富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)

二0二六年中期报告

2026年06月30日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2026年08月31日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)			
基金简称	富国中证 500 指数增强（LOF）			
场内简称	500 增强 LOF			
基金主代码	161017			
基金运作方式	契约型开放式			
基金合同生效日	2011 年 10 月 12 日			
基金管理人	富国基金管理有限公司			
基金托管人	中国农业银行股份有限公司			
报告期末基金份额总额	1,397,542,266.83 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	2011 年 10 月 21 日			
下属分级基金的基金简称	富国中证 500 指数增强（LOF）A/B		富国中证 500 指数增强（LOF）C	富国中证 500 指数增强（LOF）Y
下属分级基金场内简称	500 增强 LOF		—	—
下属分级基金的交易代码	前端	后端	013332	022953
	161017	161021		
报告期末下属分级基金的份额总额	1,286,296,396.90 份		93,864,866.98 份	17,381,002.95 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金以“指数化投资为主、主动性投资为辅”，主要策略为复制目标指数，即投资组合将以成份股在目标指数中的基准权重为基础，利用富国定量投资模型在有限范围内进行超配或低配选择。本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。本基金的标的指数、对目标指数的跟踪调整、存托凭证投资策略、债券投资策略、金融衍生工具投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	95%×中证 500 指数收益率＋1%(指年收益率，评价时按期间折算)。
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富国基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	任航
	联系电话	021-20361818	010-66060069
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	tgxxpl@abchina.com

客户服务电话	95105686、4008880688	95599
传真	021-20361616	010-68121816
注册地址	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	200120	100031
法定代表人	陈戈	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金中期报告置备地点	富国基金管理有限公司　上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层 中国农业银行股份有限公司　北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	A 类：中国证券登记结算有限责任公司；C 类、Y 类：富国基金管理有限公司	北京市西城区太平桥大街 17 号；上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

（1） 富国中证 500 指数增强（LOF）A/B

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	700,334,936.82
本期利润	689,083,696.69
加权平均基金份额本期利润	0.4518
本期加权平均净值利润率	16.57%
本期基金份额净值增长率	17.26%
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	2,489,316,456.61
期末可供分配基金份额利润	1.9353
期末基金资产净值	3,775,612,853.51
期末基金份额净值	2.935
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	316.63%

（2） 富国中证 500 指数增强（LOF）C

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	56,632,594.58
本期利润	59,355,332.24
加权平均基金份额本期利润	0.5209
本期加权平均净值利润率	19.29%
本期基金份额净值增长率	17.17%
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	178,955,985.23
期末可供分配基金份额利润	1.9065
期末基金资产净值	272,820,852.21
期末基金份额净值	2.907
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	31.42%

（3） 富国中证 500 指数增强（LOF）Y

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	6,233,289.89
本期利润	5,918,177.04
加权平均基金份额本期利润	0.3786
本期加权平均净值利润率	13.74%
本期基金份额净值增长率	17.59%
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	34,088,082.70
期末可供分配基金份额利润	1.9612
期末基金资产净值	51,469,085.65
期末基金份额净值	2.961
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	48.57%

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

（1） 富国中证 500 指数增强（LOF）A/B

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	15.32%	1.55%	17.90%	1.57%	-2.58%	-0.02%
过去六个月	17.26%	1.54%	20.51%	1.58%	-3.25%	-0.04%
过去一年	45.44%	1.31%	51.16%	1.35%	-5.72%	-0.04%
过去三年	47.95%	1.33%	52.57%	1.41%	-4.62%	-0.08%
过去五年	37.12%	1.23%	38.24%	1.30%	-1.12%	-0.07%
过去七年	116.40%	1.25%	91.30%	1.29%	25.10%	-0.04%
过去十年	121.73%	1.25%	61.56%	1.28%	60.17%	-0.03%
自基金合同生效起至今	316.63%	1.45%	168.10%	1.48%	148.53%	-0.03%

（2） 富国中证 500 指数增强（LOF）C

阶段	份额净值增	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基准收	①－③	②－④

	长率①	长率标准差②	准收益率③	益率标准差④		
过去三个月	15.27%	1.55%	17.90%	1.57%	-2.63%	-0.02%
过去六个月	17.17%	1.54%	20.51%	1.58%	-3.34%	-0.04%
过去一年	45.20%	1.31%	51.16%	1.35%	-5.96%	-0.04%
过去三年	47.12%	1.33%	52.57%	1.41%	-5.45%	-0.08%
自基金分级生效日起至今	31.42%	1.24%	35.41%	1.30%	-3.99%	-0.06%

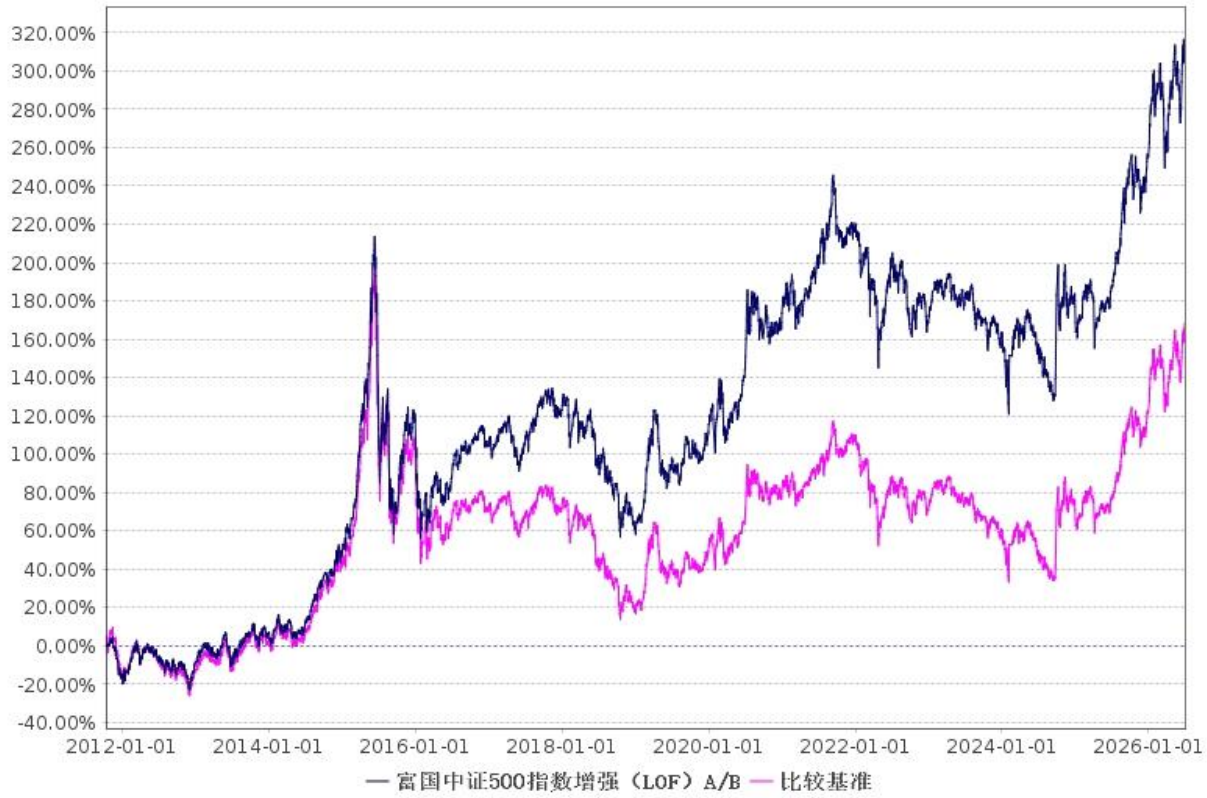
（3） 富国中证 500 指数增强（LOF）Y

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	15.48%	1.55%	17.90%	1.57%	-2.42%	-0.02%
过去六个月	17.59%	1.54%	20.51%	1.58%	-2.92%	-0.04%
过去一年	46.29%	1.31%	51.16%	1.35%	-4.87%	-0.04%
自基金分级生效日起至今	48.57%	1.26%	50.30%	1.33%	-1.73%	-0.07%

注：本基金业绩比较基准根据基金合同中投资策略及资产配置比例等相关规定构建，能够较好地反映本基金的风险收益特征。本基金每个交易日对业绩比较基准依据合同约定的权重比例进行再平衡处理，并用每日连乘方式计算得到指数基准的时间序列。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

（1）富国中证 500 指数增强（LOF）A/B



注：1、截止日期为 2026 年 6 月 30 日。

（2）富国中证 500 指数增强（LOF）C



注：1、截止日期为 2026 年 6 月 30 日。

2、本基金自 2021 年 8 月 19 日起增加 C 类份额，相关数据按实际存续期计算。

（3）富国中证 500 指数增强（LOF）Y



注：1、截止日期为 2026 年 6 月 30 日。

2、本基金自 2024 年 12 月 13 日起增加 Y 类份额，相关数据按实际存续期计算。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李笑薇	本基金现任基金经理	2011-10-12	-	24	博士，曾任摩根士丹利资本国际 Barra 公司（MSCIBARRA)高级研究员，巴克莱国际投资管理公司(BarclaysGlobal Investors)大中华主动股票投资总监、高级基金经理及高级研究员；自 2009 年 6 月加入富国基金管理有限公司，历任量化与海外投资部总经理、基金经

					理、公司总经理助理；现任富国基金副总经理，兼任富国基金资深定量基金经理。自 2009 年 12 月起任富国沪深 300 增强证券投资基金基金经理；自 2011 年 10 月起任富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理；具有基金从业资格。
方旻	本基金现任基金经理	2014-11-19	—	16	硕士，自 2010 年 2 月加入富国基金管理有限公司，历任定量研究员、基金经理助理、基金经理、量化与海外投资部量化投资总监助理、高级定量基金经理、量化投资部量化投资副总监、量化投资部量化投资总监；现任富国基金量化投资部量化投资总监兼资深定量基金经理。自 2014 年 11 月起任富国沪深 300 增强证券投资基金基金经理；自 2014 年 11 月起任富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理；自 2014 年 11 月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金基金经理；自 2014 年 11 月起任上证综指交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2015 年 10 月起任富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；自 2018 年 05 月起任富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理；自 2019 年 01 月起任富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金基金经理；自 2020 年 02 月起任富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金基金经理；自 2025 年 04 月起任富国致盛量化选股股票型证券投资基金基金经理；自 2025 年 05 月起任富国上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金基金经理；自 2025 年 06 月起任富国致享量化选股股票型证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。
汤杰强	本基金现任基金经理	2025-08-11	—	6	硕士，自 2020 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 2025 年 08 月起任富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理；自 2025

