

富国中证高端制造指数增强型证券投资基金（LOF）

二〇二五年中期报告

2025 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： 中国建设银行股份有限公司

送出日期： 2025 年 08 月 30 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，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 28 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 2025 年 1 月 1 日起至 2025 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	6
2.1	基金基本情况.....	6
2.2	基金产品说明.....	6
2.3	基金管理人和基金托管人.....	7
2.4	信息披露方式.....	7
2.5	其他相关资料.....	7
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	8
3.1	主要会计数据和财务指标.....	8
3.2	基金净值表现.....	9
§ 4	管理人报告	12
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	15
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	16
§ 5	托管人报告	17
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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	17
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.....	17
§ 6	中期财务报告（未经审计）	18
6.1	资产负债表.....	18
6.2	利润表.....	19
6.3	净资产变动表.....	20
6.4	报表附注.....	21
§ 7	投资组合报告	48

7.1	期末基金资产组合情况.....	48
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	48
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细.....	49
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	64
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	65
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.....	66
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..	66
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..	66
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.....	66
7.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	66
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	66
7.12	投资组合报告附注.....	67
§ 8	基金份额持有人信息	69
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	69
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	69
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	69
8.4	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的情况.....	69
§ 9	开放式基金份额变动	71
§ 10	重大事件揭示.....	72
10.1	基金份额持有人大会决议.....	72
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.....	72
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	72
10.4	基金投资策略的改变.....	72
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	72
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	72
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	72
10.8	其他重大事件.....	76
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息.....	77
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	77
11.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	77
§ 12	备查文件目录.....	78

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国中证高端制造指数增强型证券投资基金（LOF）	
基金简称	富国中证高端制造指数增强型（LOF）	
场内简称	高端制造 LOF	
基金主代码	161037	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 04 月 27 日	
基金管理人	富国基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	66,469,366.76 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	2017 年 5 月 11 日	
下属分级基金的基金简称	富国中证高端制造指数增强型（LOF）A	富国中证高端制造指数增强型（LOF）C
下属分级基金场内简称	高端制造 LOF	—
下属分级基金的交易代码	161037	005627
报告期末下属分级基金的份额总额	56,765,604.29 份	9,703,762.47 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，在力求对中证高端制造主题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”，主要策略为优化复制目标指数，即投资组合将以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权重优化，进行一定比例的超配或低配，严格控制组合跟踪误差，在复制目标指数的基础上一定程度优化个股权重，力求投资收益能够跟踪并适度超越目标指数。本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8%。本基金选股范围以指数成份股为主，并包括非成份股中与成份股相关性强、流动性好、基本面信息充足的股票。本基金的股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、金融衍生工具投资策略、参与转融通证券出借业务策略详见法律文件。
业绩比较基准	95%×中证高端制造主题指数收益率+5%×银行人民币活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于较高预期收益和预期风险水平的投资品种。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	王小飞
	联系电话	021-20361818	021-6063 7103
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		95105686、4008880688	021-60637228
传真		021-20361616	021-60635778
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	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		裴长江	张金良

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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金中期报告备置地点	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 中国建设银行股份有限公司 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

(1) 富国中证高端制造指数增强型 (LOF) A

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025年01月01日至2025年06月30日)
本期已实现收益	6,708,268.12
本期利润	6,125,496.90
加权平均基金份额本期利润	0.1009
本期加权平均净值利润率	5.87%
本期基金份额净值增长率	6.16%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025年06月30日)
期末可供分配利润	33,188,238.14
期末可供分配基金份额利润	0.5847
期末基金资产净值	102,162,267.73
期末基金份额净值	1.7997
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025年06月30日)
基金份额累计净值增长率	79.97%

(2) 富国中证高端制造指数增强型 (LOF) C

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025年01月01日至2025年06月30日)
本期已实现收益	1,312,953.74
本期利润	1,194,241.49
加权平均基金份额本期利润	0.1071
本期加权平均净值利润率	6.24%
本期基金份额净值增长率	6.06%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025年06月30日)
期末可供分配利润	5,562,746.66
期末可供分配基金份额利润	0.5733
期末基金资产净值	17,343,370.07
期末基金份额净值	1.7873
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025年06月30日)
基金份额累计净值增长率	-14.41%

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) 富国中证高端制造指数增强型（LOF）A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	5.37%	0.79%	4.76%	0.77%	0.61%	0.02%
过去三个月	2.58%	1.61%	0.47%	1.51%	2.11%	0.10%
过去六个月	6.16%	1.43%	1.52%	1.42%	4.64%	0.01%
过去一年	21.78%	1.76%	19.60%	1.82%	2.18%	-0.06%
过去三年	-14.08%	1.42%	-16.62%	1.43%	2.54%	-0.01%
自基金合同生效起至今	79.97%	1.48%	12.30%	1.47%	67.67%	0.01%

(2) 富国中证高端制造指数增强型（LOF）C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	5.35%	0.79%	4.76%	0.77%	0.59%	0.02%
过去三个月	2.53%	1.61%	0.47%	1.51%	2.06%	0.10%
过去六个月	6.06%	1.43%	1.52%	1.42%	4.54%	0.01%
过去一年	21.54%	1.76%	19.60%	1.82%	1.94%	-0.06%
过去三年	-14.59%	1.43%	-16.62%	1.43%	2.03%	0.00%
自基金分级生效日起至今	-14.41%	1.49%	-20.25%	1.50%	5.84%	-0.01%

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) 自基金合同生效以来富国中证高端制造指数增强型（LOF）A 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2025 年 6 月 30 日。

2、本基金于 2017 年 4 月 27 日成立，建仓期 6 个月，从 2017 年 4 月 27 日起至 2017 年 10 月 26 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

(2) 自基金合同生效以来富国中证高端制造指数增强型（LOF）C 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2025 年 6 月 30 日。

2、本基金自 2022 年 1 月 25 日起增加 C 类份额，相关数据按实际存续期计算。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

经中国证监会于 2025 年 1 月 17 日批复核准，国泰君安证券股份有限公司（以下简称“国泰君安”）吸收合并海通证券股份有限公司（以下简称“海通证券”）。自本次吸收合并交割日（即 2025 年 3 月 14 日）起，合并后的国泰君安（以下简称“存续公司”）承继及承接海通证券的全部资产、负债、业务、人员、合同、资质及其他一切权利与义务，海通证券所持本公司股权亦归属于存续公司，即存续公司成为本公司的主要股东。根据 2025 年 4 月 4 日《国泰海通证券股份有限公司关于完成公司名称变更、注册资本变更、公司章程修订及相应市场主体变更登记的公告》，存续公司正式更名为“国泰海通证券股份有限公司”。

截至 2025 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 391 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		
牛志冬	本基金现任基金经理	2017-07-25	—	18	硕士，曾任华夏基金管理有限公司研究员；自 2010 年 8 月加入富国基金管理有限公司，历任量化投资基金经理助理、投资经理、量化与海外投资部量化投资总监助理兼基金经理、定量基金经理、量化投资部量化投资副总监；现任富国基金量化投资部量化投资副总监兼高级定量基金经理。自 2015 年 05 月起任富国中证新能源汽车指数型证券投资基金(原富国中证新能源汽车指数分级证券投资基金)基金经理；自 2015 年 05 月起任富国中证移动互联网指数型证券投资基金(原富国中证移动互联网指数分级证券投资基金)基金经理；自 2016 年 11 月起任富国中证医药主题指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理；自 2017 年 03 月起任富国中证娱乐主题指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理；自 2017 年 07 月起任富国中证高端制造指数增强型证券投资基金(LOF)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 2022 年 01 月起任富国中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2022 年 12 月起任富国中证全指家用电器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 2023 年 03 月起任富国创业板增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2023 年 03 月起任富国中证大数据产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

