理人报酬	—	—	—	1,774,489.69	1,774,489.69

应付托管费	—	—	—	591,496.56	591,496.56
应交税费	—	—	—	11,482.07	11,482.07
其他负债	—	—	—	179,884.00	179,884.00
负债总计	—	—	—	10,258,733.48	10,258,733.48
利率敏感度缺口	38,199,514.16	—	—	14,213,234,200.54	14,251,433,714.70

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	8,316,660,032.67	99.75	14,220,465,012.42	99.78
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	507,006.67	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	8,317,167,039.34	99.76	14,220,465,012.42	99.78

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%	83,321,107.96	142,601,296.88
	2. 业绩比较基准减少 1%	-83,321,107.96	-142,601,296.88

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	8,260,457,795.85	14,109,591,973.98

第二层次	41,908,349.77	88,020,195.28
第三层次	14,800,893.72	22,852,843.16
合计	8,317,167,039.34	14,220,465,012.42

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	8,316,660,032.67	99.62
	其中：股票	8,316,660,032.67	99.62
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	507,006.67	0.01
	其中：债券	507,006.67	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	29,813,289.97	0.36
8	其他各项资产	1,668,897.60	0.02
9	合计	8,348,649,226.91	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	26,241,613.00	0.31
B	采矿业	341,402,016.76	4.09
C	制造业	5,870,299,313.74	70.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	180,921,199.29	2.17
E	建筑业	101,085,582.59	1.21
F	批发和零售业	63,792,992.49	0.77
G	交通运输、仓储和邮政业	184,728,841.81	2.22
H	住宿和餐饮业	3,895,950.94	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	465,002,002.47	5.58
J	金融业	804,414,309.15	9.65
K	房地产业	46,355,604.76	0.56

L	租赁和商务服务业	59,987,876.61	0.72
M	科学研究和技术服务业	99,066,366.98	1.19
N	水利、环境和公共设施管理业	14,299,103.22	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	2,770,380.00	0.03
Q	卫生和社会工作	16,174,219.24	0.19
R	文化、体育和娱乐业	6,375,071.00	0.08
S	综合	15,049,206.00	0.18
	合计	8,301,861,650.05	99.57

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	—	—
C	制造业	14,816,060.82	0.18
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	14,816,060.82	0.18

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	------	--------------

1	300308	中际旭创	279,740	355,269,800.00	4.26
2	300750	宁德时代	662,924	260,535,761.24	3.12
3	300502	新易盛	349,086	211,895,202.00	2.54
4	600519	贵州茅台	156,451	185,471,095.99	2.22
5	603986	兆易创新	167,064	136,157,160.00	1.63
6	601318	中国平安	2,671,089	127,517,788.86	1.53
7	688256	寒武纪	79,255	126,455,315.25	1.52
8	600036	招商银行	3,095,874	109,903,527.00	1.32
9	601899	紫金矿业	4,125,367	103,711,726.38	1.24
10	002371	北方华创	107,850	95,399,796.00	1.14
11	000333	美的集团	1,219,654	92,120,466.62	1.10
12	002475	立讯精密	1,278,900	90,034,560.00	1.08
13	688008	澜起科技	286,778	88,872,502.20	1.07
14	688012	中微公司	186,310	87,286,235.00	1.05
15	688041	海光信息	232,210	85,987,363.00	1.03
16	002384	东山精密	320,900	84,188,115.00	1.01
17	600900	长江电力	3,064,499	81,117,288.53	0.97
18	688981	中芯国际	509,810	80,968,024.20	0.97
19	000725	京东方A	9,106,800	79,047,024.00	0.95
20	603259	药明康德	618,740	77,039,317.40	0.92
21	600030	中信证券	2,444,388	70,227,267.24	0.84
22	601166	兴业银行	4,239,646	70,208,537.76	0.84
23	300059	东方财富	3,171,000	64,624,980.00	0.78
24	600183	生益科技	365,285	63,340,419.00	0.76
25	600276	恒瑞医药	1,118,860	58,225,474.40	0.70
26	300274	阳光电源	363,974	57,879,145.48	0.69
27	601398	工商银行	8,101,313	57,276,282.91	0.69
28	300408	三环集团	336,800	56,211,920.00	0.67
29	002594	比亚迪	681,900	54,347,430.00	0.65
30	600487	亨通光电	495,437	54,171,081.58	0.65
31	300476	胜宏科技	152,700	52,899,861.00	0.63
32	002463	沪电股份	338,070	51,657,096.00	0.62
33	601211	国泰海通	2,828,447	51,477,735.40	0.62
34	300394	天孚通信	164,320	49,736,377.60	0.60
35	688498	源杰科技	25,037	47,219,782.00	0.57
36	688525	佰维存储	94,830	46,915,245.90	0.56
37	000988	华工科技	252,111	46,542,211.71	0.56
38	301308	江波龙	63,819	44,915,812.20	0.54
39	600176	中国巨石	601,675	43,850,074.00	0.53
40	601288	农业银行	7,193,027	43,661,673.89	0.52
41	601328	交通银行	6,674,564	42,917,446.52	0.51