					年 09 月起任富国中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2025 年 09 月起任富国中证国企一带一路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 09 月起任富国中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2025 年 09 月起任富国中证央企创新驱动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遵规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险、力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定收益为目标，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。

在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本基金与公司管理的其他投资组合之间，出现 30 次同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况，为投资组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平对待投资组合或利益输送等情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年伊始，国内经济数据回暖、人民币升值等因素助推 A 股快速上行，随后融资保证金上调降温市场，叠加海外关税、美伊地缘反复扰动情绪。进入 2 月，美联储新任主席提名强化紧缩预期，全球迎来鹰派交易。3 月起，美伊冲突主导市场，月初冲突推高油价打压风险偏好；中旬局势僵持加剧滞胀忧虑；下旬美方释放缓和信号，悲观情绪有所修复。4 月地缘扰动降温、流动性预期改善，A 股科技成长维持强势并向低拥挤赛道扩散。海外半导体行情向好，AI 算力需求持续验证；国内资金聚焦产业主线，行情向国产算力、半导体、AIDC 基建延伸。5 月中旬多重催化消退，叠加美国通胀走高、加息预期升温，美债利率上行带来海外流动性压力，市场见顶回落。资金进一步聚焦 AI 硬件，电子、通信虹吸其他板块。6 月市场维持震荡分化，指数依靠少数赛道保持韧性，但个股中位数持续走弱，多数标的承受调整压力。

总体来看，2026 年上半年上证综指上涨 3.16%，沪深 300 上涨 7.55%，中证 500 指数上涨 20.97%，创业板指上涨 35.58%，科创综指上涨 53.99%。

在投资管理上，我们坚持采取量化策略进行投资和风险管理，积极获取超额收益率。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 6 月 30 日，本基金份额净值富国中证 500 指数增强（LOF）A/B 为 2.935 元，富国中证 500 指数增强（LOF）C 为 2.907 元，富国中证 500 指数增强（LOF）Y 为 2.961 元；份额累计净值富国中证 500 指数增强（LOF）A/B 为 3.541 元，富国中证 500 指数增强（LOF）C 为 3.144 元，富国中证 500 指数增强（LOF）Y 为 2.961 元；本报告期，本基金份额净值增长率情况:富国中证 500 指数增强(LOF)A/B 为 17.26%,富国中证 500 指数增强(LOF)C 为 17.17%，富国中证 500 指数增强（LOF）Y 为 17.59%；同期业绩比较基准收益率情况：富国中证 500 指数增强（LOF）A/B 为 20.51%，富国中证 500 指数增强（LOF）C 为 20.51%，富国中证 500 指数增强（LOF）Y 为 20.51%。

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遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 半年度财务报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)

报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

资产	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
资产：		
货币资金	234,983,005.31	277,005,003.47
结算备付金	13,055,813.14	20,738,660.96
存出保证金	1,023,875.81	1,635,332.08
交易性金融资产	3,873,948,964.84	4,781,168,203.18
其中：股票投资	3,873,463,945.67	4,760,819,928.96
基金投资	-	-
债券投资	485,019.17	20,348,274.22
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	111,307.00	96,439.53
应收股利	-	-
应收申购款	4,831,088.29	2,652,789.88
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	4,127,954,054.39	5,083,296,429.10
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	25,557.25	35,353.92
应付赎回款	21,560,588.94	22,448,578.93
应付管理人报酬	3,281,631.91	4,228,807.40
应付托管费	492,244.78	634,321.09
应付销售服务费	42,235.54	86,396.03
应付投资顾问费	-	-
应交税费	36.76	1.16

应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	2,648,967.84	2,599,108.36
负债合计	28,051,263.02	30,032,566.89
净资产：		
实收基金	1,397,542,266.83	2,019,937,735.80
未分配利润	2,702,360,524.54	3,033,326,126.41
净资产合计	4,099,902,791.37	5,053,263,862.21
负债和净资产总计	4,127,954,054.39	5,083,296,429.10

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.934 元，基金份额总额 1,397,542,266.83 份。其中：富国中证 500 指数增强（LOF）A/B 份额净值 2.935 元，份额总额 1,286,296,396.90 份；富国中证 500 指数增强（LOF）C 份额净值 2.907 元，份额总额 93,864,866.98 份；富国中证 500 指数增强（LOF）Y 份额净值 2.961 元，份额总额 17,381,002.95 份。

6.2 利润表

会计主体：富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)

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

单位：人民币元

项目	本期 （2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）	上年度可比期间 （2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）
一、营业总收入	780,372,775.33	269,292,685.58
1.利息收入	553,039.93	950,472.99
其中：存款利息收入	553,039.93	950,472.99
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）	785,995,032.03	183,688,702.77
其中：股票投资收益	758,742,610.27	110,911,592.82
基金投资收益	-	-
债券投资收益	847,434.74	456,376.74
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	26,404,987.02	72,320,733.21
其他投资收益	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-8,843,615.32	82,162,821.52
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	2,668,318.69	2,490,688.30

减：二、营业总支出	26,015,569.36	37,390,470.18
1．管理人报酬	22,262,849.04	31,355,944.61
2．托管费	3,339,427.24	4,703,391.70
3．销售服务费	304,896.36	976,977.04
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	65.99	0.73
8．其他费用	108,330.73	354,156.10
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	754,357,205.97	231,902,215.40
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	754,357,205.97	231,902,215.40
五、其他综合收益的税后净额	-	-
六、综合收益总额	754,357,205.97	231,902,215.40

6.3 净资产变动表

会计主体：富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 （2026年01月01日至2026年06月30日）		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,019,937,735.80	3,033,326,126.41	5,053,263,862.21
二、本期期初净资产	2,019,937,735.80	3,033,326,126.41	5,053,263,862.21
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-622,395,468.97	-330,965,601.87	-953,361,070.84
（一）、综合收益总额	-	754,357,205.97	754,357,205.97
（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）	-622,395,468.97	-1,085,322,807.84	-1,707,718,276.81
其中：1.基金申购款	322,541,187.55	556,199,597.92	878,740,785.47
2.基金赎回款	-944,936,656.52	-1,641,522,405.76	-2,586,459,062.28
（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	1,397,542,266.83	2,702,360,524.54	4,099,902,791.37
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	3,753,435,355.51	3,565,617,386.47	7,319,052,741.98
二、本期期初净资产	3,753,435,355.51	3,565,617,386.47	7,319,052,741.98

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-904,278,616.64	-672,569,663.70	-1,576,848,280.34
（一）、综合收益总额	-	231,902,215.40	231,902,215.40
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-904,278,616.64	-904,471,879.10	-1,808,750,495.74
其中：1.基金申购款	295,185,609.35	282,674,266.17	577,859,875.52
2.基金赎回款	-1,199,464,225.99	-1,187,146,145.27	-2,386,610,371.26
（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	2,849,156,738.87	2,893,047,722.77	5,742,204,461.64

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 500 指数增强型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2011]1095 号《关于核准富国中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）募集的批复》的核准，由基金管理人富国基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2011 年 10 月 12 日正式生效，首次设立募集规模为 455,487,249.88 份基金份额。本基金为契约型上市开放式，存续期限不定。根据基金管理人于 2021 年 8 月 17 日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下部分基金增加 C 类基金份额并相应修订基金合同及托管协议的公告》，自 2021 年 8 月 19 日起，本基金增加 C 类份额。根据基金管理人于 2024 年 12 月 12 日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下部分基金增加 Y 类基金份额并修改基金合同及托管协议的公告》，自 2024 年 12 月 13 日起，本基金增加 Y 类份额。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，A 类基金份额的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，C 类、Y 类基金份额的注册登记机构为富国基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券、权证以及中国证监会

允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。其中，股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产的 90%，投资于中证 500 指数成份股和备选成份股的资产（均含存托凭证）不低于股票资产的 80%；保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或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。

本基金业绩比较基准为 95%×中证 500 指数收益率＋1%(指年收益率,评价时按期间折算)。

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	234,983,005.31
等于：本金	234,959,257.19
加：应计利息	23,748.12
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-

其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	234,983,005.31

注：本基金本报告期末未持有定期存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末（2026 年 06 月 30 日）			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		3,689,771,117.16	-	3,873,463,945.67	183,692,828.51
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	485,000.00	19.17	485,019.17	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	485,000.00	19.17	485,019.17	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		3,690,256,117.16	19.17	3,873,948,964.84	183,692,828.51

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易。

6.4.7.5 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2026 年 06 月 30 日）
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	69,342.49
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,421,872.57
其中：交易所市场	2,421,872.57
银行间市场	-
应付利息	-
预提信息披露费	60,000.00
预提审计费	97,752.78
合计	2,648,967.84

6.4.7.7 实收基金

富国中证 500 指数增强（LOF）A/B

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	1,845,591,098.29	1,845,591,098.29
本期申购	201,162,621.02	201,162,621.02
本期赎回（以“-”号填列）	-760,457,322.41	-760,457,322.41
本期末	1,286,296,396.90	1,286,296,396.90

富国中证 500 指数增强（LOF）C

金额单位：人民币元

项目	本期（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	166,361,168.45	166,361,168.45
本期申购	106,513,957.01	106,513,957.01
本期赎回（以“-”号填列）	-179,010,258.48	-179,010,258.48
本期末	93,864,866.98	93,864,866.98

富国中证 500 指数增强（LOF）Y

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	7,985,469.06	7,985,469.06
本期申购	14,864,609.52	14,864,609.52
本期赎回（以“-”号填列）	-5,469,075.63	-5,469,075.63
本期末	17,381,002.95	17,381,002.95

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

富国中证 500 指数增强（LOF）A/B

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	2,964,920,499.77	-190,155,007.26	2,774,765,492.51
本期期初	2,964,920,499.77	-190,155,007.26	2,774,765,492.51
本期利润	700,334,936.82	-11,251,240.13	689,083,696.69
本期基金份额交易产生的变动数	-1,032,580,392.07	58,047,659.48	-974,532,732.59
其中：基金申购款	378,063,088.20	-30,859,524.60	347,203,563.60
基金赎回款	-1,410,643,480.27	88,907,184.08	-1,321,736,296.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,632,675,044.52	-143,358,587.91	2,489,316,456.61