					2024 年 07 月起任富国创业板增强策略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；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高端制造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》、《富国中证高端制造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

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和相关法规要求，制定了《证券投资公平交易管理办法》，保证公司旗下不同投资组合在系统控制、日常操作层面享有公平的交易机会，并保持各投资组合的独立投资决策权。

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 8 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说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2025 年初，外部关税担忧给全球风险资产带来扰动，市场迎来快速调整。春节后，国内大模型的出现，缩小了市场对于中美 AI 发展前景的认知差异，市场以 AI 为核心开启了新一轮上行，内外资共振流入重估中国资产。随着两会积极的政策定调、以及一系列更加聚焦需求侧、民生侧的政策密集落地，市场由前期 AI 板块的“一枝独秀”，逐步扩散至消费、金融、周期等低位顺周期板块。4 月初，由于美国对全球加征不合理关税，中国随后进行反制，中美关税摩擦逐步升级，中美进入“不可贸易”状态。美国滥施关税给全球资本市场带来大规模冲击。4 月 8 日，中央汇金发布公告，通过增持 ETF 进入市场，同时中央部门、地方政府与上市公司合力维护市场稳定，指数稳步上行。国内方面，5 月 7 日国内推出一揽子金融支持政策，包含全面降准降息、维护股市楼市。海外方面，中美在关税问题上达成共识，缓解贸易摩擦，该阶段市场普涨。5 月中旬起，由于海外关税存在反复，美债及日债拍卖利率跳升，对全球市场流动性存在扰动，同时伊朗与以色列冲突加剧全球避险情绪，市场整体振幅加大。6 月下旬，随着伊朗与以色列阶段性停火，鲍威尔表态偏鸽、美联储 7 月降息的可能性提升，市场开始反弹。

总体来看，2025 年上半年上证综指上涨 2.76%，沪深 300 上涨 0.03%，创业板指上涨 0.53%，中证 500 指数上涨 3.31%。

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 2025 年 6 月 30 日，本基金份额净值富国中证高端制造指数增强型(LOF) A 为 1.7997 元，富国中证高端制造指数增强型(LOF) C 为 1.7873 元；份额累计净值富国中证高端制造指数增强型(LOF) A 为 1.7997 元，富国中证高端制造指数增强型(LOF) C 为 1.7873 元；本报告期，本基金份额净值增长率情况：富国中证高端制造指数增强型(LOF) A 为 6.16%，富国中证高端制造指数增强型(LOF) C 为 6.06%；同期业绩比较基准收益率情况：富国中证高端制造指数增强型(LOF) A 为 1.52%，富国中证高端制造指数增强型(LOF) C 为 1.52%。

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，市场逐步向好的条件在持续累积。随着稳定资本市场政策逐步深入人心，市场对于阶段性宏观数据扰动有所免疫，风险偏好有望提升。伴随着反内卷政策的出台，市场对于短期可能存在的需求回落担忧也有望缓解，着眼未来，在减少资本开支的大背景下，上游周期和中游制造产能过剩情况均有望持续好转，企业盈利有望逐步改善。与此同时，在中美谈判持续推进和国内外 AI 模型持续发展的背景下，科技也有望进一步打开估值空间。

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查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。

§ 6 中期财务报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：富国中证高端制造指数增强型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：		
货币资金	7,038,944.98	7,982,564.42
结算备付金	313,062.10	226,764.62
存出保证金	13,249.03	15,316.90
交易性金融资产	112,710,484.45	119,260,050.05
其中：股票投资	112,689,333.52	119,260,050.05
基金投资	—	—
债券投资	21,150.93	—
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	1,954,133.48	—
应收股利	—	—
应收申购款	15,372.40	68,475.31
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	122,045,246.44	127,553,171.30
负债和净资产	本期末	上年度末
	2025 年 06 月 30 日	2024 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付清算款	1,326,629.35	1,653.19
应付赎回款	937,458.96	640,224.82
应付管理人报酬	116,528.90	131,881.83
应付托管费	19,421.48	21,980.28
应付销售服务费	2,780.08	2,720.06
应付投资顾问费	—	—
应交税费	—	—
应付利润	—	—

递延所得税负债	—	—
其他负债	136,789.87	198,557.90
负债合计	2,539,608.64	997,018.08
净资产：		
实收基金	66,469,366.76	74,709,983.60
其他综合收益	—	—
未分配利润	53,036,271.04	51,846,169.62
净资产合计	119,505,637.80	126,556,153.22
负债和净资产总计	122,045,246.44	127,553,171.30

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.7979 元，基金份额总额 66,469,366.76 份。其中：富国中证高端制造指数增强型（LOF）A 份额净值 1.7997 元，份额总额 56,765,604.29 份；富国中证高端制造指数增强型（LOF）C 份额净值 1.7873 元，份额总额 9,703,762.47 份。

6.2 利润表

会计主体：富国中证高端制造指数增强型证券投资基金（LOF）

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 （2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）	上年度可比期间 （2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日）
一、营业总收入	8,276,057.20	-682,307.70
1. 利息收入	14,209.54	13,140.28
其中：存款利息收入	14,209.54	13,140.28
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）	8,923,891.93	-2,510,787.53
其中：股票投资收益	7,937,874.62	-3,408,460.52
基金投资收益	—	—
债券投资收益	1,076.51	225.15
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	984,940.80	897,447.84
以摊余成本计量的金融资产终止 确认产生的收益	—	—
其他投资收益	—	—

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-701,483.47	1,781,876.99
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	39,439.20	33,462.56
减：二、营业总支出	956,318.81	885,229.99
1. 管理人报酬	733,057.55	617,669.63
2. 托管费	122,176.24	102,944.93
3. 销售服务费	18,642.10	5,409.67
4. 投资顾问费	—	—
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 信用减值损失	—	—
7. 税金及附加	—	—
8. 其他费用	82,442.92	159,205.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	7,319,738.39	-1,567,537.69
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	7,319,738.39	-1,567,537.69
五、其他综合收益的税后净额	—	—
六、综合收益总额	7,319,738.39	-1,567,537.69