42	000651	格力电器	1,122,600	42,097,500.00	0.50
43	600522	中天科技	684,800	41,553,664.00	0.50
44	688072	拓荆科技	49,743	41,386,176.00	0.50
45	603019	中科曙光	367,100	39,364,133.00	0.47
46	688521	芯原股份	105,760	39,251,766.40	0.47
47	603993	洛阳钼业	2,183,000	38,311,650.00	0.46
48	600150	中国船舶	1,131,447	38,231,594.13	0.46
49	300604	长川科技	110,900	37,863,478.00	0.45
50	600887	伊利股份	1,580,190	37,861,352.40	0.45
51	600584	长电科技	358,637	37,136,861.35	0.45
52	000338	潍柴动力	1,345,800	36,673,050.00	0.44
53	000858	五 粮 液	487,400	36,067,600.00	0.43
54	688347	华虹宏力	102,496	34,469,404.80	0.41
55	601816	京沪高铁	7,344,300	33,269,679.00	0.40
56	600309	万华化学	469,766	32,136,692.06	0.39
57	688120	华海清科	99,563	32,077,207.34	0.38
58	002415	海康威视	919,200	31,436,640.00	0.38
59	300124	汇川技术	473,900	31,433,787.00	0.38
60	002916	深南电路	68,537	31,383,092.30	0.38
61	002281	光迅科技	121,000	31,089,740.00	0.37
62	002008	大族激光	205,900	30,907,649.00	0.37
63	600111	北方稀土	631,700	30,353,185.00	0.36
64	000100	TCL 科技	5,208,900	30,315,798.00	0.36
65	000063	中兴通讯	806,500	29,187,235.00	0.35
66	300857	协创数据	85,400	29,027,460.00	0.35
67	300136	信维通信	241,900	28,846,575.00	0.35
68	600000	浦发银行	3,334,430	28,709,442.30	0.34
69	600089	特变电工	1,262,077	28,396,732.50	0.34
70	601857	中国石油	3,244,303	28,160,550.04	0.34
71	002028	思源电气	156,500	27,074,500.00	0.32
72	601088	中国神华	688,700	26,886,848.00	0.32
73	300433	蓝思科技	499,800	26,819,268.00	0.32
74	600031	三一重工	1,488,375	25,719,120.00	0.31
75	300014	亿纬锂能	381,300	24,795,939.00	0.30
76	002050	三花智控	561,300	24,601,779.00	0.30
77	300475	香农芯创	81,500	24,450,000.00	0.29
78	000001	平安银行	2,429,000	24,411,450.00	0.29
79	601601	中国太保	854,767	24,377,954.84	0.29
80	300223	君正股份	96,600	24,043,740.00	0.29
81	002714	牧原股份	685,500	23,985,645.00	0.29
82	000792	盐湖股份	793,700	23,961,803.00	0.29

83	600549	厦门钨业	280,019	23,857,618.80	0.29
84	002353	杰瑞股份	154,400	23,546,000.00	0.28
85	002156	通富微电	305,200	23,155,524.00	0.28
86	600406	国电南瑞	1,004,293	22,948,095.05	0.28
87	601668	中国建筑	5,174,997	22,459,486.98	0.27
88	000657	中钨高新	228,000	21,824,160.00	0.26
89	002436	兴森科技	424,500	21,628,275.00	0.26
90	601919	中远海控	1,572,298	20,848,671.48	0.25
91	002602	世纪华通	1,475,000	20,797,500.00	0.25
92	300760	迈瑞医疗	152,400	20,700,492.00	0.25
93	601988	中国银行	3,584,970	20,506,028.40	0.25
94	600660	福耀玻璃	401,500	20,251,660.00	0.24
95	300054	鼎龙股份	191,100	20,250,867.00	0.24
96	601728	中国电信	3,888,800	20,182,872.00	0.24
97	603501	豪威集团	211,395	20,050,815.75	0.24
98	601012	隆基绿能	1,517,004	19,903,092.48	0.24
99	601225	陕西煤业	971,000	19,759,850.00	0.24
100	002230	科大讯飞	481,600	19,668,544.00	0.24
101	600941	中国移动	225,452	19,418,180.76	0.23
102	600690	海尔智家	940,800	19,201,728.00	0.23
103	002352	顺丰控股	599,600	18,743,496.00	0.22
104	688777	中控技术	158,285	18,598,487.50	0.22
105	601985	中国核电	2,055,900	18,564,777.00	0.22
106	002460	赣锋锂业	283,800	18,560,520.00	0.22
107	002709	天赐材料	357,900	18,406,797.00	0.22
108	002938	鹏鼎控股	174,400	18,378,272.00	0.22
109	603799	华友钴业	379,822	18,330,209.72	0.22
110	300033	同花顺	75,280	18,142,480.00	0.22
111	300757	罗博特科	29,300	18,136,700.00	0.22
112	000977	浪潮信息	256,900	17,983,000.00	0.22
113	600160	巨化股份	338,800	17,959,788.00	0.22
114	300442	润泽科技	204,800	17,012,736.00	0.20
115	002851	麦格米特	101,300	16,935,334.00	0.20
116	000425	徐工机械	2,052,900	16,607,961.00	0.20
117	002202	金风科技	692,600	16,553,140.00	0.20
118	000938	紫光股份	573,400	16,548,324.00	0.20
119	688126	沪硅产业	413,050	16,476,564.50	0.20
120	601600	中国铝业	1,983,900	16,307,658.00	0.20
121	600938	中国海油	599,400	16,273,710.00	0.20
122	600028	中国石化	3,647,488	16,267,796.48	0.20
123	300346	南大光电	173,980	16,119,247.00	0.19