富国中证 500 指数增强（LOF）C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	263,668,652.29	-17,232,588.48	246,436,063.81
本期期初	263,668,652.29	-17,232,588.48	246,436,063.81
本期利润	56,632,594.58	2,722,737.66	59,355,332.24
本期基金份额交易产生的变动数	-130,833,700.14	3,998,289.32	-126,835,410.82
其中：基金申购款	190,531,733.50	-7,365,181.46	183,166,552.04
基金赎回款	-321,365,433.64	11,363,470.78	-310,001,962.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	189,467,546.73	-10,511,561.50	178,955,985.23

富国中证 500 指数增强（LOF）Y

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	12,946,377.47	-821,807.38	12,124,570.09
本期期初	12,946,377.47	-821,807.38	12,124,570.09
本期利润	6,233,289.89	-315,112.85	5,918,177.04
本期基金份额交易产生的变动数	16,841,550.04	-796,214.47	16,045,335.57
其中：基金申购款	27,494,712.23	-1,665,229.95	25,829,482.28
基金赎回款	-10,653,162.19	869,015.48	-9,784,146.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	36,021,217.40	-1,933,134.70	34,088,082.70

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	505,379.74
定期存款利息收入	-

其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	35,954.75
其他	11,705.44
合计	553,039.93

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）
卖出股票成交总额	18,033,415,807.35
减：卖出股票成本总额	17,258,773,835.54
减：交易费用	15,899,361.54
买卖股票差价收入	758,742,610.27

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	26,868.14
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	820,566.60
合计	847,434.74

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	53,496,818.21
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	52,268,521.00
减：应计利息总额	407,659.89
减：交易费用	70.72
买卖债券差价收入	820,566.60

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.13 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无买卖贵金属交易。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）
股票投资产生的股利收益	26,404,987.02
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	26,404,987.02

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	-8,843,615.32
股票投资	-8,586,879.42
债券投资	-256,735.90
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2.衍生工具	-
权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-8,843,615.32

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	2,659,408.70
基金转换费收入	8,909.99

合计	2,668,318.69

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	29,752.78
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	-
银行费用	17,297.25
其他	1,280.70
合计	108,330.73

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大影响关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构(2025 年 3 月 14 日前)
国泰海通证券股份有限公司（“国泰海通”）	基金管理人的股东、基金代销机构（自 2025 年 3 月 14 日起）
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东、基金代销机构
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	基金托管人、基金代销机构
海通期货股份有限公司	基金管理人的股东控制的子公司、基金代销机构

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

（2）以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）		上年度可比期间（2025年01月01日至2025年06月30日）	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
国泰海通	8,317,047,473.09	24.17	3,809,878,333.55	11.19
海通证券	-	-	598,278,858.76	1.76
申万宏源	448,534,106.81	1.30	1,434,423,692.46	4.21

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

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	1,130,312.43	24.17	648,762.05	26.79
申万宏源	60,972.26	1.30	47,177.83	1.95
关联方名称	上年度可比期间（2025年01月01日至2025年06月30日）			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
国泰海通	517,873.86	11.19	517,873.86	29.66

海通证券	81,308.45	1.76	-	-
申万宏源	194,950.87	4.21	1.67	0.00

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。

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	22,262,849.04	31,355,944.61
其中：应支付销售机构的客户维护费	8,660,417.27	10,123,967.24
应支付基金管理人的净管理费	13,602,431.77	21,231,977.37

注：本基金 A 类和 C 类基金份额的管理费按前一日该类基金份额基金资产净值的 1.00%年费率计提，本基金 Y 类基金份额的管理费按前一日 Y 类基金份额基金资产净值的 0.50%的年费率计提。

管理费的计算方法如下：

H＝E×该类基金份额的管理费年费率÷当年天数

H 为该类基金份额每日应计提的基金管理费

E 为前一日的该类基金资产净值

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	3,339,427.24	4,703,391.70

注：本基金 A 类和 C 类基金份额的托管费按前一日该类基金份额基金资产净值的 0.15%的年费率计提，本基金 Y 类基金份额的托管费按前一日 Y 类基金份额基金资产净值的 0.075%的年费率计提。

托管费的计算方法如下：H＝E×该类基金份额的托管费年费率÷当年天数

H 为该类基金份额每日应计提的基金托管费

E 为前一日的该类基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	富国中证 500 指数增强（LOF）A/B	富国中证 500 指数增强（LOF）C	富国中证 500 指数增强（LOF）Y	合计
富国基金管理有限公司	-	206,925.50	-	206,925.50
国泰海通证券股份有限公司	-	108.88	-	108.88
海通期货股份有限公司	-	4.75	-	4.75
申万宏源证券有限公司	-	163.55	-	163.55
合计	-	207,202.68	-	207,202.68

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	富国中证 500 指数增强（LOF）A/B	富国中证 500 指数增强（LOF）C	富国中证 500 指数增强（LOF）Y	合计
富国基金管理有限公司	-	739,573.81	-	739,573.81
国泰海通证券股份有限公司	-	80.37	-	80.37
海通证券股份有限公司	-	16.44	-	16.44
申万宏源证券有限公司	-	326.37	-	326.37
合计	-	739,996.99	-	739,996.99

注：本基金 A 类和 Y 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费将专门用于本基金 C 类基金份额的销售与基金份额持有人服务。

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

H＝E×0.20%÷当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）			上年度可比期间（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）		
	富国中证 500 指数增强(LOF) A/B	富国中证 500 指数增强（LOF）C	富国中证 500 指数增强（LOF）Y	富国中证 500 指数增强（LOF）A/B	富国中证 500 指数增强（LOF）C	富国中证 500 指数增强（LOF）Y
报告期初持有的基金份额	12,657,866.18	-	-	12,657,866.18	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-	-	-	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	12,657,866.18	-	-	-	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-	-	12,657,866.18	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	-	0.53%	-	-

注：本基金管理人投资本基金按照公告的费率条款执行，不存在费率优惠的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）		上年度可比期间（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	234,983,005.31	505,379.74	310,260,765.80	896,580.86

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期未进行利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001220	世盟股份	2026-01-27	6 个月	新股限售	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	2026-05-15	6 个月	新股限售	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
001248	华润新能源	2026-06-24	6 个月	新股限售	10.11	10.11	58,873	595,206.03	595,206.03	-
001248	华润新能源	2026-06-24	1 个月内（含）	新股认购	10.11	10.11	25,231	255,085.41	255,085.41	-
001257	盛龙股份	2026-03-24	6 个月	新股限售	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312	福恩股份	2026-04-14	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-	6 个月	新股限售	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-

		08								
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	—
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	—
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	—
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	—
688783	西安奕材	2025-10-20	9 个月	新股限售	8.62	57.42	44,370	382,469.40	2,547,725.40	—
688785	恒运昌	2026-01-20	6 个月	新股限售	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	—
688790	昂瑞微	2025-12-09	9 个月	新股限售	83.06	126.45	2,319	192,616.14	293,237.55	—
688795	摩尔线程	2025-11-26	9 个月	新股限售	114.28	676.94	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	-
688816	易思维	2026-02-04	6 个月	新股限售	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
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	720	72,000.00	72,000.95	-
113704	春风转债	2026-06-10	1 个月内（含）	认购新发证券	100.00	100.00	3,710	371,000.00	371,017.08	-
118071	华峰转债	2026-06-23	1 个月内（含）	认购新发证券	100.00	100.00	110	11,000.00	11,000.19	-
118072	鼎通转债	2026-06-24	1 个月内（含）	认购新发证券	100.00	100.00	310	31,000.00	31,000.95	-

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	7,378.00	3,926,115.14	6,138,496.00	-

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%。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	485,019.17	934,096.90
未评级	-	-
合计	485,019.17	934,096.90

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

6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末（2026 年 06 月 30 日）	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	234,983,005.31	—	—	—	234,983,005.31
结算备付金	13,055,813.14	—	—	—	13,055,813.14
存出保证金	1,023,875.81	—	—	—	1,023,875.81
交易性金融资产	485,019.17	—	—	3,873,463,945.67	3,873,948,964.84
应收清算款	—	—	—	111,307.00	111,307.00
应收申购款	—	—	—	4,831,088.29	4,831,088.29
资产总计	249,547,713.43	—	—	3,878,406,340.96	4,127,954,054.39
负债					
应付清算款	—	—	—	25,557.25	25,557.25
应付赎回款	—	—	—	21,560,588.94	21,560,588.94
应付管理人报酬	—	—	—	3,281,631.91	3,281,631.91
应付托管费	—	—	—	492,244.78	492,244.78
应付销售服务费	—	—	—	42,235.54	42,235.54
应交税费	—	—	—	36.76	36.76
其他负债	—	—	—	2,648,967.84	2,648,967.84
负债总计	—	—	—	28,051,263.02	28,051,263.02
利率敏感度缺口	249,547,713.43	—	—	3,850,355,077.94	4,099,902,791.37
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	277,005,003.47	—	—	—	277,005,003.47
结算备付金	20,738,660.96	—	—	—	20,738,660.96

存出保证金	1,635,332.08	—	—	—	1,635,332.08
交易性金融资产	20,348,274.22	—	—	4,760,819,928.96	4,781,168,203.18
应收清算款	—	—	—	96,439.53	96,439.53
应收申购款	—	—	—	2,652,789.88	2,652,789.88
资产总计	319,727,270.73	—	—	4,763,569,158.37	5,083,296,429.10
负债					
应付清算款	—	—	—	35,353.92	35,353.92
应付赎回款	—	—	—	22,448,578.93	22,448,578.93
应付管理人报酬	—	—	—	4,228,807.40	4,228,807.40
应付托管费	—	—	—	634,321.09	634,321.09
应付销售服务费	—	—	—	86,396.03	86,396.03
应交税费	—	—	—	1.16	1.16
其他负债	—	—	—	2,599,108.36	2,599,108.36
负债总计	—	—	—	30,032,566.89	30,032,566.89
利率敏感度缺口	319,727,270.73	—	—	4,733,536,591.48	5,053,263,862.21