6.3 净资产变动表

会计主体：富国中证高端制造指数增强型证券投资基金（LOF）

本报告期：2025年01月01日至2025年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 (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	74,709,983.60	51,846,169.62	126,556,153.22
二、本期期初净资产	74,709,983.60	51,846,169.62	126,556,153.22
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-8,240,616.84	1,190,101.42	-7,050,515.42
（一）、综合收益总额	—	7,319,738.39	7,319,738.39
（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）	-8,240,616.84	-6,129,636.97	—
其中：1. 基金申购款	16,390,876.17	11,814,276.94	28,205,153.11
2. 基金赎回款	—	—	—
	24,631,493.01	17,943,913.91	42,575,406.92
（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)、其他综合收益结转留存收益	—	—	—
四、本期期末净资产	66,469,366.76	53,036,271.04	119,505,637.80
项目	上年度可比期间 (2024年01月01日至2024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	67,100,936.26	33,511,161.24	100,612,097.50
二、本期期初净资产	67,100,936.26	33,511,161.24	100,612,097.50
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	6,170,935.43	1,442,969.06	7,613,904.49
(一)、综合收益总额	—	-1,567,537.69	-1,567,537.69
(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)	6,170,935.43	3,010,506.75	9,181,442.18
其中: 1. 基金申购款	21,455,250.97	10,169,967.80	31,625,218.77
2. 基金赎回款	— 15,284,315.54	-7,159,461.05	— 22,443,776.59
(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)、其他综合收益结转留存收益	—	—	—
四、本期期末净资产	73,271,871.69	34,954,130.30	108,226,001.99

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

富国中证高端制造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[2016]2731号《关于准予富国中证高端制造指数增强型证券投资基金(LOF)注册的批复》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2017年4月27日生效,首次设立募集规模为281,495,289.54份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。根据基金管理人于2022年1月21日发布

的《富国基金管理有限公司关于旗下部分基金投资范围增加存托凭证、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 2022 年 1 月 25 日起，本基金增加 C 类份额。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，A 类基金份额的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，C 类基金份额的注册登记机构为富国基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证高端制造主题指数的成份股、备选成份股（均含存托凭证）、其他股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票，包括一级市场首次发行或增发）、存托凭证、固定收益资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、公募可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、质押及买断式回购、银行存款（包括银行定期存款、银行协议存款、银行通知存款等）、衍生工具（股指期货、权证等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金将按照法律法规相关规定参与融资与转融通证券出借业务。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金的股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中证高端制造主题指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的资产不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证高端制造主题指数收益率} + 5\% \times \text{银行人民币活期存款利率（税后）}$ 。

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颁布的《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》、《证券投资基金信

息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《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》、《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颁布的其他相关规定。

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2025年6月30日的财务状况以及2025年1月1日至2025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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳

增值税。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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人作为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

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 (2025 年 06 月 30 日)
活期存款	7,038,944.98
等于：本金	7,038,294.41
加：应计利息	650.57
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	7,038,944.98

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（2025 年 06 月 30 日）			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		107,421,058.94	—	112,689,333.52	5,268,274.58
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	13,800.00	1.35	21,150.93	7,349.58
	银行间市场	—	—	—	—
	合计	13,800.00	1.35	21,150.93	7,349.58
资产支持证券		—	—	—	—
基金		—	—	—	—
其他		—	—	—	—
合计		107,434,858.94	1.35	112,710,484.45	5,275,624.16

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（2025年06月30日）
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	3,127.57
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	34,817.33
其中：交易所市场	34,817.33
银行间市场	—
应付利息	—
预提信息披露费	60,000.00
预提审计费	34,364.21
应付指数使用费	4,480.76
合计	136,789.87

6.4.7.7 实收基金

富国中证高端制造指数增强型（LOF）A：

金额单位：人民币元

项目	本期（2025年01月01日至2025年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	65,273,902.82	65,273,902.82
本期申购	8,585,905.28	8,585,905.28
本期赎回（以“-”号填列）	-17,094,203.81	-17,094,203.81
本期末	56,765,604.29	56,765,604.29

富国中证高端制造指数增强型（LOF）C：

金额单位：人民币元

项目	本期（2025年01月01日至2025年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	9,436,080.78	9,436,080.78
本期申购	7,804,970.89	7,804,970.89
本期赎回（以“-”号填列）	-7,537,289.20	-7,537,289.20
本期末	9,703,762.47	9,703,762.47

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

富国中证高端制造指数增强型（LOF）A：

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

上年度末	30,947,904.83	14,432,820.67	45,380,725.50
本期期初	30,947,904.83	14,432,820.67	45,380,725.50
本期利润	6,708,268.12	-582,771.22	6,125,496.90
本期基金份额交易产生的变动数	-4,467,934.81	-1,641,624.15	-6,109,558.96
其中：基金申购款	4,522,057.41	1,678,095.17	6,200,152.58
基金赎回款	-8,989,992.22	-3,319,719.32	-12,309,711.54
本期已分配利润	—	—	—
本期末	33,188,238.14	12,208,425.30	45,396,663.44

富国中证高端制造指数增强型（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	4,388,920.45	2,076,523.67	6,465,444.12
本期期初	4,388,920.45	2,076,523.67	6,465,444.12
本期利润	1,312,953.74	-118,712.25	1,194,241.49
本期基金份额交易产生的变动数	-139,127.53	119,049.52	-20,078.01
其中：基金申购款	3,887,687.57	1,726,436.79	5,614,124.36
基金赎回款	-4,026,815.10	-1,607,387.27	-5,634,202.37
本期已分配利润	—	—	—
本期末	5,562,746.66	2,076,860.94	7,639,607.60

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2025年01月01日至2025年06月30日）
活期存款利息收入	13,215.05
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	526.95
其他	467.54
合计	14,209.54

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2025年01月01日至2025年06月30日）
卖出股票成交总额	264,642,539.14
减：卖出股票成本总额	256,469,371.00
减：交易费用	235,293.52
买卖股票差价收入	7,937,874.62

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（2025年01月01日至2025年06月30日）
债券投资收益——利息收入	2.06
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,074.45
合计	1,076.51

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（2025年01月01日至2025年06月30日）
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	8,475.50
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	7,400.00
减：应计利息总额	0.71
减：交易费用	0.34
买卖债券差价收入	1,074.45

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（2025年01月01日至2025年06月30日）
股票投资产生的股利收益	984,940.80
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	984,940.80

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2025年01月01日至2025年06月30日）
1. 交易性金融资产	-701,483.47
股票投资	-708,833.05
债券投资	7,349.58
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	-701,483.47

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2025年01月01日至2025年06月30日）
基金赎回费收入	38,556.20
基金转换费收入	883.00

合计	39,439.20
----	-----------

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（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）
审计费用	16,364.21
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	1,597.95
指数使用费	4,480.76
合计	82,442.92

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

经中国证监会于 2025 年 1 月 17 日批复核准，国泰君安证券股份有限公司吸收合并海通证券股份有限公司。自本次吸收合并交割日（即 2025 年 3 月 14 日）起，合并后的国泰海通证券股份有限公司（由国泰君安证券股份有限公司于 2025 年 4 月变更名称而来，以下简称“国泰海通”）承继及承接海通证券股份有限公司的全部资产、负债、业务、人员、合同、资质及其他一切权利与义务，海通证券所持本公司股权亦归属于国泰海通，即国泰海通成为本公司的主要股东。变更后，本公司的股东为国泰海通证券股份有限公司，出资比例为 27.775%；申万宏源证券有限公司，出资比例为 27.775%；加拿大蒙特利尔银行，出资比例为 27.775%；山东省金融资产管理股份有限公司，出资比例为 16.675%。

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
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。关联方国泰海通证券有限公司（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。

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（2025年01月01日至2025年06月30日）		上年度可比期间（2024年01月01日至2024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	23,206,400.65	4.51	—	—
海通证券	—	—	23,256,819.94	5.37
申万宏源	54,934,115.00	10.67	20,319,141.42	4.69

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2025年01月01日至2025年06月30日）	上年度可比期间（2024年01月01日至2024年06月30日）
-------	-----------------------------	----------------------------------