124	600460	士兰微	293,000	16,015,380.00	0.19
125	002600	领益智造	914,300	15,853,962.00	0.19
126	002466	天齐锂业	258,300	15,838,956.00	0.19
127	601766	中国中车	3,032,270	15,767,804.00	0.19
128	600050	中国联通	3,909,399	15,637,596.00	0.19
129	300567	精测电子	49,218	15,631,636.80	0.19
130	300661	圣邦股份	108,167	15,519,801.16	0.19
131	002837	英维克	191,950	15,271,542.00	0.18
132	002080	中材科技	168,500	15,165,000.00	0.18
133	002049	紫光国微	170,600	15,140,750.00	0.18
134	002407	多氟多	299,300	15,033,839.00	0.18
135	002185	华天科技	665,300	14,842,843.00	0.18
136	002138	顺络电子	202,200	14,780,820.00	0.18
137	002179	中航光电	319,100	14,742,420.00	0.18
138	601628	中国人寿	416,702	14,730,415.70	0.18
139	688002	睿创微纳	94,018	14,543,644.42	0.17
140	601100	恒立液压	134,800	14,499,088.00	0.17
141	000568	泸州老窖	184,400	14,294,688.00	0.17
142	300395	菲利华	106,496	14,241,710.08	0.17
143	601872	招商轮船	807,200	14,182,504.00	0.17
144	600879	航天电子	658,300	14,015,207.00	0.17
145	002241	歌尔股份	620,600	13,982,118.00	0.17
146	603288	海天味业	415,343	13,772,773.88	0.17
147	601006	大秦铁路	2,986,300	13,766,843.00	0.17
148	300390	天华新能	146,300	13,680,513.00	0.16
149	000408	藏格矿业	196,800	13,642,176.00	0.16
150	601658	邮储银行	2,765,600	13,634,408.00	0.16
151	605117	德业股份	128,210	13,613,337.80	0.16
152	688017	绿的谐波	32,092	13,409,963.12	0.16
153	688469	芯联集成	1,255,374	13,319,518.14	0.16
154	600905	三峡能源	3,570,300	13,245,813.00	0.16
155	600489	中金黄金	729,300	13,163,865.00	0.16
156	002625	光启技术	431,000	13,067,920.00	0.16
157	601888	中国中免	242,843	13,043,097.53	0.16
158	688396	华润微	133,650	13,037,557.50	0.16
159	600893	航发动力	334,544	12,826,416.96	0.15
160	000630	铜陵有色	2,008,100	12,771,516.00	0.15
161	600673	东阳光	377,300	12,669,734.00	0.15
162	600010	宝钢股份	5,677,700	12,661,271.00	0.15
163	601127	赛力斯	204,712	12,538,610.00	0.15
164	688271	联影医疗	123,660	12,518,101.80	0.15

165	300058	蓝色光标	901,760	12,408,217.60	0.15
166	688111	金山办公	57,939	12,343,903.95	0.15
167	300037	新宙邦	132,901	12,339,857.85	0.15
168	002273	水晶光电	347,000	12,311,560.00	0.15
169	002027	分众传媒	2,528,100	12,236,004.00	0.15
170	601689	拓普集团	216,589	12,219,951.38	0.15
171	600118	中国卫星	148,689	12,199,932.45	0.15
172	300751	迈为股份	42,071	11,883,374.66	0.14
173	600019	宝钢股份	2,177,200	11,822,196.00	0.14
174	000426	兴业银锡	356,300	11,743,648.00	0.14
175	600760	中航沈飞	284,365	11,687,401.50	0.14
176	000807	云铝股份	519,100	11,492,874.00	0.14
177	601168	西部矿业	416,460	11,302,724.40	0.14
178	600989	宝丰能源	552,700	11,236,391.00	0.13
179	600104	上汽集团	1,150,500	11,228,880.00	0.13
180	600362	江西铜业	259,300	11,227,690.00	0.13
181	300450	先导智能	273,400	11,132,848.00	0.13
182	601727	上海电气	1,579,200	11,054,400.00	0.13
183	600988	赤峰黄金	416,600	10,964,912.00	0.13
184	002001	新 和 成	385,800	10,964,436.00	0.13
185	600875	东方电气	380,900	10,958,493.00	0.13
186	688099	晶晨股份	105,861	10,893,096.90	0.13
187	605589	圣泉集团	170,300	10,825,971.00	0.13
188	600885	宏发股份	311,700	10,750,533.00	0.13
189	002422	科伦药业	277,700	10,697,004.00	0.13
190	601390	中国中铁	2,559,800	10,674,366.00	0.13
191	600667	太极实业	364,400	10,633,192.00	0.13
192	002738	中矿资源	180,000	10,618,200.00	0.13
193	002126	银轮股份	211,400	10,527,720.00	0.13
194	000960	锡业股份	246,200	10,510,278.00	0.13
195	000538	云南白药	221,800	10,506,666.00	0.13
196	600392	盛和资源	351,700	10,470,109.00	0.13
197	600547	山东黄金	450,340	10,398,350.60	0.12
198	600795	国电电力	2,225,800	10,394,486.00	0.12
199	000831	中国稀土	186,600	10,354,434.00	0.12
200	600585	海螺水泥	601,900	10,202,205.00	0.12
201	600418	江淮汽车	393,800	10,171,854.00	0.12
202	601669	中国电建	2,158,400	10,144,480.00	0.12
203	002812	恩捷股份	148,200	9,916,062.00	0.12
204	600141	兴发集团	210,541	9,889,110.77	0.12
205	002648	卫星化学	420,900	9,886,941.00	0.12