注：上表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 影响生息资产公允价值的其他变量不变，仅利率发生变动；2. 利率变动范围合理。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 06 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	1.基准点利率增加 0.1%	—	-797.92
	2.基准点利率减少 0.1%	—	797.92

注：上表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。本基金本期末未持有债券资产（不含可转债），因此本期末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	3,873,463,945.67	94.48	4,760,819,928.96	94.21
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	485,019.17	0.01	20,348,274.22	0.40
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	3,873,948,964.84	94.49	4,781,168,203.18	94.62

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%	39,536,606.15	46,910,201.59
	2.业绩比较基准减少 1%	-39,536,606.15	-46,910,201.59

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	3,852,003,419.98	4,751,414,764.57
第二层次	7,488,973.71	22,047,171.11
第三层次	14,456,571.15	7,706,267.50
合计	3,873,948,964.84	4,781,168,203.18

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	3,873,463,945.67	93.83
	其中：股票	3,873,463,945.67	93.83
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	485,019.17	0.01
	其中：债券	485,019.17	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	248,038,818.45	6.01
8	其他各项资产	5,966,271.10	0.14
9	合计	4,127,954,054.39	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

7.2.1.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	12,813,048.00	0.31
B	采矿业	82,992,528.64	2.02
C	制造业	2,504,598,434.22	61.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	60,767,167.90	1.48
E	建筑业	12,203,126.50	0.30
F	批发和零售业	77,532,858.67	1.89
G	交通运输、仓储和邮政业	26,823,373.85	0.65
H	住宿和餐饮业	6,694,079.00	0.16
I	信息传输、软件和信息技术服务业	196,866,009.47	4.80
J	金融业	120,614,776.76	2.94
K	房地产业	17,930,636.16	0.44
L	租赁和商务服务业	41,000,367.48	1.00

M	科学研究和技术服务业	9,744,673.32	0.24
N	水利、环境和公共设施管理业	32,232,097.60	0.79
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,873,842.84	0.12
R	文化、体育和娱乐业	11,854,494.00	0.29
S	综合	-	-
	合计	3,219,541,514.41	78.53

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	951,825.00	0.02
B	采矿业	23,434,365.60	0.57
C	制造业	508,596,052.97	12.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,289,327.44	0.08
E	建筑业	2,393,776.00	0.06
F	批发和零售业	7,374,942.20	0.18
G	交通运输、仓储和邮政业	24,140,050.90	0.59
H	住宿和餐饮业	511,420.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	37,292,240.07	0.91
J	金融业	10,098,717.00	0.25
K	房地产业	1,414,157.00	0.03
L	租赁和商务服务业	1,976,212.00	0.05
M	科学研究和技术服务业	29,064,255.08	0.71
N	水利、环境和公共设施管理业	1,559,216.00	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	618,300.00	0.02
Q	卫生和社会工作	592,184.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	615,390.00	0.02
S	综合	-	-
	合计	653,922,431.26	15.95

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	40,007	75,453,202.00	1.84

2	001309	德明利	65,000	61,288,500.00	1.49
3	300857	协创数据	158,032	53,715,076.80	1.31
4	688002	睿创微纳	287,650	44,496,578.50	1.09
5	300475	香农芯创	148,000	44,400,000.00	1.08
6	300604	长川科技	128,406	43,840,376.52	1.07
7	002281	光迅科技	169,000	43,422,860.00	1.06
8	002738	中矿资源	729,116	43,010,552.84	1.05
9	300223	君正股份	170,900	42,537,010.00	1.04
10	002008	大族激光	261,301	39,223,893.11	0.96
11	301536	星宸科技	290,500	37,390,255.00	0.91
12	300432	富临精工	1,816,260	36,488,663.40	0.89
13	001389	广合科技	142,922	33,908,244.50	0.83
14	600885	宏发股份	955,800	32,965,542.00	0.80
15	688347	华虹宏力	94,347	31,728,896.10	0.77
16	600105	永鼎股份	460,000	31,040,800.00	0.76
17	002266	浙富控股	5,886,900	29,787,714.00	0.73
18	002273	水晶光电	828,700	29,402,276.00	0.72
19	688120	华海清科	89,228	28,747,477.04	0.70
20	601869	长飞光纤	50,200	27,404,180.00	0.67
21	300953	震裕科技	194,648	26,024,437.60	0.63
22	002436	兴森科技	482,300	24,573,185.00	0.60
23	300136	信维通信	202,999	24,207,630.75	0.59
24	688361	中科飞测	53,532	23,018,760.00	0.56
25	600601	方正科技	1,654,902	22,903,843.68	0.56
26	603345	安井食品	285,100	22,862,169.00	0.56
27	301358	湖南裕能	295,700	22,434,759.00	0.55
28	688301	奕瑞科技	174,234	21,605,016.00	0.53
29	300054	鼎龙股份	203,300	21,543,701.00	0.53
30	002821	凯莱英	132,679	21,493,998.00	0.52
31	601233	桐昆股份	951,400	20,597,810.00	0.50
32	300972	万辰集团	117,800	20,427,698.00	0.50
33	300458	全志科技	516,104	20,365,463.84	0.50
34	600801	华新建材	1,304,074	20,343,554.40	0.50
35	002812	恩捷股份	303,836	20,329,666.76	0.50
36	002487	大金重工	343,500	19,912,695.00	0.49
37	002414	高德红外	1,479,887	19,623,301.62	0.48
38	688629	华丰科技	103,697	19,444,224.47	0.47
39	002850	科达利	97,239	18,407,342.70	0.45
40	301526	国际复材	393,000	18,341,310.00	0.45
41	600988	赤峰黄金	684,400	18,013,408.00	0.44
42	002402	和而泰	695,600	17,967,348.00	0.44

43	601665	齐鲁银行	2,972,213	17,149,669.01	0.42
44	300073	当升科技	354,900	17,049,396.00	0.42
45	002851	麦格米特	101,900	17,035,642.00	0.42
46	300285	国瓷材料	164,800	17,004,064.00	0.41
47	688266	泽璟制药	145,543	16,979,046.38	0.41
48	300666	江丰电子	44,900	16,550,140.00	0.40
49	002271	东方雨虹	1,389,383	16,491,976.21	0.40
50	300677	英科医疗	412,300	16,149,791.00	0.39
51	600363	联创光电	449,600	16,086,688.00	0.39
52	300037	新宙邦	173,200	16,081,620.00	0.39
53	300724	捷佳伟创	227,339	16,050,133.40	0.39
54	300496	中科创达	259,515	16,035,431.85	0.39
55	301200	大族数控	43,900	15,832,535.00	0.39
56	688777	中控技术	134,631	15,819,142.50	0.39
57	301377	鼎泰高科	28,700	15,810,830.00	0.39
58	300757	罗博特科	25,500	15,784,500.00	0.38
59	300919	中伟新材	356,740	15,607,375.00	0.38
60	002756	永兴材料	273,200	15,474,048.00	0.38
61	600595	中孚实业	2,690,300	15,119,486.00	0.37
62	605358	立昂微	192,582	14,944,363.20	0.36
63	688200	华峰测控	27,988	14,696,498.80	0.36
64	002131	利欧股份	3,054,000	14,506,500.00	0.35
65	300017	网宿科技	1,090,100	14,182,201.00	0.35
66	002407	多氟多	278,800	14,004,124.00	0.34
67	000783	长江证券	1,423,800	13,882,050.00	0.34
68	688037	芯源微	31,616	13,881,004.80	0.34
69	600166	福田汽车	4,765,800	13,868,478.00	0.34
70	000415	渤海租赁	3,396,000	13,821,720.00	0.34
71	688235	百济神州	54,166	13,791,205.26	0.34
72	002624	完美世界	1,104,630	13,719,504.60	0.33
73	300620	光库科技	35,700	13,501,740.00	0.33
74	600499	科达制造	970,300	13,390,140.00	0.33
75	000932	华菱钢铁	3,853,720	13,372,408.40	0.33
76	688692	达梦数据	54,622	13,343,608.38	0.33
77	000021	深科技	206,917	13,298,555.59	0.32
78	300395	菲利华	98,658	13,193,534.34	0.32
79	300548	长芯博创	47,400	13,177,200.00	0.32
80	688578	艾力斯	118,121	12,898,813.20	0.31
81	600498	烽火通信	174,348	12,832,012.80	0.31
82	002429	兆驰股份	1,203,000	12,499,170.00	0.30
83	688615	合合信息	109,809	12,419,397.90	0.30

84	002517	恺英网络	761,738	12,378,242.50	0.30
85	000960	锡业股份	288,287	12,306,972.03	0.30
86	603806	福斯特	729,500	12,248,305.00	0.30
87	002195	岩山科技	1,835,531	12,004,372.74	0.29
88	300346	南大光电	128,824	11,935,543.60	0.29
89	600109	国金证券	1,356,303	11,908,340.34	0.29
90	002185	华天科技	530,070	11,825,861.70	0.29
91	002064	华峰化学	1,245,934	11,823,913.66	0.29
92	601108	财通证券	1,351,167	11,687,594.55	0.29
93	688019	安集科技	34,049	11,558,273.54	0.28
94	002409	雅克科技	51,083	11,468,133.50	0.28
95	000703	恒逸石化	844,348	11,457,802.36	0.28
96	688313	仕佳光子	61,966	11,442,021.90	0.28
97	002138	顺络电子	154,700	11,308,570.00	0.28
98	603256	宏和科技	42,200	11,196,926.00	0.27
99	300567	精测电子	34,900	11,084,240.00	0.27
100	002432	九安医疗	154,222	10,900,410.96	0.27
101	600352	浙江龙盛	874,949	10,595,632.39	0.26
102	600879	航天电子	477,945	10,175,449.05	0.25
103	000519	中兵红箭	479,600	10,105,172.00	0.25
104	688599	天合光能	706,298	9,972,927.76	0.24
105	600663	陆家嘴	1,577,892	9,909,161.76	0.24
106	688469	芯联集成	920,341	9,764,818.01	0.24
107	000039	中集集团	1,184,388	9,605,386.68	0.23
108	300390	天华新能	102,200	9,556,722.00	0.23
109	300058	蓝色光标	687,248	9,456,532.48	0.23
110	600177	雅戈尔	1,254,718	9,448,026.54	0.23
111	002683	广东宏大	319,874	9,369,109.46	0.23
112	001203	大中矿业	309,700	9,275,515.00	0.23
113	603920	世运电路	192,800	9,262,112.00	0.23
114	300699	光威复材	322,925	9,251,801.25	0.23
115	600977	中国电影	710,500	9,179,660.00	0.22
116	601118	海南橡胶	1,850,900	9,106,428.00	0.22
117	300373	扬杰科技	57,800	9,087,894.00	0.22
118	688017	绿的谐波	21,402	8,943,039.72	0.22
119	000830	鲁西化工	729,924	8,759,088.00	0.21
120	688220	翱捷科技	68,605	8,528,973.60	0.21
121	600098	广州发展	1,436,240	8,488,178.40	0.21
122	301606	绿联科技	138,800	8,469,576.00	0.21
123	600685	中船防务	332,848	8,467,653.12	0.21
124	601139	深圳燃气	1,493,300	8,452,078.00	0.21