	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
申万宏源	8,475.50	100.00	—	—

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元				
关联方名称	本期（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	3,153.42	4.51	3,153.42	9.06
申万宏源	7,465.60	10.67	4,416.36	12.68
关联方名称	上年度可比期间（2024年01月01日至2024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 (%)
海通证券	17,114.79	5.37	11,567.85	7.45
申万宏源	14,952.68	4.69	9,667.49	6.23

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（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）	上年度可比期间（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日）
当期发生的基金应支付的管理费	733,057.55	617,669.63
其中：应支付销售机构的客户维护费	249,310.51	216,207.45
应支付基金管理人的净管理费	483,747.04	401,462.18

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.20%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times 1.20\%/当年天数$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）	上年度可比期间（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日）
当期发生的基金应支付的托管费	122,176.24	102,944.93

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期（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		
	富国中证高端制造指数增强型（LOF）A	富国中证高端制造指数增强型（LOF）C	合计
富国基金管理有限公司	—	2,041.42	2,041.42
合计	—	2,041.42	2,041.42

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（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日）		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富国中证高端制造指数增强型（LOF）A	富国中证高端制造指数增强型（LOF）C	合计
富国基金管理有限公司	—	782.77	782.77
合计	—	782.77	782.77

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

在通常情况下，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净

值的 0.20%年费率计提。销售服务费计算方法如下：

$$H=E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

C 类基金份额的销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，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

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（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日）		上年度可比期间（2024 年 01 月 01 日至 2024 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
中国建设银行股份有限公司	7,038,944.98	13,215.05	6,204,082.93	10,879.71

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（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	3,087	36,426.60
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	717	30,042.30
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	3,055	36,049.00
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	768	25,390.08

注：本基金上年度可比期间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：本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2025 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
001335	信凯科技	2025-04-02	6 个月	新股限售	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	—
001356	富岭股份	2025-01-16	6 个月	新股限售	5.30	14.44	336	1,780.80	4,851.84	—
001382	新亚电缆	2025-03-13	6 个月	新股限售	7.40	20.21	275	2,035.00	5,557.75	—
001395	亚联机械	2025-01-20	6 个月	新股限售	19.08	47.25	80	1,526.40	3,780.00	—
301173	毓恬冠佳	2025-02-24	6 个月	新股限售	28.33	44.98	110	3,116.30	4,947.80	—
301275	汉朔科技	2025-03-04	6 个月	新股限售	27.50	56.19	109	2,997.50	6,124.71	—
301458	钧崴电子	2025-01-02	6 个月	新股限售	10.40	34.11	386	4,014.40	13,166.46	—
301479	弘景光电	2025-03-06	6 个月	新股限售	41.90	77.87	101	3,016.80	7,864.87	—
301501	恒鑫生活	2025-03-11	6 个月	新股限售	39.92	45.22	112	3,073.84	5,064.64	—
301560	众捷汽车	2025-04-17	6 个月	新股限售	16.50	27.45	123	2,029.50	3,376.35	—
301601	惠通科技	2025-01-08	6 个月	新股限售	11.80	33.85	306	3,610.80	10,358.10	—
301602	超研股份	2025-01-15	6 个月	新股限售	6.70	24.80	514	3,443.80	12,747.20	—
301636	泽润新能	2025-04-30	6 个月	新股限售	33.06	47.46	77	2,545.62	3,654.42	—
301658	首航新能	2025-03-26	6 个月	新股限售	11.80	22.98	309	3,646.20	7,100.82	—
301662	宏工科技	2025-04-10	6 个月	新股限售	26.60	82.50	110	2,926.00	9,075.00	—
301665	泰禾股份	2025-04-02	6 个月	新股限售	10.27	22.39	300	3,081.00	6,717.00	—

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
123257	安克转债	2025-06-16	1 个月内	认购新发	100.	100.01	81	8,100.00	8,100.53	—

			(含)	证券	00					
--	--	--	-----	----	----	--	--	--	--	--

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
688313	仕佳光子	2025 年 06 月 30 日	重大事项停牌	38.05	2025 年 07 月 11 日	39.98	14,157.00	265,342.93	538,673.85	—

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 2025 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 2025 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（2025 年 06 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
AAA	—	—
AAA 以下	21,150.93	—
未评级	—	—
合计	21,150.93	—

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

下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。

单位：人民币元

本期末（2025 年 06 月 30 日）	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	7,038,944.98	—	—	—	—	—	7,038,944.98
结算备付金	313,062.10	—	—	—	—	—	313,062.10
存出保证金	13,249.03	—	—	—	—	—	13,249.03
交易性金融资产	—	—	21,150.93	—	—	112,689,333.52	112,710,484.45
应收清算款	—	—	—	—	—	1,954,133.48	1,954,133.48
应收申购款	—	—	—	—	—	15,372.40	15,372.40
资产总计	7,365,256.11	—	21,150.93	—	—	114,658,839.40	122,045,246.44
负债							
应付清算款	—	—	—	—	—	1,326,629.35	1,326,629.35
应付赎回款	—	—	—	—	—	937,458.96	937,458.96
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	116,528.90	116,528.90
应付托管费	—	—	—	—	—	19,421.48	19,421.48
应付销售服务费	—	—	—	—	—	2,780.08	2,780.08
其他负债	—	—	—	—	—	136,789.87	136,789.87
负债总计	—	—	—	—	—	2,539,608.64	2,539,608.64
利率敏感度缺口	7,365,256.11	—	21,150.93	—	—	112,119,230.76	119,505,637.80
上年度末（2024 年 12 月 31 日）	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	7,982,564.42	—	—	—	—	—	7,982,564.42

结算备付金	226,764.62	—	—	—	—	—	226,764.62
存出保证金	15,316.90	—	—	—	—	—	15,316.90
交易性金融资产	—	—	—	—	—	119,260,050.05	119,260,050.05
应收申购款	900.00	—	—	—	—	67,575.31	68,475.31
资产总计	8,225,545.94	—	—	—	—	119,327,625.36	127,553,171.30
负债							
应付清算款	—	—	—	—	—	1,653.19	1,653.19
应付赎回款	—	—	—	—	—	640,224.82	640,224.82
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	131,881.83	131,881.83
应付托管费	—	—	—	—	—	21,980.28	21,980.28
应付销售服务费	—	—	—	—	—	2,720.06	2,720.06
其他负债	—	—	—	—	—	198,557.90	198,557.90
负债总计	—	—	—	—	—	997,018.08	997,018.08
利率敏感度缺口	8,225,545.94	—	—	—	—	118,330,607.28	126,556,153.22

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证高端制造主题指数的成份股、备选成份股（均含存托凭证）、其他股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票，包括一级市场首次发行或增发）、存托凭证、固定收益资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、公募可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、质押及买断式回购、银行存款（包括银行定期存款、银行协议存款、银行通知存款等）、衍生工具（股指期货、权证等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金将按照法律法规相关规定参与融资与转融通证券出借业务。

基金的投资组合比例为：本基金的股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中证高端制造主题指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的资产不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末 (2025 年 06 月 30 日)		上年度末 (2024 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	112,689,333.52	94.30	119,260,050.05	94.23
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	21,150.93	0.02	—	—
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	112,710,484.45	94.31	119,260,050.05	94.23