206	300316	晶盛机电	163,300	9,863,320.00	0.12
207	600096	云天化	321,600	9,776,640.00	0.12
208	002129	TCL 中环	807,200	9,702,544.00	0.12
209	301358	湖南裕能	127,000	9,635,490.00	0.12
210	300782	卓胜微	87,900	9,632,082.00	0.12
211	300015	爱尔眼科	1,165,700	9,628,682.00	0.12
212	601179	中国西电	640,215	9,552,007.80	0.11
213	600346	恒力石化	531,900	9,419,949.00	0.11
214	600482	中国动力	285,300	9,357,840.00	0.11
215	601868	中国能建	3,485,900	9,307,353.00	0.11
216	002195	岩山科技	1,420,100	9,287,454.00	0.11
217	002558	巨人网络	335,000	9,232,600.00	0.11
218	000066	中国长城	482,800	9,197,340.00	0.11
219	600497	驰宏锌锗	757,500	9,173,325.00	0.11
220	600580	卧龙电驱	273,450	9,051,195.00	0.11
221	300418	昆仑万维	224,000	9,040,640.00	0.11
222	600066	宇通客车	334,600	8,970,626.00	0.11
223	000625	长安汽车	1,243,300	8,914,461.00	0.11
224	600426	华鲁恒升	370,173	8,854,538.16	0.11
225	600157	永泰能源	5,466,700	8,801,387.00	0.11
226	000157	中联重科	1,247,100	8,692,287.00	0.10
227	002532	天山铝业	809,600	8,687,008.00	0.10
228	600221	海航控股	6,399,900	8,639,865.00	0.10
229	600895	张江高科	230,903	8,601,136.75	0.10
230	688036	传音控股	144,796	8,535,724.20	0.10
231	300803	指南针	92,870	8,513,392.90	0.10
232	002340	格林美	1,281,100	8,468,071.00	0.10
233	600711	盛屯矿业	771,200	8,460,064.00	0.10
234	600011	华能国际	1,107,500	8,405,925.00	0.10
235	605499	东鹏饮料	68,002	8,393,486.86	0.10
236	000933	神火股份	394,800	8,369,760.00	0.10
237	600048	保利发展	1,798,396	8,326,573.48	0.10
238	600436	片仔癀	75,890	8,293,259.20	0.10
239	600143	金发科技	535,800	8,278,110.00	0.10
240	600438	通威股份	672,116	8,139,324.76	0.10
241	300017	网宿科技	624,900	8,129,949.00	0.10
242	600115	中国东航	2,130,453	8,117,025.93	0.10
243	002493	荣盛石化	753,400	8,099,050.00	0.10
244	002131	利欧股份	1,701,600	8,082,600.00	0.10
245	002236	大华股份	489,300	8,068,557.00	0.10
246	002821	凯莱英	49,520	8,022,240.00	0.10

247	600570	恒生电子	378,468	8,019,736.92	0.10
248	600886	国投电力	600,000	7,986,000.00	0.10
249	002456	欧菲光	843,300	7,977,618.00	0.10
250	600352	浙江龙盛	652,100	7,896,931.00	0.09
251	601233	桐昆股份	358,002	7,750,743.30	0.09
252	603659	璞泰来	266,500	7,709,845.00	0.09
253	300339	润和软件	199,800	7,694,298.00	0.09
254	003816	中国广核	1,967,700	7,693,707.00	0.09
255	688047	龙芯中科	49,671	7,682,613.57	0.09
256	000301	东方盛虹	662,200	7,582,190.00	0.09
257	601058	赛轮轮胎	657,200	7,577,516.00	0.09
258	601360	三六零	871,400	7,572,466.00	0.09
259	600026	中远海能	417,500	7,489,950.00	0.09
260	688213	思特威	69,767	7,469,952.69	0.09
261	300759	康龙化成	257,300	7,443,689.00	0.09
262	300438	鹏辉能源	89,500	7,415,075.00	0.09
263	002074	国轩高科	268,900	7,397,439.00	0.09
264	002555	三七互娱	390,000	7,359,300.00	0.09
265	688578	艾力斯	66,565	7,268,898.00	0.09
266	688235	百济神州	28,504	7,257,403.44	0.09
267	600196	复星医药	321,642	7,227,295.74	0.09
268	000768	中航西飞	350,500	7,178,240.00	0.09
269	600009	上海机场	310,316	7,168,299.60	0.09
270	002472	双环传动	171,500	7,118,965.00	0.09
271	000975	山金国际	416,828	7,086,076.00	0.08
272	688122	西部超导	112,662	7,076,300.22	0.08
273	601111	中国国航	1,167,900	7,065,795.00	0.08
274	300207	欣旺达	371,300	7,050,987.00	0.08
275	300001	特锐德	185,100	7,002,333.00	0.08
276	600415	小商品城	689,033	7,000,575.28	0.08
277	600029	南方航空	1,351,300	6,999,734.00	0.08
278	002517	恺英网络	428,900	6,969,625.00	0.08
279	600674	川投能源	491,500	6,964,555.00	0.08
280	300458	全志科技	175,660	6,931,543.60	0.08
281	603129	春风动力	27,000	6,906,600.00	0.08
282	002601	龙佰集团	417,900	6,886,992.00	0.08
283	600219	南山铝业	1,721,800	6,869,982.00	0.08
284	601186	中国铁建	1,148,200	6,831,790.00	0.08
285	002128	电投能源	294,600	6,811,152.00	0.08
286	002595	豪迈科技	144,629	6,739,711.40	0.08
287	601117	中国化学	914,800	6,723,780.00	0.08