125	603179	新泉股份	170,213	8,451,075.45	0.21
126	688385	复旦微电	116,593	8,311,914.97	0.20
127	688172	燕东微	99,128	8,293,048.48	0.20
128	603699	纽威股份	163,300	8,213,990.00	0.20
129	688778	厦钨新能	149,517	8,133,724.80	0.20
130	688702	盛科通信	20,817	8,118,421.83	0.20
131	601567	三星电气	542,300	8,101,962.00	0.20
132	002203	海亮股份	353,700	8,082,045.00	0.20
133	601099	太平洋	2,303,031	7,761,214.47	0.19
134	000683	博源化工	1,347,159	7,759,635.84	0.19
135	300751	迈为股份	26,648	7,526,994.08	0.18
136	601699	潞安环能	523,600	7,477,008.00	0.18
137	000893	亚钾国际	182,200	7,450,158.00	0.18
138	688099	晶晨股份	72,252	7,434,730.80	0.18
139	688411	海博思创	25,499	7,425,308.80	0.18
140	000060	中金岭南	977,300	7,398,161.00	0.18
141	300002	神州泰岳	945,200	7,382,012.00	0.18
142	600909	华安证券	663,300	7,369,263.00	0.18
143	600497	驰宏锌锗	593,300	7,184,863.00	0.18
144	601198	东兴证券	525,532	7,141,979.88	0.17
145	688331	荣昌生物	54,707	7,126,133.82	0.17
146	300001	特锐德	187,789	7,104,057.87	0.17
147	603659	璞泰来	243,600	7,047,348.00	0.17
148	000598	兴蓉环境	1,094,649	7,027,646.58	0.17
149	688568	中科星图	167,383	6,941,373.01	0.17
150	605589	圣泉集团	109,100	6,935,487.00	0.17
151	000831	中国稀土	123,900	6,875,211.00	0.17
152	000155	川能动力	572,300	6,856,154.00	0.17
153	600392	盛和资源	228,500	6,802,445.00	0.17
154	600566	济川药业	305,500	6,779,045.00	0.17
155	002130	沃尔核材	355,200	6,734,592.00	0.16
156	600754	锦江酒店	372,100	6,694,079.00	0.16
157	600711	盛屯矿业	599,100	6,572,127.00	0.16
158	688052	纳芯微	22,709	6,547,231.79	0.16
159	002126	银轮股份	131,100	6,528,780.00	0.16
160	688387	信科移动	322,663	6,401,633.92	0.16
161	600348	华阳股份	835,800	6,393,870.00	0.16
162	600299	安迪苏	811,100	6,367,135.00	0.16
163	600131	国网信通	433,600	6,330,560.00	0.15
164	300474	景嘉微	104,266	6,306,007.68	0.15
165	601555	东吴证券	766,094	6,067,464.48	0.15

166	600312	平高电气	341,500	6,030,890.00	0.15
167	601399	国机重装	1,716,000	6,006,000.00	0.15
168	002155	湖南黄金	250,924	5,989,555.88	0.15
169	601615	明阳智能	517,000	5,981,690.00	0.15
170	300115	长盈精密	212,778	5,945,017.32	0.15
171	001286	陕西能源	583,500	5,916,690.00	0.14
172	603766	隆鑫通用	495,200	5,907,736.00	0.14
173	600008	首创环保	2,155,900	5,864,048.00	0.14
174	600704	物产中大	1,238,817	5,847,216.24	0.14
175	603225	新凤鸣	296,635	5,828,877.75	0.14
176	002340	格林美	858,190	5,672,635.90	0.14
177	603290	斯达半导	36,800	5,628,192.00	0.14
178	603129	春风动力	21,800	5,576,440.00	0.14
179	000733	振华科技	98,200	5,562,048.00	0.14
180	002335	科华数据	128,000	5,433,600.00	0.13
181	601179	中国西电	361,100	5,387,612.00	0.13
182	300679	电连技术	88,783	5,326,092.17	0.13
183	603737	三棵树	219,480	5,289,468.00	0.13
184	600737	中粮糖业	428,310	5,281,062.30	0.13
185	000878	云南铜业	325,800	5,173,704.00	0.13
186	601106	中国一重	1,565,800	5,167,140.00	0.13
187	000967	盈峰环境	490,400	5,163,912.00	0.13
188	600901	江苏金租	894,677	5,144,392.75	0.13
189	000987	越秀资本	653,895	5,113,458.90	0.12
190	600483	福能股份	498,320	5,077,880.80	0.12
191	600378	昊华科技	66,900	5,042,922.00	0.12
192	300207	欣旺达	265,102	5,034,286.98	0.12
193	300570	太辰光	20,200	4,983,542.00	0.12
194	601997	贵阳银行	954,916	4,898,719.08	0.12
195	688349	三一重能	319,481	4,849,721.58	0.12
196	688018	乐鑫科技	37,430	4,788,045.60	0.12
197	000032	深桑达Ａ	191,700	4,782,915.00	0.12
198	002244	滨江集团	628,989	4,780,316.40	0.12
199	000738	航发控制	259,500	4,746,255.00	0.12
200	600298	安琪酵母	129,867	4,701,185.40	0.11
201	600486	扬农化工	92,600	4,694,820.00	0.11
202	002120	韵达股份	726,200	4,618,632.00	0.11
203	688234	天岳先进	26,140	4,535,551.40	0.11
204	603885	吉祥航空	439,100	4,518,339.00	0.11
205	300383	光环新网	362,800	4,513,232.00	0.11
206	603308	应流股份	73,500	4,439,400.00	0.11

207	000528	柳工	584,925	4,416,183.75	0.11
208	002465	海格通信	343,872	4,391,245.44	0.11
209	002025	航天电器	57,300	4,367,406.00	0.11
210	601865	福莱特	413,300	4,343,783.00	0.11
211	000559	万向钱潮	329,787	4,264,145.91	0.10
212	000739	普洛药业	254,382	4,238,004.12	0.10
213	002262	恩华药业	223,000	4,181,250.00	0.10
214	603565	中谷物流	425,900	4,178,079.00	0.10
215	600143	金发科技	270,100	4,173,045.00	0.10
216	002261	拓维信息	147,400	4,128,674.00	0.10
217	000800	一汽解放	692,400	4,119,780.00	0.10
218	601611	中国核建	363,600	4,054,140.00	0.10
219	600141	兴发集团	85,700	4,025,329.00	0.10
220	000423	东阿阿胶	88,500	4,014,360.00	0.10
221	003035	南网能源	687,200	3,999,504.00	0.10
222	600316	洪都航空	142,100	3,970,274.00	0.10
223	689009	九号公司	102,912	3,926,092.80	0.10
224	002841	视源股份	113,400	3,915,702.00	0.10
225	603444	吉比特	10,700	3,835,094.00	0.09
226	688617	惠泰医疗	21,032	3,818,569.92	0.09
227	603119	浙江荣泰	57,300	3,801,282.00	0.09
228	003031	中瓷电子	20,600	3,714,180.00	0.09
229	300454	深信服	38,414	3,695,426.80	0.09
230	002410	广联达	450,780	3,678,364.80	0.09
231	688709	成都华微	96,275	3,667,114.75	0.09
232	600380	健康元	387,000	3,645,540.00	0.09
233	002065	东华软件	506,100	3,613,554.00	0.09
234	000429	粤高速Ａ	259,053	3,536,073.45	0.09
235	002670	国盛证券	317,400	3,491,400.00	0.09
236	003022	联泓新科	133,988	3,470,289.20	0.08
237	002044	美年健康	689,428	3,467,822.84	0.08
238	601128	常熟银行	594,213	3,458,319.66	0.08
239	688772	珠海冠宇	175,370	3,442,513.10	0.08
240	300763	锦浪科技	37,500	3,388,125.00	0.08
241	300146	汤臣倍健	368,293	3,329,368.72	0.08
242	000951	中国重汽	170,300	3,322,553.00	0.08
243	002444	巨星科技	106,100	3,299,710.00	0.08
244	603979	金诚信	55,300	3,264,359.00	0.08
245	688027	国盾量子	6,467	3,259,432.67	0.08
246	600153	建发股份	405,500	3,215,615.00	0.08
247	688475	萤石网络	116,932	3,198,090.20	0.08