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。下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。

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 (2025 年 06 月 30 日)	上年度末 (2024 年 12 月 31 日)
	1. 业绩比较基准增加 1%	1,180,096.99	1,222,363.83
	2. 业绩比较基准减少 1%	-1,180,096.99	-1,222,363.83

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 (2025 年 06 月 30 日)	上年度末 (2024 年 12 月 31 日)
第一层次	112,057,079.11	118,684,667.21
第二层次	546,774.38	511,024.00
第三层次	106,630.96	64,358.84
合计	112,710,484.45	119,260,050.05

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	112,689,333.52	92.33
	其中：股票	112,689,333.52	92.33
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	21,150.93	0.02
	其中：债券	21,150.93	0.02
	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	7,352,007.08	6.02
8	其他各项资产	1,982,754.91	1.62
9	合计	122,045,246.44	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 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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	92,979,871.28	77.80
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	768,596.00	0.64
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	3,145,993.42	2.63
J	金融业	241,230.00	0.20
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	2,450,260.90	2.05
N	水利、环境和公共设施管理业	691,103.00	0.58
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	11,424.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	100,288,478.60	83.92

7.2.1.2 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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	11,650,117.88	9.75
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	2,244.00	0.00
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	567,359.97	0.47
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	166,233.07	0.14
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	14,900.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	12,400,854.92	10.38

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	20,320	5,125,110.40	4.29
2	603259	药明康德	33,680	2,342,444.00	1.96
3	600276	恒瑞医药	44,100	2,288,790.00	1.92

4	000725	京东方 A	527, 200	2, 103, 528. 00	1. 76
5	688008	澜起科技	21, 677	1, 777, 514. 00	1. 49
6	002594	比亚迪	5, 000	1, 659, 550. 00	1. 39
7	000100	TCL 科技	378, 400	1, 638, 472. 00	1. 37
8	002475	立讯精密	46, 173	1, 601, 741. 37	1. 34
9	000063	中兴通讯	46, 500	1, 510, 785. 00	1. 26
10	600482	中国动力	63, 500	1, 464, 945. 00	1. 23
11	600660	福耀玻璃	24, 200	1, 379, 642. 00	1. 15
12	002595	豪迈科技	20, 300	1, 202, 166. 00	1. 01
13	300274	阳光电源	16, 588	1, 124, 168. 76	0. 94
14	300502	新易盛	8, 720	1, 107, 614. 40	0. 93
15	000977	浪潮信息	21, 500	1, 093, 920. 00	0. 92
16	688469	芯联集成	226, 452	1, 080, 176. 04	0. 90
17	000988	华工科技	22, 300	1, 048, 323. 00	0. 88
18	601717	中创智领	61, 920	1, 029, 110. 40	0. 86
19	688256	寒武纪	1, 703	1, 024, 354. 50	0. 86
20	002600	领益智造	113, 500	974, 965. 00	0. 82
21	002371	北方华创	2, 200	972, 862. 00	0. 81
22	300476	胜宏科技	6, 900	927, 222. 00	0. 78
23	601989	中国重工	193, 200	896, 448. 00	0. 75
24	688029	南微医学	13, 126	886, 661. 30	0. 74
25	688981	中芯国际	9, 905	873, 323. 85	0. 73
26	688041	海光信息	6, 121	864, 836. 09	0. 72
27	002001	新 和 成	39, 880	848, 247. 60	0. 71
28	600066	宇通客车	34, 100	847, 726. 00	0. 71
29	600406	国电南瑞	37, 100	831, 411. 00	0. 70
30	600875	东方电气	48, 000	803, 520. 00	0. 67
31	603893	瑞芯微	5, 200	789, 672. 00	0. 66
32	002444	巨星科技	30, 700	783, 157. 00	0. 66
33	688235	百济神州	3, 195	746, 479. 80	0. 62
34	002463	沪电股份	16, 500	702, 570. 00	0. 59
35	002850	科达利	6, 200	701, 654. 00	0. 59
36	603699	纽威股份	22, 200	691, 974. 00	0. 58
37	600031	三一重工	37, 500	673, 125. 00	0. 56
38	002202	金风科技	65, 600	672, 400. 00	0. 56
39	601138	工业富联	31, 400	671, 332. 00	0. 56
40	601877	正泰电器	29, 400	666, 498. 00	0. 56
41	600582	天地科技	109, 300	654, 707. 00	0. 55
42	600703	三安光电	52, 500	652, 050. 00	0. 55
43	600741	华域汽车	36, 900	651, 285. 00	0. 54
44	000963	华东医药	16, 100	649, 796. 00	0. 54

45	300014	亿纬锂能	13,800	632,178.00	0.53
46	688578	艾力斯	6,648	618,529.92	0.52
47	300888	稳健医疗	15,000	616,500.00	0.52
48	300207	欣旺达	30,700	615,842.00	0.52
49	300001	特锐德	25,614	613,967.58	0.51
50	688608	恒玄科技	1,761	612,792.78	0.51
51	002028	思源电气	8,300	605,153.00	0.51
52	688114	华大智造	9,204	596,695.32	0.50
53	301291	明阳电气	14,500	596,675.00	0.50
54	301033	迈普医学	9,900	594,594.00	0.50
55	603678	火炬电子	15,550	591,366.50	0.49
56	601567	三星医疗	26,100	585,162.00	0.49
57	002414	高德红外	57,000	584,250.00	0.49
58	600760	中航沈飞	9,940	582,682.80	0.49
59	600104	上汽集团	36,100	579,405.00	0.48
60	688082	盛美上海	5,061	576,650.34	0.48
61	601033	永兴股份	35,800	565,998.00	0.47
62	605117	德业股份	10,740	565,568.40	0.47
63	688768	容知日新	12,679	562,820.81	0.47
64	601127	赛力斯	4,100	550,712.00	0.46
65	000528	柳工	56,300	541,043.00	0.45
66	600487	亨通光电	35,300	540,090.00	0.45
67	688313	仕佳光子	14,157	538,673.85	0.45
68	688336	三生国健	9,931	538,657.44	0.45
69	688188	柏楚电子	4,075	536,514.50	0.45
70	300590	移为通信	40,900	532,109.00	0.45
71	300772	运达股份	41,200	530,656.00	0.44
72	002223	鱼跃医疗	14,900	530,440.00	0.44
73	600089	特变电工	42,341	505,128.13	0.42
74	300433	蓝思科技	22,100	492,830.00	0.41
75	603267	鸿远电子	9,800	492,646.00	0.41
76	002252	上海莱士	71,700	492,579.00	0.41
77	600100	同方股份	67,500	488,700.00	0.41
78	002011	盾安环境	42,100	488,360.00	0.41
79	600150	中国船舶	14,600	475,084.00	0.40
80	002241	歌尔股份	20,200	471,064.00	0.39
81	603707	健友股份	42,100	469,415.00	0.39
82	300558	贝达药业	7,900	457,805.00	0.38
83	688322	奥比中光	7,710	454,967.10	0.38
84	688278	特宝生物	6,260	451,408.60	0.38
85	688208	道通科技	14,681	449,238.60	0.38