288	600233	圆通速递	426,584	6,718,698.00	0.08
289	601877	正泰电器	266,300	6,676,141.00	0.08
290	301236	软通动力	157,200	6,673,140.00	0.08
291	300115	长盈精密	237,000	6,621,780.00	0.08
292	600372	中航机载	604,761	6,561,656.85	0.08
293	002155	湖南黄金	273,178	6,520,758.86	0.08
294	600839	四川长虹	925,605	6,460,722.90	0.08
295	002465	海格通信	501,300	6,401,601.00	0.08
296	300568	星源材质	338,400	6,334,848.00	0.08
297	000547	航天发展	323,200	6,189,280.00	0.07
298	300347	泰格医药	128,800	6,182,400.00	0.07
299	000963	华东医药	219,360	6,168,403.20	0.07
300	300454	深信服	63,800	6,137,560.00	0.07
301	600741	华域汽车	394,600	6,124,192.00	0.07
302	300024	机器人	314,900	6,087,017.00	0.07
303	002920	德赛西威	73,933	6,025,539.50	0.07
304	688506	百利天恒	20,457	6,014,971.71	0.07
305	002130	沃尔核材	317,200	6,014,112.00	0.07
306	603650	彤程新材	61,100	5,986,578.00	0.07
307	002497	雅化集团	291,400	5,935,818.00	0.07
308	002432	九安医疗	82,901	5,859,442.68	0.07
309	300012	华测检测	422,500	5,855,850.00	0.07
310	688676	金盘科技	68,988	5,839,144.32	0.07
311	001979	招商蛇口	905,900	5,824,937.00	0.07
312	688331	荣昌生物	44,500	5,796,570.00	0.07
313	000878	云南铜业	364,900	5,794,612.00	0.07
314	300496	中科创达	93,735	5,791,885.65	0.07
315	002271	东方雨虹	481,500	5,715,405.00	0.07
316	002414	高德红外	427,000	5,662,020.00	0.07
317	300083	创世纪	415,000	5,652,300.00	0.07
318	002444	巨星科技	180,800	5,622,880.00	0.07
319	300474	景嘉微	92,800	5,612,544.00	0.07
320	000034	神州数码	201,463	5,590,598.25	0.07
321	601021	春秋航空	122,386	5,578,353.88	0.07
322	603979	金诚信	94,500	5,578,335.00	0.07
323	000733	振华科技	98,100	5,556,384.00	0.07
324	300866	安克创新	52,800	5,517,600.00	0.07
325	601319	中国人保	802,200	5,422,872.00	0.07
326	002756	永兴材料	95,700	5,420,448.00	0.07
327	688266	泽璟制药	45,905	5,355,277.30	0.06
328	300763	锦浪科技	59,200	5,348,720.00	0.06