248	300339	润和软件	82,900	3,192,479.00	0.08
249	002157	正邦科技	1,131,600	3,179,796.00	0.08
250	600808	马钢股份	1,271,600	3,179,000.00	0.08
251	600862	中航高科	175,900	3,171,477.00	0.08
252	688188	柏楚电子	29,583	3,156,506.10	0.08
253	300623	捷捷微电	69,700	3,135,803.00	0.08
254	301611	珂玛科技	17,300	3,115,211.00	0.08
255	300012	华测检测	211,800	2,935,548.00	0.07
256	000034	神州数码	103,777	2,879,811.75	0.07
257	000737	北方铜业	217,000	2,868,740.00	0.07
258	002299	圣农发展	187,457	2,841,848.12	0.07
259	002152	广电运通	300,586	2,819,496.68	0.07
260	601608	中信重工	590,800	2,818,116.00	0.07
261	688608	恒玄科技	16,853	2,817,653.07	0.07
262	000050	深天马Ａ	281,697	2,791,617.27	0.07
263	601016	节能风电	718,030	2,785,956.40	0.07
264	688213	思特威	25,631	2,744,311.17	0.07
265	002966	苏州银行	391,130	2,722,264.80	0.07
266	002472	双环传动	64,800	2,689,848.00	0.07
267	600208	衢州发展	940,700	2,662,181.00	0.06
268	603596	伯特利	106,175	2,637,387.00	0.06
269	688728	格科微	124,042	2,609,843.68	0.06
270	601958	金钼股份	92,030	2,586,963.30	0.06
271	601991	大唐发电	363,000	2,570,040.00	0.06
272	603650	彤程新材	26,200	2,567,076.00	0.06
273	600282	南钢股份	558,001	2,561,224.59	0.06
274	688122	西部超导	40,409	2,538,089.29	0.06
275	688281	华秦科技	48,277	2,424,953.71	0.06
276	002078	太阳纸业	193,400	2,415,566.00	0.06
277	600435	北方导航	214,300	2,400,160.00	0.06
278	603087	甘李药业	41,651	2,364,110.76	0.06
279	000400	许继电气	108,200	2,347,940.00	0.06
280	000623	吉林敖东	131,600	2,333,268.00	0.06
281	600126	杭钢股份	380,600	2,333,078.00	0.06
282	600765	中航重机	179,800	2,323,016.00	0.06
283	000629	钒钛股份	688,200	2,298,588.00	0.06
284	300957	贝泰妮	72,900	2,297,079.00	0.06
285	002085	万丰奥威	203,900	2,261,251.00	0.06
286	600546	山煤国际	205,800	2,249,394.00	0.05
287	601577	长沙银行	256,804	2,236,762.84	0.05
288	601696	中银证券	174,900	2,212,485.00	0.05

289	600535	天士力	164,400	2,175,012.00	0.05
290	600171	上海贝岭	67,600	2,159,144.00	0.05
291	600583	海油工程	428,500	2,155,355.00	0.05
292	603606	东方电缆	51,500	2,137,765.00	0.05
293	000513	丽珠集团	73,873	2,134,190.97	0.05
294	000750	国海证券	578,400	2,128,512.00	0.05
295	600339	中油工程	688,000	2,112,160.00	0.05
296	600699	均胜电子	97,600	2,109,136.00	0.05
297	600563	法拉电子	10,900	2,079,720.00	0.05
298	600256	广汇能源	406,100	2,006,134.00	0.05
299	001696	宗申动力	94,800	1,972,788.00	0.05
300	002056	横店东磁	64,700	1,972,056.00	0.05
301	600967	内蒙一机	180,700	1,960,595.00	0.05
302	688180	君实生物	57,812	1,955,201.84	0.05
303	688322	奥比中光	14,584	1,903,941.20	0.05
304	600970	中材国际	260,850	1,859,860.50	0.05
305	300748	金力永磁	59,700	1,841,745.00	0.04
306	000723	美锦能源	548,100	1,836,135.00	0.04
307	000729	燕京啤酒	179,251	1,815,812.63	0.04
308	603379	三美股份	23,600	1,791,004.00	0.04
309	000887	中鼎股份	98,900	1,769,321.00	0.04
310	688676	金盘科技	20,675	1,749,932.00	0.04
311	000825	太钢不锈	511,685	1,744,845.85	0.04
312	600884	杉杉股份	128,400	1,739,820.00	0.04
313	601598	中国外运	349,291	1,732,483.36	0.04
314	300558	贝达药业	26,600	1,730,862.00	0.04
315	688375	国博电子	16,556	1,726,790.80	0.04
316	600927	永安期货	135,500	1,686,975.00	0.04
317	600985	淮北矿业	115,600	1,624,180.00	0.04
318	688169	石头科技	17,095	1,623,512.15	0.04
319	688248	南网科技	22,924	1,585,882.32	0.04
320	600655	豫园股份	381,700	1,568,787.00	0.04
321	688336	三生国健	29,361	1,559,069.10	0.04
322	000582	北部湾港	144,800	1,553,704.00	0.04
323	603568	伟明环保	100,220	1,541,383.60	0.04
324	000883	湖北能源	355,800	1,537,056.00	0.04
325	600764	中国海防	87,600	1,526,868.00	0.04
326	000959	首钢股份	432,738	1,518,910.38	0.04
327	600820	隧道股份	289,100	1,506,211.00	0.04
328	000997	新 大 陆	91,101	1,484,946.30	0.04
329	300003	乐普医疗	123,000	1,457,550.00	0.04

330	688295	中复神鹰	23,652	1,431,892.08	0.03
331	601001	晋控煤业	82,300	1,431,197.00	0.03
332	603688	石英股份	17,200	1,420,892.00	0.03
333	600763	通策医疗	41,500	1,406,020.00	0.03
334	601928	凤凰传媒	159,000	1,397,610.00	0.03
335	600377	宁沪高速	120,100	1,389,557.00	0.03
336	000921	海信家电	50,800	1,387,856.00	0.03
337	600038	中直股份	54,540	1,379,316.60	0.03
338	002223	鱼跃医疗	50,960	1,307,633.60	0.03
339	603939	益丰药房	70,616	1,269,675.68	0.03
340	600516	方大炭素	205,600	1,268,552.00	0.03
341	600873	梅花生物	171,000	1,256,850.00	0.03
342	603000	人民网	83,300	1,232,007.00	0.03
343	300759	康龙化成	42,300	1,223,739.00	0.03
344	003021	兆威机电	13,900	1,214,165.00	0.03
345	601000	唐山港	289,584	1,201,773.60	0.03
346	600021	上海电力	79,397	1,196,512.79	0.03
347	601717	中创智领	85,885	1,194,660.35	0.03
348	600637	东方明珠	140,218	1,165,211.58	0.03
349	600998	九州通	243,000	1,139,670.00	0.03
350	600060	海信视像	40,000	1,114,800.00	0.03
351	600004	白云机场	152,600	1,107,876.00	0.03
352	688582	芯动联科	17,038	1,107,470.00	0.03
353	600578	京能电力	169,900	1,095,855.00	0.03
354	603160	汇顶科技	17,600	1,086,096.00	0.03
355	002603	以岭药业	72,000	1,080,000.00	0.03
356	688343	云天励飞	13,160	1,074,645.60	0.03
357	601156	东航物流	65,587	1,057,262.44	0.03
358	000591	太阳能	228,800	1,052,480.00	0.03
359	600602	云赛智联	64,200	1,032,336.00	0.03
360	601666	平煤股份	142,000	1,015,300.00	0.02
361	000983	山西焦煤	171,900	997,020.00	0.02
362	002500	山西证券	192,000	990,720.00	0.02
363	601966	玲珑轮胎	90,500	922,195.00	0.02
364	600292	电投水电	75,000	903,000.00	0.02
365	600863	华能蒙电	191,050	897,935.00	0.02
366	601298	青岛港	104,700	842,835.00	0.02
367	000027	深圳能源	126,200	782,440.00	0.02
368	600517	国网英大	156,400	731,952.00	0.02
369	600398	海澜之家	136,600	714,418.00	0.02
370	603486	科沃斯	13,784	699,538.00	0.02

371	002430	杭氧股份	22,400	693,504.00	0.02
372	300487	蓝晓科技	11,700	688,545.00	0.02
373	600707	彩虹股份	39,100	660,399.00	0.02
374	601098	中南传媒	67,100	660,264.00	0.02
375	300718	长盛轴承	10,800	658,476.00	0.02
376	002773	康弘药业	31,200	638,040.00	0.02
377	600095	湘财股份	83,900	631,767.00	0.02
378	601019	山东出版	96,400	616,960.00	0.02
379	300735	光弘科技	27,000	613,980.00	0.01
380	688192	迪哲医药	15,070	601,745.10	0.01
381	002926	华西证券	73,300	598,861.00	0.01
382	600848	上海临港	77,300	578,977.00	0.01
383	300142	沃森生物	44,300	575,457.00	0.01
384	000088	盐田港	138,900	568,101.00	0.01
385	301498	乖宝宠物	13,800	560,142.00	0.01
386	002318	久立特材	22,500	537,750.00	0.01
387	600598	北大荒	48,600	526,824.00	0.01
388	600332	白云山	26,000	521,040.00	0.01
389	600350	山东高速	46,600	518,658.00	0.01
390	002797	第一创业	75,800	498,006.00	0.01
391	002568	百润股份	28,200	477,144.00	0.01
392	603833	欧派家居	15,600	469,716.00	0.01
393	002153	石基信息	64,900	469,227.00	0.01
394	300100	双林股份	16,800	466,704.00	0.01
395	600390	五矿资本	101,200	461,472.00	0.01
396	600968	海油发展	138,100	459,873.00	0.01
397	600100	同方股份	65,100	445,935.00	0.01
398	601799	星宇股份	4,900	444,038.00	0.01
399	002601	龙佰集团	26,800	441,664.00	0.01
400	600642	申能股份	50,241	438,603.93	0.01
401	603175	超颖电子	4,900	436,541.00	0.01
402	603858	步长制药	29,300	427,780.00	0.01
403	002423	中粮资本	51,800	426,314.00	0.01
404	001221	悍高集团	10,194	410,002.68	0.01
405	688561	奇安信	16,919	405,717.62	0.01
406	600032	浙江新能	55,200	389,160.00	0.01
407	002265	建设工业	22,200	386,280.00	0.01
408	002032	苏 泊 尔	9,700	384,120.00	0.01
409	000537	绿发电力	46,300	338,453.00	0.01
410	002673	西部证券	33,100	214,819.00	0.01
411	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	21,300	27,051,000.00	0.66
2	301308	江波龙	23,513	16,548,449.40	0.40
3	002384	东山精密	60,700	15,924,645.00	0.39
4	600418	江淮汽车	602,100	15,552,243.00	0.38
5	688525	佰维存储	30,814	15,244,610.22	0.37
6	002466	天齐锂业	232,507	14,257,329.24	0.35
7	600875	东方电气	491,500	14,140,455.00	0.34
8	601872	招商轮船	699,000	12,281,430.00	0.30
9	603986	兆易创新	15,000	12,225,000.00	0.30
10	000338	潍柴动力	439,400	11,973,650.00	0.29
11	300438	鹏辉能源	129,400	10,720,790.00	0.26
12	688202	美迪西	128,808	10,396,093.68	0.25
13	002558	巨人网络	353,200	9,734,192.00	0.24
14	300033	同花顺	37,600	9,061,600.00	0.22
15	600487	亨通光电	79,802	8,725,550.68	0.21
16	600150	中国船舶	255,400	8,629,966.00	0.21
17	002532	天山铝业	750,260	8,050,289.80	0.20
18	603259	药明康德	62,300	7,756,973.00	0.19
19	300502	新易盛	12,660	7,684,620.00	0.19
20	688795	摩尔线程	10,828	7,329,906.32	0.18
21	002709	天赐材料	134,300	6,907,049.00	0.17
22	688390	固德威	61,876	6,714,164.76	0.16
23	603619	中曼石油	353,900	6,621,469.00	0.16
24	002463	沪电股份	43,300	6,616,240.00	0.16
25	002653	海思科	92,900	6,162,986.00	0.15
26	688072	拓荆科技	7,378	6,138,496.00	0.15
27	000933	神火股份	289,100	6,128,920.00	0.15
28	003010	若羽臣	250,964	6,098,425.20	0.15
29	603228	景旺电子	82,500	5,973,825.00	0.15
30	688008	澜起科技	19,031	5,897,706.90	0.14
31	002345	潮宏基	640,100	5,869,717.00	0.14
32	688519	南亚新材	15,368	5,840,454.72	0.14
33	002156	通富微电	74,900	5,682,663.00	0.14
34	600026	中远海能	315,200	5,654,688.00	0.14
35	002484	江海股份	53,100	5,575,500.00	0.14
36	688221	前沿生物	236,608	5,300,019.20	0.13
37	600989	宝丰能源	254,800	5,180,084.00	0.13