86	600893	航发动力	11,600	447,064.00	0.37
87	601766	中国中车	63,000	443,520.00	0.37
88	688728	格科微	28,730	442,442.00	0.37
89	002487	大金重工	13,200	434,280.00	0.36
90	603501	豪威集团	3,400	434,010.00	0.36
91	002913	奥士康	14,600	429,386.00	0.36
92	300926	博俊科技	16,200	428,814.00	0.36
93	688636	智明达	12,605	425,922.95	0.36
94	300866	安克创新	3,700	420,320.00	0.35
95	001301	尚太科技	8,500	414,460.00	0.35
96	000338	潍柴动力	26,800	412,184.00	0.34
97	600460	士兰微	16,600	412,012.00	0.34
98	688286	敏芯股份	5,667	400,600.23	0.34
99	603005	晶方科技	14,100	400,299.00	0.33
100	002284	亚太股份	36,100	398,905.00	0.33
101	300573	兴齐眼药	7,696	398,575.84	0.33
102	002970	锐明技术	7,900	390,260.00	0.33
103	600587	新华医疗	25,700	389,098.00	0.33
104	688027	国盾量子	1,410	387,764.10	0.32
105	000039	中集集团	48,700	382,782.00	0.32
106	002916	深南电路	3,530	380,569.30	0.32
107	000680	山推股份	42,300	379,431.00	0.32
108	300432	富临精工	28,700	375,109.00	0.31
109	688510	航亚科技	15,195	367,415.10	0.31
110	600380	健康元	32,800	361,784.00	0.30
111	002533	金杯电工	36,400	354,536.00	0.30
112	300623	捷捷微电	11,800	351,640.00	0.29
113	300604	长川科技	7,800	350,298.00	0.29
114	000425	徐工机械	44,700	347,319.00	0.29
115	002180	纳思达	15,100	346,394.00	0.29
116	002351	漫步者	26,400	346,368.00	0.29
117	600038	中直股份	8,900	345,409.00	0.29
118	601126	四方股份	21,200	344,924.00	0.29
119	688220	翱捷科技	4,288	335,750.40	0.28
120	600685	中船防务	12,300	334,437.00	0.28
121	688223	晶科能源	63,731	330,763.89	0.28
122	601311	骆驼股份	36,400	328,692.00	0.28
123	688596	正帆科技	9,520	322,918.40	0.27
124	001288	运机集团	15,400	320,782.00	0.27
125	600499	科达制造	32,600	319,480.00	0.27
126	300666	江丰电子	4,300	318,630.00	0.27

127	600316	洪都航空	8,400	316,680.00	0.26
128	600529	山东药玻	14,300	316,602.00	0.26
129	603296	华勤技术	3,900	314,652.00	0.26
130	600418	江淮汽车	7,800	312,702.00	0.26
131	603166	福达股份	19,700	304,759.00	0.26
132	601799	星宇股份	2,300	287,500.00	0.24
133	002139	拓邦股份	20,300	280,343.00	0.23
134	600498	烽火通信	13,300	279,699.00	0.23
135	688766	普冉股份	4,417	279,154.40	0.23
136	688037	芯源微	2,581	276,683.20	0.23
137	688484	南芯科技	6,866	271,550.30	0.23
138	600391	航发科技	9,200	268,640.00	0.22
139	300115	长盈精密	12,400	265,360.00	0.22
140	688120	华海清科	1,569	264,690.30	0.22
141	300296	利亚德	43,200	263,520.00	0.22
142	000768	中航西飞	9,300	254,262.00	0.21
143	688172	燕东微	12,817	251,982.22	0.21
144	002452	长高电新	36,100	250,895.00	0.21
145	688185	康希诺	4,116	245,437.08	0.21
146	001308	康冠科技	10,700	242,034.00	0.20
147	600517	国网英大	47,300	241,230.00	0.20
148	002384	东山精密	6,200	234,174.00	0.20
149	688009	中国通号	44,972	231,156.08	0.19
150	688538	和辉光电	98,176	229,731.84	0.19
151	600584	长电科技	6,800	229,092.00	0.19
152	000050	深天马A	26,500	225,780.00	0.19
153	688522	纳睿雷达	4,227	216,506.94	0.18
154	002340	格林美	32,500	206,375.00	0.17
155	002459	晶澳科技	20,500	204,590.00	0.17
156	300760	迈瑞医疗	900	202,275.00	0.17
157	688819	天能股份	7,279	202,065.04	0.17
158	688563	航材股份	3,494	197,865.22	0.17
159	688025	杰普特	2,741	195,981.50	0.16
160	600312	平高电气	12,600	193,914.00	0.16
161	601179	中国西电	30,400	186,656.00	0.16
162	300308	中际旭创	1,260	183,783.60	0.15
163	688018	乐鑫科技	1,254	183,209.40	0.15
164	688281	华秦科技	3,010	182,135.10	0.15
165	600183	生益科技	6,000	180,900.00	0.15
166	002353	杰瑞股份	5,100	178,500.00	0.15
167	603298	杭叉集团	8,480	177,656.00	0.15

168	688599	天合光能	12,151	176,554.03	0.15
169	002273	水晶光电	8,700	173,739.00	0.15
170	600372	中航机载	14,400	173,664.00	0.15
171	002837	英维克	5,690	169,049.90	0.14
172	603283	赛腾股份	4,980	169,021.20	0.14
173	688525	佰维存储	2,480	167,152.00	0.14
174	688668	鼎通科技	2,668	166,643.28	0.14
175	601369	陕鼓动力	18,600	163,122.00	0.14
176	688582	芯动联科	2,423	162,825.60	0.14
177	603920	世运电路	5,300	161,703.00	0.14
178	300024	机器人	9,400	161,492.00	0.14
179	688347	华虹公司	2,809	154,242.19	0.13
180	688677	海泰新光	3,931	153,348.31	0.13
181	300458	全志科技	3,860	153,203.40	0.13
182	603025	大豪科技	10,700	150,014.00	0.13
183	688368	晶丰明源	1,679	147,466.57	0.12
184	300088	长信科技	24,500	146,020.00	0.12
185	603236	移远通信	1,700	145,860.00	0.12
186	688049	炬芯科技	2,410	145,805.00	0.12
187	002432	九安医疗	4,000	145,720.00	0.12
188	600522	中天科技	10,000	144,600.00	0.12
189	300416	苏试试验	9,900	141,867.00	0.12
190	300679	电连技术	3,100	140,678.00	0.12
191	688213	思特威	1,326	135,543.72	0.11
192	002073	软控股份	15,200	135,128.00	0.11
193	688789	宏华数科	1,809	132,129.36	0.11
194	301031	中熔电气	1,648	131,263.20	0.11
195	002185	华天科技	12,600	127,260.00	0.11
196	600885	宏发股份	5,600	124,936.00	0.10
197	000915	华特达因	3,500	123,725.00	0.10
198	002821	凯莱英	1,400	123,550.00	0.10
199	300627	华测导航	3,520	123,200.00	0.10
200	601689	拓普集团	2,600	122,850.00	0.10
201	600563	法拉电子	1,100	119,999.00	0.10
202	300373	扬杰科技	2,300	119,370.00	0.10
203	002130	沃尔核材	5,000	119,100.00	0.10
204	600161	天坛生物	6,200	118,978.00	0.10
205	600739	辽宁成大	10,800	118,800.00	0.10
206	600166	福田汽车	42,200	114,362.00	0.10
207	688396	华润微	2,383	112,382.28	0.09
208	300661	圣邦股份	1,530	111,338.10	0.09