329	000661	长春高新	80,100	5,334,660.00	0.06
330	300748	金力永磁	172,400	5,318,540.00	0.06
331	300073	当升科技	110,100	5,289,204.00	0.06
332	600699	均胜电子	244,000	5,272,840.00	0.06
333	002078	太阳纸业	421,500	5,264,535.00	0.06
334	603606	东方电缆	126,520	5,251,845.20	0.06
335	601677	明泰铝业	316,100	5,247,260.00	0.06
336	002025	航天电器	68,700	5,236,314.00	0.06
337	300142	沃森生物	401,700	5,218,083.00	0.06
338	601615	明阳智能	449,800	5,204,186.00	0.06
339	603087	甘李药业	90,782	5,152,786.32	0.06
340	300432	富临精工	256,180	5,146,656.20	0.06
341	600039	四川路桥	655,980	5,129,763.60	0.06
342	300919	中伟新材	116,900	5,114,375.00	0.06
343	000423	东阿阿胶	112,300	5,093,928.00	0.06
344	601800	中国交建	892,100	5,093,891.00	0.06
345	000002	万 科A	1,707,600	5,054,496.00	0.06
346	002252	上海莱士	1,164,600	5,054,364.00	0.06
347	600226	亨通股份	520,164	4,988,372.76	0.06
348	688599	天合光能	349,035	4,928,374.20	0.06
349	688608	恒玄科技	29,254	4,890,976.26	0.06
350	688223	晶科能源	1,027,445	4,880,363.75	0.06
351	688169	石头科技	51,383	4,879,843.51	0.06
352	300724	捷佳伟创	69,000	4,871,400.00	0.06
353	002064	华峰化学	503,700	4,780,113.00	0.06
354	600588	用友网络	516,660	4,742,938.80	0.06
355	601633	长城汽车	314,185	4,741,051.65	0.06
356	001965	招商公路	516,400	4,730,224.00	0.06
357	000786	北新建材	255,600	4,623,804.00	0.06
358	002831	裕同科技	129,268	4,596,770.08	0.06
359	688390	固德威	42,151	4,573,805.01	0.05
360	300677	英科医疗	115,200	4,512,384.00	0.05
361	002294	信立泰	141,100	4,499,679.00	0.05
362	688180	君实生物	132,905	4,494,847.10	0.05
363	000519	中兵红箭	209,700	4,418,379.00	0.05
364	601618	中国中冶	1,803,100	4,399,564.00	0.05
365	603806	福斯特	260,393	4,371,998.47	0.05
366	600177	雅戈尔	580,144	4,368,484.32	0.05
367	603260	合盛硅业	89,781	4,332,831.06	0.05
368	600516	方大炭素	699,629	4,316,710.93	0.05
369	601607	上海医药	280,100	4,313,540.00	0.05

370	002176	江特电机	430,400	4,308,304.00	0.05
371	300972	万辰集团	24,800	4,300,568.00	0.05
372	688188	柏楚电子	40,188	4,288,059.60	0.05
373	688065	凯赛生物	89,345	4,275,158.25	0.05
374	300699	光威复材	148,700	4,260,255.00	0.05
375	000623	吉林敖东	239,800	4,251,654.00	0.05
376	302132	中航成飞	72,800	4,245,696.00	0.05
377	002085	万丰奥威	374,500	4,153,205.00	0.05
378	000617	中油资本	629,800	4,150,382.00	0.05
379	300832	新产业	97,865	4,110,330.00	0.05
380	300342	天银机电	86,700	4,074,900.00	0.05
381	300558	贝达药业	62,500	4,066,875.00	0.05
382	300251	光线传媒	365,500	4,053,395.00	0.05
383	002318	久立特材	169,500	4,051,050.00	0.05
384	600499	科达制造	293,100	4,044,780.00	0.05
385	002459	晶澳科技	497,000	4,025,700.00	0.05
386	002065	东华软件	560,900	4,004,826.00	0.05
387	605090	九丰能源	107,200	3,984,624.00	0.05
388	600085	同仁堂	172,301	3,981,876.11	0.05
389	688472	阿特斯	366,771	3,968,462.22	0.05
390	603596	伯特利	159,689	3,966,674.76	0.05
391	002266	浙富控股	781,520	3,954,491.20	0.05
392	002044	美年健康	778,800	3,917,364.00	0.05
393	600515	海南机场	1,425,600	3,906,144.00	0.05
394	300409	道氏技术	195,300	3,892,329.00	0.05
395	002223	鱼跃医疗	151,300	3,882,358.00	0.05
396	000032	深桑达A	155,141	3,870,767.95	0.05
397	300003	乐普医疗	325,801	3,860,741.85	0.05
398	002405	四维图新	594,500	3,846,415.00	0.05
399	000400	许继电气	177,200	3,845,240.00	0.05
400	301550	斯菱智驱	41,935	3,834,117.05	0.05
401	688617	惠泰医疗	21,037	3,819,477.72	0.05
402	600862	中航高科	211,000	3,804,330.00	0.05
403	688005	容百科技	123,945	3,792,717.00	0.05
404	000683	博源化工	657,000	3,784,320.00	0.05
405	000415	渤海租赁	924,900	3,764,343.00	0.05
406	000999	华润三九	166,910	3,753,805.90	0.05
407	600521	华海药业	260,249	3,747,585.60	0.04
408	601216	君正集团	839,900	3,745,954.00	0.04
409	000039	中集集团	458,400	3,717,624.00	0.04
410	600803	新奥股份	232,700	3,676,660.00	0.04