38	000408	藏格矿业	74,500	5,164,340.00	0.13
39	688111	金山办公	23,813	5,073,359.65	0.12
40	603507	振江股份	153,500	5,048,615.00	0.12
41	600176	中国巨石	65,400	4,766,352.00	0.12
42	002080	中材科技	51,700	4,653,000.00	0.11
43	688503	聚和材料	34,895	4,630,566.50	0.11
44	300938	信测标准	92,180	4,597,938.40	0.11
45	300201	海伦哲	213,500	4,498,445.00	0.11
46	000988	华工科技	23,200	4,282,952.00	0.10
47	300740	水羊股份	230,800	4,249,028.00	0.10
48	688059	华锐精密	20,397	4,073,484.87	0.10
49	603889	新澳股份	794,747	4,061,157.17	0.10
50	688472	阿特斯	374,477	4,051,841.14	0.10
51	002353	杰瑞股份	26,500	4,041,250.00	0.10
52	002317	众生药业	162,500	3,992,625.00	0.10
53	600353	旭光电子	87,500	3,990,000.00	0.10
54	300661	圣邦股份	27,700	3,974,396.00	0.10
55	600118	中国卫星	47,900	3,930,195.00	0.10
56	002674	兴业科技	134,600	3,840,138.00	0.09
57	688668	鼎通科技	10,037	3,746,812.10	0.09
58	600201	生物股份	319,700	3,724,505.00	0.09
59	300394	天孚通信	11,860	3,589,784.80	0.09
60	688556	高测股份	262,218	3,482,255.04	0.08
61	300049	福瑞医科	86,900	3,378,672.00	0.08
62	002780	三夫户外	277,100	3,363,994.00	0.08
63	688308	欧科亿	18,386	3,342,758.66	0.08
64	603063	禾望电气	61,500	3,252,735.00	0.08
65	688045	必易微	38,336	3,096,782.08	0.08
66	002648	卫星化学	131,000	3,077,190.00	0.08
67	688802	沐曦股份	3,994	3,070,946.66	0.07
68	688372	伟测科技	16,385	3,047,610.00	0.07
69	601127	赛力斯	46,900	2,872,625.00	0.07
70	300408	三环集团	16,600	2,770,540.00	0.07
71	600547	山东黄金	118,900	2,745,401.00	0.07
72	301086	鸿富瀚	12,900	2,699,712.00	0.07
73	000975	山金国际	158,000	2,686,000.00	0.07
74	002364	中恒电气	49,700	2,673,860.00	0.07
75	300476	胜宏科技	7,500	2,598,225.00	0.06
76	688783	西安奕材	44,370	2,547,725.40	0.06
77	000426	兴业银锡	75,217	2,479,152.32	0.06
78	600183	生益科技	14,100	2,444,940.00	0.06

79	002947	恒铭达	31,600	2,403,180.00	0.06
80	603929	亚翔集成	8,800	2,393,776.00	0.06
81	688717	艾罗能源	27,385	2,261,179.45	0.06
82	601208	东材科技	31,800	2,251,122.00	0.05
83	603162	海通发展	242,552	2,175,691.44	0.05
84	300568	星源材质	115,100	2,154,672.00	0.05
85	688378	奥来德	34,202	2,120,524.00	0.05
86	301607	富特科技	40,328	2,107,138.00	0.05
87	600489	中金黄金	114,800	2,072,140.00	0.05
88	601975	招商南油	542,800	2,024,644.00	0.05
89	300842	帝科股份	22,470	2,003,649.90	0.05
90	002865	钧达股份	33,300	1,987,344.00	0.05
91	300274	阳光电源	12,200	1,940,044.00	0.05
92	601231	环旭电子	59,079	1,914,159.60	0.05
93	601339	百隆东方	278,300	1,884,091.00	0.05
94	002803	吉宏股份	72,580	1,875,467.20	0.05
95	600549	厦门钨业	21,559	1,836,826.80	0.04
96	600938	中国海油	67,000	1,819,050.00	0.04
97	002475	立讯精密	25,700	1,809,280.00	0.04
98	688025	杰普特	3,788	1,780,360.00	0.04
99	000534	万泽股份	64,600	1,767,456.00	0.04
100	688516	奥特维	30,702	1,761,987.78	0.04
101	002970	锐明技术	32,700	1,747,161.00	0.04
102	001339	智微智能	16,430	1,680,460.40	0.04
103	002497	雅化集团	82,004	1,670,421.48	0.04
104	688502	茂莱光学	2,375	1,647,300.00	0.04
105	002602	世纪华通	113,500	1,600,350.00	0.04
106	688256	寒武纪	1,003	1,600,336.65	0.04
107	688486	龙迅股份	24,707	1,570,871.06	0.04
108	600391	航发科技	46,300	1,548,735.00	0.04
109	000807	云铝股份	68,500	1,516,590.00	0.04
110	002294	信立泰	46,500	1,482,885.00	0.04
111	601888	中国中免	26,800	1,439,428.00	0.04
112	688095	福昕软件	24,203	1,438,384.29	0.04
113	688127	蓝特光学	14,734	1,438,038.40	0.04
114	605090	九丰能源	37,700	1,401,309.00	0.03
115	601636	旗滨集团	136,900	1,400,487.00	0.03
116	301216	万凯新材	58,000	1,333,420.00	0.03
117	002128	电投能源	57,000	1,317,840.00	0.03
118	603799	华友钴业	27,200	1,312,672.00	0.03
119	000100	TCL 科技	222,900	1,297,278.00	0.03

120	688536	思瑞浦	3,552	1,293,247.68	0.03
121	300483	首华燃气	73,500	1,292,130.00	0.03
122	688102	斯瑞新材	27,277	1,286,928.86	0.03
123	002916	深南电路	2,800	1,282,120.00	0.03
124	002170	芭田股份	117,500	1,276,050.00	0.03
125	300769	德方纳米	18,600	1,236,900.00	0.03
126	002245	蔚蓝锂芯	65,800	1,231,118.00	0.03
127	688196	卓越新能	33,883	1,216,399.70	0.03
128	688041	海光信息	3,283	1,215,694.90	0.03
129	300672	国科微	4,100	1,209,500.00	0.03
130	301093	华兰股份	8,900	1,207,107.00	0.03
131	002545	东方铁塔	73,400	1,190,548.00	0.03
132	002993	奥海科技	16,500	1,181,565.00	0.03
133	300347	泰格医药	24,600	1,180,800.00	0.03
134	688630	芯碁微装	2,138	1,174,595.82	0.03
135	002001	新 和 成	38,800	1,102,696.00	0.03
136	601100	恒立液压	10,200	1,097,112.00	0.03
137	300945	曼卡龙	99,300	1,075,419.00	0.03
138	688049	炬芯科技	22,875	1,073,066.25	0.03
139	688307	中润光学	13,258	1,059,977.10	0.03
140	688388	嘉元科技	23,534	1,035,496.00	0.03
141	002859	洁美科技	9,400	1,029,394.00	0.03
142	002379	宏桥控股	67,900	1,002,883.00	0.02
143	002734	利民股份	58,000	995,860.00	0.02
144	601918	新集能源	114,302	981,854.18	0.02
145	300870	欧陆通	2,800	967,932.00	0.02
146	002458	益生股份	122,500	951,825.00	0.02
147	601512	中新集团	121,800	950,040.00	0.02
148	601168	西部矿业	35,002	949,954.28	0.02
149	300005	探路者	41,400	935,640.00	0.02
150	002600	领益智造	53,900	934,626.00	0.02
151	688100	威胜信息	30,168	922,839.12	0.02
152	603127	昭衍新药	23,700	905,814.00	0.02
153	688428	诺诚健华	31,228	889,061.16	0.02
154	301550	斯菱智驱	9,700	886,871.00	0.02
155	001248	华润新能源	84,104	850,291.44	0.02
156	603317	天味食品	64,400	837,844.00	0.02
157	300277	汽轮科技	55,300	831,712.00	0.02
158	002049	紫光国微	9,200	816,500.00	0.02
159	600096	云天化	26,700	811,680.00	0.02
160	688279	峰岹科技	3,556	798,108.64	0.02