209	688123	聚辰股份	1,372	111,118.28	0.09
210	301510	固高科技	3,600	108,180.00	0.09
211	688001	华兴源创	4,266	107,801.82	0.09
212	300779	惠城环保	600	107,094.00	0.09
213	600435	北方导航	6,700	104,453.00	0.09
214	688630	芯碁微装	1,310	103,974.70	0.09
215	300223	北京君正	1,500	103,800.00	0.09
216	688702	盛科通信	1,650	100,782.00	0.08
217	688698	伟创电气	2,129	100,488.80	0.08
218	603596	伯特利	1,900	100,111.00	0.08
219	688200	华峰测控	694	100,074.80	0.08
220	300857	协创数据	1,140	98,108.40	0.08
221	688387	信科移动	17,184	97,089.60	0.08
222	688019	安集科技	625	94,875.00	0.08
223	688686	奥普特	985	94,185.70	0.08
224	688017	绿的谐波	738	92,168.82	0.08
225	603009	北特科技	2,200	91,740.00	0.08
226	600577	精达股份	12,300	91,512.00	0.08
227	600323	瀚蓝环境	3,400	82,790.00	0.07
228	002335	科华数据	1,900	81,092.00	0.07
229	300595	欧普康视	5,300	80,931.00	0.07
230	300073	当升科技	1,800	78,966.00	0.07
231	600118	中国卫星	2,700	77,139.00	0.06
232	688002	睿创微纳	1,099	76,622.28	0.06
233	688772	珠海冠宇	5,332	76,194.28	0.06
234	600320	振华重工	17,300	75,601.00	0.06
235	002281	光迅科技	1,500	73,980.00	0.06
236	002472	双环传动	2,200	73,678.00	0.06
237	002938	鹏鼎控股	2,300	73,669.00	0.06
238	300034	钢研高纳	4,400	73,172.00	0.06
239	002138	顺络电子	2,600	73,112.00	0.06
240	002236	大华股份	4,600	73,048.00	0.06
241	688248	南网科技	2,315	72,829.90	0.06
242	688271	联影医疗	554	70,767.96	0.06
243	300657	弘信电子	2,500	69,725.00	0.06
244	002270	华明装备	4,000	66,960.00	0.06
245	300037	新宙邦	1,800	63,360.00	0.05
246	300580	贝斯特	2,547	62,579.79	0.05
247	600867	通化东宝	7,600	62,320.00	0.05
248	600862	中航高科	2,300	59,984.00	0.05
249	688617	惠泰医疗	200	59,400.00	0.05

250	002074	国轩高科	1,800	58,428.00	0.05
251	300681	英搏尔	2,100	58,086.00	0.05
252	688147	微导纳米	1,848	55,772.64	0.05
253	300346	南大光电	1,760	55,686.40	0.05
254	603997	继峰股份	4,100	53,464.00	0.04
255	300620	光库科技	1,100	51,821.00	0.04
256	300969	恒帅股份	760	50,904.80	0.04
257	600480	凌云股份	4,100	49,897.00	0.04
258	300140	节能环保	8,000	49,360.00	0.04
259	300009	安科生物	5,700	47,709.00	0.04
260	603338	浙江鼎力	1,000	47,400.00	0.04
261	000810	创维数字	4,000	47,120.00	0.04
262	601608	中信重工	10,700	46,759.00	0.04
263	600062	华润双鹤	2,400	44,784.00	0.04
264	002085	万丰奥威	2,800	44,492.00	0.04
265	603297	永新光学	500	43,675.00	0.04
266	002484	江海股份	2,100	43,029.00	0.04
267	002249	大洋电机	5,900	38,822.00	0.03
268	000951	中国重汽	2,200	38,676.00	0.03
269	603556	海兴电力	1,400	35,658.00	0.03
270	600765	中航重机	2,100	35,448.00	0.03
271	603019	中科曙光	500	35,200.00	0.03
272	688126	沪硅产业	1,862	34,856.64	0.03
273	301358	湖南裕能	1,100	34,309.00	0.03
274	603530	神马电力	1,311	33,981.12	0.03
275	603809	豪能股份	2,200	33,660.00	0.03
276	603228	景旺电子	800	33,472.00	0.03
277	688352	硕中科技	2,943	33,049.89	0.03
278	603309	维力医疗	2,500	31,800.00	0.03
279	600879	航天电子	3,000	31,410.00	0.03
280	603160	汇顶科技	400	28,412.00	0.02
281	688099	晶晨股份	400	28,404.00	0.02
282	605305	中际联合	1,000	27,780.00	0.02
283	688183	生益电子	539	27,596.80	0.02
284	603087	甘李药业	500	27,390.00	0.02
285	002865	钧达股份	700	27,300.00	0.02
286	688584	上海合晶	1,513	27,052.44	0.02
287	002690	美亚光电	1,600	26,992.00	0.02
288	688005	容百科技	1,188	26,516.16	0.02
289	688475	萤石网络	833	26,256.16	0.02
290	002906	华阳集团	800	26,008.00	0.02

291	000766	通化金马	1,000	25,370.00	0.02
292	688516	奥特维	732	24,331.68	0.02
293	600521	华海药业	1,300	24,219.00	0.02
294	002266	浙富控股	7,500	23,100.00	0.02
295	300474	景嘉微	300	21,900.00	0.02
296	003021	兆威机电	200	21,630.00	0.02
297	003031	中瓷电子	400	21,284.00	0.02
298	600079	人福医药	1,000	20,980.00	0.02
299	301165	锐捷网络	340	20,896.40	0.02
300	002841	视源股份	600	20,760.00	0.02
301	688198	佰仁医疗	200	20,538.00	0.02
302	002156	通富微电	800	20,496.00	0.02
303	300570	太辰光	200	19,276.00	0.02
304	002294	信立泰	400	18,932.00	0.02
305	603859	能科科技	568	18,357.76	0.02
306	301039	中集车辆	2,200	17,886.00	0.01
307	001389	广合科技	300	17,631.00	0.01
308	302132	中航成飞	200	17,588.00	0.01
309	300735	光弘科技	700	17,570.00	0.01
310	300842	帝科股份	400	17,532.00	0.01
311	301308	江波龙	200	17,498.00	0.01
312	002152	广电运通	1,300	17,472.00	0.01
313	300450	先导智能	700	17,395.00	0.01
314	002008	大族激光	700	17,059.00	0.01
315	300672	国科微	200	16,984.00	0.01
316	300833	浩洋股份	500	16,715.00	0.01
317	688007	光峰科技	1,153	16,672.38	0.01
318	301087	可孚医疗	500	16,600.00	0.01
319	002993	奥海科技	400	16,588.00	0.01
320	688697	纽威数控	1,233	16,448.22	0.01
321	601869	长飞光纤	400	16,288.00	0.01
322	600552	凯盛科技	1,400	15,820.00	0.01
323	600562	国睿科技	500	15,745.00	0.01
324	688408	中信博	337	15,731.16	0.01
325	002020	京新药业	1,200	15,660.00	0.01
326	002056	横店东磁	1,100	15,565.00	0.01
327	301606	绿联科技	300	15,429.00	0.01
328	000682	东方电子	1,500	15,360.00	0.01
329	002389	航天彩虹	600	15,360.00	0.01
330	688289	圣湘生物	748	15,319.04	0.01
331	300568	星源材质	1,200	15,216.00	0.01