411	603766	隆鑫通用	307,700	3,670,861.00	0.04
412	600704	物产中大	776,755	3,666,283.60	0.04
413	600312	平高电气	203,800	3,599,108.00	0.04
414	600018	上港集团	755,411	3,565,539.92	0.04
415	000967	盈峰环境	335,800	3,535,974.00	0.04
416	603605	珀莱雅	58,887	3,528,509.04	0.04
417	000887	中鼎股份	196,300	3,511,807.00	0.04
418	688116	天奈科技	91,660	3,501,412.00	0.04
419	300122	智飞生物	298,814	3,493,135.66	0.04
420	600332	白云山	173,900	3,484,956.00	0.04
421	600765	中航重机	268,341	3,466,965.72	0.04
422	600153	建发股份	435,440	3,453,039.20	0.04
423	600323	瀚蓝环境	125,200	3,437,992.00	0.04
424	600166	福田汽车	1,179,100	3,431,181.00	0.04
425	000830	鲁西化工	282,400	3,388,800.00	0.04
426	002410	广联达	410,800	3,352,128.00	0.04
427	002007	华兰生物	269,490	3,285,083.10	0.04
428	300896	爱美客	37,420	3,263,024.00	0.04
429	601799	星宇股份	35,400	3,207,948.00	0.04
430	600398	海澜之家	606,700	3,173,041.00	0.04
431	688114	华大智造	61,912	3,162,464.96	0.04
432	603568	伟明环保	205,079	3,154,115.02	0.04
433	002603	以岭药业	208,200	3,123,000.00	0.04
434	000738	航发控制	168,700	3,085,523.00	0.04
435	688009	中国通号	647,943	3,084,208.68	0.04
436	600316	洪都航空	110,207	3,079,183.58	0.04
437	601018	宁波港	976,500	3,075,975.00	0.04
438	002389	航天彩虹	172,100	3,058,217.00	0.04
439	601000	唐山港	735,680	3,053,072.00	0.04
440	600008	首创环保	1,110,800	3,021,376.00	0.04
441	600486	扬农化工	59,300	3,006,510.00	0.04
442	600529	山东药玻	162,800	3,003,660.00	0.04
443	600208	衢州发展	1,058,500	2,995,555.00	0.04
444	600998	九州通	634,986	2,978,084.34	0.04
445	600170	上海建工	1,335,673	2,965,194.06	0.04
446	000932	华菱钢铁	853,100	2,960,257.00	0.04
447	600161	天坛生物	248,924	2,882,539.92	0.03
448	300118	东方日升	230,700	2,872,215.00	0.03
449	600820	隧道股份	547,400	2,851,954.00	0.03
450	603486	科沃斯	56,000	2,842,000.00	0.03
451	603885	吉祥航空	272,400	2,802,996.00	0.03

452	688303	大全能源	160,760	2,802,046.80	0.03
453	601238	广汽集团	551,275	2,800,477.00	0.03
454	603816	顾家家居	125,000	2,795,000.00	0.03
455	002607	中公教育	1,539,100	2,770,380.00	0.03
456	603939	益丰药房	153,231	2,755,093.38	0.03
457	600038	中直股份	105,400	2,665,566.00	0.03
458	688166	博瑞医药	75,574	2,645,845.74	0.03
459	600763	通策医疗	77,573	2,628,173.24	0.03
460	601567	三星电气	174,600	2,608,524.00	0.03
461	603392	万泰生物	95,876	2,585,775.72	0.03
462	601880	辽港股份	1,852,100	2,555,898.00	0.03
463	300676	华大基因	72,593	2,545,110.58	0.03
464	300049	福瑞医科	65,400	2,542,752.00	0.03
465	300573	兴齐眼药	61,954	2,525,245.04	0.03
466	600511	国药股份	96,700	2,518,068.00	0.03
467	600535	天士力	185,080	2,448,608.40	0.03
468	300100	双林股份	87,200	2,422,416.00	0.03
469	600816	建元信托	977,300	2,384,612.00	0.03
470	002244	滨江集团	313,400	2,381,840.00	0.03
471	000833	粤桂股份	101,600	2,379,472.00	0.03
472	300144	宋城演艺	399,600	2,321,676.00	0.03
473	601155	新城控股	225,000	2,308,500.00	0.03
474	002120	韵达股份	362,600	2,306,136.00	0.03
475	000998	隆平高科	299,200	2,255,968.00	0.03
476	688063	派能科技	41,809	2,227,165.43	0.03
477	002544	普天科技	119,700	2,180,934.00	0.03
478	601866	中远海发	980,800	2,167,568.00	0.03
479	600064	南京高科	303,500	2,163,955.00	0.03
480	600754	锦江酒店	118,106	2,124,726.94	0.03
481	600635	大众公用	485,100	2,076,228.00	0.02
482	300457	赢合科技	96,400	2,032,112.00	0.02
483	000035	中国天楹	417,100	2,014,593.00	0.02
484	600655	豫园股份	477,452	1,962,327.72	0.02
485	603899	晨光股份	93,300	1,924,779.00	0.02
486	600004	白云机场	259,300	1,882,518.00	0.02
487	300601	康泰生物	165,600	1,877,904.00	0.02
488	600663	陆家嘴	295,400	1,855,112.00	0.02
489	600859	王府井	197,300	1,811,214.00	0.02
490	002091	江苏国泰	246,400	1,781,472.00	0.02
491	600258	首旅酒店	162,200	1,771,224.00	0.02
492	300070	碧水源	544,800	1,737,912.00	0.02