161	002706	良信股份	72,400	789,884.00	0.02
162	301413	安培龙	10,900	772,592.00	0.02
163	000066	中国长城	39,500	752,475.00	0.02
164	002922	伊戈尔	21,700	711,760.00	0.02
165	301396	宏景科技	2,100	696,360.00	0.02
166	688176	亚虹医药	69,594	690,372.48	0.02
167	002020	京新药业	55,000	686,950.00	0.02
168	300218	安利股份	57,400	683,060.00	0.02
169	002533	金杯电工	63,100	673,277.00	0.02
170	603579	荣泰健康	39,600	672,012.00	0.02
171	300811	铂科新材	7,080	671,821.20	0.02
172	001965	招商公路	72,500	664,100.00	0.02
173	300129	泰胜风能	76,800	656,640.00	0.02
174	301349	信德新材	8,900	655,040.00	0.02
175	688700	东威科技	7,249	648,060.60	0.02
176	688409	富创精密	2,109	645,881.25	0.02
177	688507	索辰科技	2,390	644,535.20	0.02
178	002448	中原内配	51,400	632,220.00	0.02
179	002961	瑞达期货	31,900	624,602.00	0.02
180	002048	宁波华翔	27,000	621,000.00	0.02
181	603518	锦泓集团	86,800	620,620.00	0.02
182	300492	华图山鼎	18,000	618,300.00	0.02
183	001330	博纳影业	109,500	615,390.00	0.02
184	688636	智明达	16,920	613,011.60	0.01
185	300416	苏试试验	29,900	609,362.00	0.01
186	600590	泰豪科技	60,300	609,030.00	0.01
187	688063	派能科技	11,312	602,590.24	0.01
188	002493	荣盛石化	55,800	599,850.00	0.01
189	002643	万润股份	28,400	594,980.00	0.01
190	300244	迪安诊断	31,600	592,184.00	0.01
191	688143	长盈通	3,314	582,866.32	0.01
192	002949	华阳国际	57,600	569,664.00	0.01
193	601600	中国铝业	68,400	562,248.00	0.01
194	002028	思源电气	3,200	553,600.00	0.01
195	600233	圆通速递	34,800	548,100.00	0.01
196	300918	南山智尚	50,900	545,648.00	0.01
197	000791	甘肃能源	71,700	544,920.00	0.01
198	002539	云图控股	47,700	539,964.00	0.01
199	300850	新强联	20,100	538,680.00	0.01
200	605168	三人行	10,600	536,784.00	0.01
201	603214	爱婴室	44,200	535,262.00	0.01

202	688258	卓易信息	4,507	534,259.78	0.01
203	688368	晶丰明源	2,467	534,154.84	0.01
204	605056	咸亨国际	32,800	524,800.00	0.01
205	301193	家联科技	28,300	524,682.00	0.01
206	001301	尚太科技	5,600	523,656.00	0.01
207	301073	君亭酒店	28,100	511,420.00	0.01
208	300984	金沃股份	9,400	505,062.00	0.01
209	000803	山高环能	73,000	494,940.00	0.01
210	000543	皖能电力	65,100	492,807.00	0.01
211	002159	三特索道	39,200	484,904.00	0.01
212	002443	金洲管道	49,700	473,641.00	0.01
213	603057	紫燕食品	20,900	466,070.00	0.01
214	600266	城建发展	118,700	464,117.00	0.01
215	600426	华鲁恒升	19,300	461,656.00	0.01
216	603268	松发股份	3,300	459,624.00	0.01
217	688112	鼎阳科技	6,243	458,610.78	0.01
218	002615	哈尔斯	65,300	450,570.00	0.01
219	688239	航宇科技	7,489	448,066.87	0.01
220	000962	东方钽业	4,900	443,940.00	0.01
221	603588	高能环境	22,600	433,920.00	0.01
222	603505	金石资源	21,500	433,225.00	0.01
223	688062	迈威生物	15,306	432,394.50	0.01
224	688488	艾迪药业	32,733	420,619.05	0.01
225	002438	江苏神通	28,100	419,533.00	0.01
226	688150	莱特光电	6,077	417,003.74	0.01
227	002270	华明装备	21,900	412,815.00	0.01
228	300803	指南针	4,500	412,515.00	0.01
229	600115	中国东航	105,400	401,574.00	0.01
230	301371	敷尔佳	15,100	392,600.00	0.01
231	603707	健友股份	55,510	392,455.70	0.01
232	002930	宏川智慧	42,200	388,240.00	0.01
233	002895	川恒股份	13,000	379,600.00	0.01
234	002534	西子洁能	20,000	371,000.00	0.01
235	600389	江山股份	18,300	357,216.00	0.01
236	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.01
237	688790	昂瑞微	2,319	293,237.55	0.01
238	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.01
239	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.00
240	301305	朗坤科技	5,100	145,452.00	0.00
241	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.00
242	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00

243	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
244	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
245	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
246	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
247	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
248	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
249	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
250	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
251	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
252	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
253	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
254	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
255	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
256	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
257	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
258	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
259	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
260	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
261	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
262	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300136	信维通信	168,368,385.66	3.33
2	000426	兴业银锡	120,836,729.56	2.39
3	300058	蓝色光标	116,010,564.28	2.30
4	002465	海格通信	103,358,086.00	2.05
5	600487	亨通光电	101,449,352.91	2.01
6	601615	明阳智能	101,139,172.00	2.00
7	002558	巨人网络	97,600,415.88	1.93
8	600879	航天电子	96,140,977.00	1.90
9	000021	深科技	95,981,107.30	1.90
10	002281	光迅科技	92,508,408.00	1.83
11	002273	水晶光电	89,051,697.00	1.76
12	002738	中矿资源	83,480,940.00	1.65
13	600118	中国卫星	82,180,383.04	1.63
14	300308	中际旭创	80,631,783.52	1.60
15	300604	长川科技	78,980,521.88	1.56

16	002624	完美世界	78,900,436.00	1.56
17	688777	中控技术	78,305,594.74	1.55
18	002414	高德红外	76,176,575.96	1.51
19	300432	富临精工	75,774,763.00	1.50
20	002008	大族激光	74,482,057.00	1.47

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	600487	亨通光电	154,244,195.86	3.05
2	300136	信维通信	145,407,581.50	2.88
3	000426	兴业银锡	137,066,163.10	2.71
4	002465	海格通信	134,412,895.81	2.66
5	002273	水晶光电	122,999,361.32	2.43
6	000021	深科技	121,374,189.19	2.40
7	002281	光迅科技	120,125,654.00	2.38
8	300058	蓝色光标	118,578,964.85	2.35
9	002436	兴森科技	115,832,491.10	2.29
10	300604	长川科技	113,594,153.00	2.25
11	002156	通富微电	104,934,359.00	2.08
12	601991	大唐发电	100,577,614.99	1.99
13	002837	英维克	100,081,761.27	1.98
14	600096	云天化	95,523,398.20	1.89
15	600988	赤峰黄金	93,533,876.06	1.85
16	601233	桐昆股份	92,910,645.52	1.84
17	600879	航天电子	92,900,224.00	1.84
18	002195	岩山科技	92,060,055.00	1.82
19	002558	巨人网络	91,717,570.32	1.82
20	601168	西部矿业	91,548,206.94	1.81

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	16,380,004,731.67
卖出股票收入（成交）总额	18,033,415,807.35

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）	485,019.17	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	485,019.17	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	113704	春风转债	3,710	371,017.08	0.01
2	111025	圣泉转债	720	72,000.95	0.00
3	118072	鼎通转债	310	31,000.95	0.00
4	118071	华峰转债	110	11,000.19	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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	1,023,875.81
2	应收清算款	111,307.00
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,831,088.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,966,271.10

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未持有流通受限的股票。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中未持有流通受限股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
富国中证 500 指数增强（LOF）A/B	300,821	4,275.95	20,564,488.10	1.60	1,265,731,908.80	98.40
富国中证 500 指数增强（LOF）C	23,863	3,933.49	63,767,346.51	67.94	30,097,520.47	32.06
富国中证 500 指数增强（LOF）Y	6,921	2,511.34	—	—	17,381,002.95	100.00
合计	331,605	4,214.48	84,331,834.61	6.03	1,313,210,432.22	93.97

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例(%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	富国中证 500 指数增强（LOF）A/B	369,715.66	0.0287
	富国中证 500 指数增强（LOF）C	15,232.49	0.0162
	富国中证 500 指数增强（LOF）Y	162,363.30	0.9341
	合计	547,311.45	0.0392

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	富国中证 500 指数增强（LOF）A/B	0~10
	富国中证 500 指数增强（LOF）C	0
	富国中证 500 指数增强（LOF）Y	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	富国中证 500 指数增强（LOF）A/B	0~10
	富国中证 500 指数增强（LOF）C	0
	富国中证 500 指数增强（LOF）Y	0
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	富国中证500指数增强（LOF）A/B	富国中证500指数增强（LOF）C	富国中证500指数增强（LOF）Y
基金合同生效日（2011年10月12日）基金份额总额	455,487,249.88	-	-
本报告期期初基金份额总额	1,845,591,098.29	166,361,168.45	7,985,469.06
本报告期基金总申购份额	201,162,621.02	106,513,957.01	14,864,609.52
减：本报告期基金总赎回份额	760,457,322.41	179,010,258.48	5,469,075.63
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,286,296,396.90	93,864,866.98	17,381,002.95

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金基金管理人于 2026 年 6 月 27 日发布公告，王苏龙先生自 2026 年 6 月 26 日起担任公司董事长，同日起裴长江先生不再担任公司董事长。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	佣金	占当期佣金总量的比例（%）	
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	4	2,253,346,083.40	6.55	306,230.18	6.55	-
广发证券	2	6,623,052,776.23	19.25	900,396.17	19.25	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国联民生	1	-	-	-	-	-
国泰海通	2	8,317,047,473.09	24.17	1,130,312.43	24.17	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	1,955,537,032.02	5.68	265,801.69	5.68	-
华泰证券	2	2,494,569,815.02	7.25	339,069.71	7.25	-
华兴证券	1	-	-	-	-	-
汇丰前海	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	3	448,534,106.81	1.30	60,972.26	1.30	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	1,581,377,225.55	4.60	214,931.50	4.60	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	3,828,629,175.99	11.13	520,425.92	11.13	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-

中信证券	3	6,908,578,560.14	20.08	938,902.13	20.07	-

注：我公司对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。本报告期本基金退租券商交易单元：国泰海通（074001）。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例（%）	成交金额	占当期权证成交总额的比例（%）
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	503,055.05	0.76	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国联民生	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	54,237,366.00	82.16	-	-	-	-
华泰证券	10,389,516.05	15.74	-	-	-	-
华兴证券	-	-	-	-	-	-
汇丰前海	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	883,531.97	1.34	-	-	-	-

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高级管理人员变更的公告	规定披露媒介	2026 年 06 月 27 日

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

注：本基金本报告期无单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，经基金管理人董事会第七届十四次会议审议通过，王苏龙先生自2026年6月26日起担任公司董事长，同日起裴长江先生不再担任公司董事长。具体可参见基金管理人于2026年6月27日发布的《富国基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

§12 备查文件目录

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