493	000069	华侨城 A	1,005,300	1,648,692.00	0.02
494	600864	哈投股份	311,297	1,615,631.43	0.02
495	301078	孩子王	221,500	1,497,340.00	0.02
496	002292	奥飞娱乐	218,100	1,430,736.00	0.02
497	603833	欧派家居	45,540	1,371,209.40	0.02
498	600325	华发股份	557,863	1,288,663.53	0.02
499	002891	中宠股份	46,600	1,245,152.00	0.01
500	002572	索菲亚	136,800	998,640.00	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	688795	摩尔线程	10,828	7,329,906.32	0.09
2	688802	沐曦股份	3,994	3,070,946.66	0.04
3	688783	西安奕材	44,370	2,547,725.40	0.03
4	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.00
5	688790	昂瑞微	2,319	293,237.55	0.00
6	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.00
7	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.00
8	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.00
9	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.00
10	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.00
11	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
12	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
13	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
14	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
15	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
16	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
17	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
18	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
19	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
20	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
21	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
22	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
23	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
24	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
25	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
26	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
27	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
28	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00

29	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
30	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
31	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	197,300,396.50	1.38
2	300750	宁德时代	149,542,238.25	1.05
3	002371	北方华创	105,070,671.60	0.74
4	300502	新易盛	67,960,404.54	0.48
5	600519	贵州茅台	65,444,094.81	0.46
6	300394	天孚通信	62,173,000.92	0.44
7	688041	海光信息	48,804,586.72	0.34
8	002594	比亚迪	48,763,688.85	0.34
9	000333	美的集团	48,212,016.85	0.34
10	002475	立讯精密	47,677,094.00	0.33
11	300476	胜宏科技	44,839,671.21	0.31
12	002384	东山精密	40,340,227.00	0.28
13	000858	五粮液	39,495,383.12	0.28
14	688498	源杰科技	36,697,551.20	0.26
15	300274	阳光电源	35,477,464.34	0.25
16	300059	东方财富	34,067,779.35	0.24
17	301308	江波龙	33,970,935.00	0.24
18	688525	佰维存储	32,123,731.58	0.23
19	300604	长川科技	31,500,786.92	0.22
20	300124	汇川技术	29,710,949.50	0.21

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	396,223,581.74	2.78
2	300308	中际旭创	377,768,159.23	2.65
3	300502	新易盛	176,623,408.84	1.24
4	002371	北方华创	157,657,980.23	1.11
5	000333	美的集团	144,277,822.94	1.01
6	002475	立讯精密	119,362,866.34	0.84
7	002594	比亚迪	113,073,789.27	0.79

8	300059	东方财富	101,539,984.14	0.71
9	300394	天孚通信	94,333,335.60	0.66
10	300274	阳光电源	89,227,123.86	0.63
11	300476	胜宏科技	88,662,202.62	0.62
12	000858	五粮液	88,007,022.97	0.62
13	688256	寒武纪	87,766,330.75	0.62
14	002384	东山精密	75,007,902.32	0.53
15	000651	格力电器	67,838,962.85	0.48
16	300124	汇川技术	63,478,108.35	0.45
17	000725	京东方A	63,451,595.00	0.45
18	002028	思源电气	58,044,868.90	0.41
19	000338	潍柴动力	53,595,361.61	0.38
20	300760	迈瑞医疗	51,901,876.00	0.36

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,396,635,004.97
卖出股票收入（成交）总额	6,672,869,084.87

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）	507,006.67	0.01
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	507,006.67	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	111025	圣泉转债	5,070	507,006.67	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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

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

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

7.12.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,668,897.60
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	1,668,897.60

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	688795	摩尔线程	7,329,906.32	0.09	新股限售
2	688802	沐曦股份	3,070,946.66	0.04	新股限售
3	688783	西安奕材	2,547,725.40	0.03	新股限售
4	688820	盛合晶微	338,302.59	0.00	新股限售

5	688790	昂瑞微	293,237.55	0.00	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 A500 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 (%)
9,448	631,140.31	5,503,650, 209.00	92.30	459,363,47 8.00	7.70	1,527,992, 730.00	25.62

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 A500 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（2024 年 09 月 25 日）基金份额总额	2,000,013,687.00
本报告期期初基金份额总额	11,498,013,687.00
本报告期基金总申购份额	3,039,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	8,574,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	5,963,013,687.00

§ 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，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，无涉及公募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，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，托管人分管公募基金托管业务的高级管理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（%）	
中泰证券	7	10,067,349,676.54	100.00	1,368,151.06	100.00	—

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

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例（%）	成交金额	占当期权证成交总额的比例（%）
中泰证券	—	—	—	—	—	—

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2026年01月09日
2	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2026年02月04日
3	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承	规定披露媒介	2026年03月19日

	销期内承销证券的公告		
4	关于富国基金管理有限公司旗下部分上交所上市基金场内扩位简称变更的公告	规定披露媒介	2026 年 03 月 20 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 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2026-03-10 至 2026-03-22;2026-03-30 至 2026-04-23	1,383,695,870.00	293,656,200.00	575,014,380.00	1,102,337,690.00	18.49%
富国中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1	2026-02-12 至 2026-06-30	1,827,242,730.00	147,000,000.00	446,250,000.00	1,527,992,730.00	25.62%
产品特有风险							
本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

一、本报告期内，经向上海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扩位简称由“中证 A500ETF 富国”变更为“A500ETF 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上交所上市基金场内扩位简称变更的公告》。 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 A500 交易型开放式指数证券投资基金的文件 2、富国中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同 3、富国中证 A500 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 A500 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 。