332	002984	森麒麟	800	15,000.00	0.01
333	688195	腾景科技	333	14,985.00	0.01
334	688297	中无人机	280	14,952.00	0.01
335	300676	华大基因	300	14,931.00	0.01
336	300244	迪安诊断	1,000	14,900.00	0.01
337	300759	康龙化成	600	14,724.00	0.01
338	002179	中航光电	362	14,610.32	0.01
339	688390	固德威	334	14,512.30	0.01
340	002773	康弘药业	500	14,485.00	0.01
341	601058	赛轮轮胎	1,100	14,432.00	0.01
342	600388	龙净环保	1,200	14,400.00	0.01
343	301155	海力风电	200	14,380.00	0.01
344	688520	神州细胞	240	14,364.00	0.01
345	300638	广和通	500	14,315.00	0.01
346	601238	广汽集团	1,900	14,231.00	0.01
347	300130	新国都	400	14,212.00	0.01
348	300100	双林股份	300	14,124.00	0.01
349	601096	宏盛华源	3,400	14,076.00	0.01
350	000625	长安汽车	1,100	14,036.00	0.01
351	688105	诺唯赞	619	14,007.97	0.01
352	300702	天宇股份	600	13,956.00	0.01
353	002881	美格智能	300	13,920.00	0.01
354	300628	亿联网络	400	13,904.00	0.01
355	688375	国博电子	230	13,802.30	0.01
356	601865	福莱特	900	13,689.00	0.01
357	600732	爱旭股份	1,040	13,624.00	0.01
358	605128	上海沿浦	449	13,586.74	0.01
359	301238	瑞泰新材	700	13,454.00	0.01
360	600416	湘电股份	1,000	13,440.00	0.01
361	600438	通威股份	800	13,400.00	0.01
362	300045	华力创通	700	13,363.00	0.01
363	300408	三环集团	400	13,360.00	0.01
364	600601	方正科技	2,500	13,350.00	0.01
365	300390	天华新能	700	13,349.00	0.01
366	000066	中国长城	900	13,320.00	0.01
367	688108	赛诺医疗	1,185	13,295.70	0.01
368	601231	环旭电子	900	13,167.00	0.01
369	301458	钧崴电子	386	13,166.46	0.01
370	000519	中兵红箭	600	13,134.00	0.01
371	000559	万向钱潮	1,700	13,005.00	0.01
372	002675	东诚药业	900	12,951.00	0.01

373	300529	健帆生物	600	12,942.00	0.01
374	601633	长城汽车	600	12,888.00	0.01
375	688187	时代电气	302	12,880.30	0.01
376	688349	三一重能	513	12,794.22	0.01
377	301602	超研股份	514	12,747.20	0.01
378	603218	日月股份	1,000	12,690.00	0.01
379	688425	铁建重工	3,103	12,660.24	0.01
380	603986	兆易创新	100	12,653.00	0.01
381	688180	君实生物	372	12,640.56	0.01
382	002925	盈趣科技	700	12,586.00	0.01
383	601727	上海电气	1,700	12,563.00	0.01
384	000738	航发控制	600	12,450.00	0.01
385	301269	华大九天	100	12,388.00	0.01
386	688097	博众精工	443	12,364.13	0.01
387	688139	海尔生物	400	12,356.00	0.01
388	688551	科威尔	419	12,314.41	0.01
389	603392	万泰生物	200	12,200.00	0.01
390	000550	江铃汽车	600	12,198.00	0.01
391	300601	康泰生物	800	12,152.00	0.01
392	002126	银轮股份	500	12,140.00	0.01
393	300567	精测电子	200	12,122.00	0.01
394	300415	伊之密	600	12,090.00	0.01
395	300547	川环科技	400	12,088.00	0.01
396	301536	星宸科技	200	12,060.00	0.01
397	688112	鼎阳科技	325	12,015.25	0.01
398	688432	有研硅	1,087	12,000.48	0.01
399	002625	光启技术	300	11,994.00	0.01
400	002436	兴森科技	900	11,916.00	0.01
401	603185	弘元绿能	800	11,880.00	0.01
402	600216	浙江医药	800	11,832.00	0.01
403	600420	国药现代	1,100	11,715.00	0.01
404	688166	博瑞医药	218	11,708.78	0.01
405	002019	亿帆医药	900	11,691.00	0.01
406	600869	远东股份	2,300	11,684.00	0.01
407	300354	东华测试	300	11,664.00	0.01
408	605358	立昂微	500	11,650.00	0.01
409	603121	华培动力	500	11,635.00	0.01
410	000035	中国天楹	2,700	11,583.00	0.01
411	688136	科兴制药	302	11,542.44	0.01
412	603728	鸣志电器	200	11,494.00	0.01
413	603882	金城医学	400	11,424.00	0.01

414	603290	斯达半导	140	11,377.80	0.01
415	300680	隆盛科技	300	11,373.00	0.01
416	000581	威孚高科	600	11,364.00	0.01
417	300832	新产业	200	11,344.00	0.01
418	002518	科士达	500	11,295.00	0.01
419	688508	芯朋微	202	11,275.64	0.01
420	603658	安图生物	300	11,250.00	0.01
421	000021	深科技	600	11,244.00	0.01
422	603416	信捷电气	200	11,214.00	0.01
423	000739	普洛药业	800	11,200.00	0.01
424	002465	海格通信	800	11,152.00	0.01
425	002415	海康威视	400	11,092.00	0.01
426	600528	中铁工业	1,500	11,070.00	0.01
427	688249	晶合集成	545	11,047.15	0.01
428	000636	风华高科	800	10,992.00	0.01
429	605333	沪光股份	400	10,980.00	0.01
430	000400	许继电气	500	10,885.00	0.01
431	300316	晶盛机电	400	10,860.00	0.01
432	300724	捷佳伟创	200	10,860.00	0.01
433	603337	杰克股份	300	10,764.00	0.01
434	688518	联赢激光	522	10,643.58	0.01
435	000887	中鼎股份	600	10,554.00	0.01
436	603712	七一二	500	10,505.00	0.01
437	688299	长阳科技	530	10,478.10	0.01
438	688363	华熙生物	204	10,475.40	0.01
439	301601	惠通科技	306	10,358.10	0.01
440	300893	松原安全	420	10,298.40	0.01
441	601966	玲珑轮胎	700	10,269.00	0.01
442	688236	春立医疗	550	10,224.50	0.01
443	300394	天孚通信	128	10,219.52	0.01
444	002920	德赛西威	100	10,213.00	0.01
445	600764	中国海防	300	10,200.00	0.01
446	002332	仙琚制药	1,100	10,087.00	0.01
447	600745	闻泰科技	300	10,059.00	0.01
448	600196	复星医药	400	10,036.00	0.01
449	688533	上声电子	372	10,017.96	0.01
450	000733	振华科技	200	10,010.00	0.01
451	603358	华达科技	300	9,933.00	0.01
452	688127	蓝特光学	386	9,924.06	0.01
453	000661	长春高新	100	9,918.00	0.01
454	300049	福瑞股份	300	9,729.00	0.01

455	300327	中颖电子	400	9,688.00	0.01
456	600580	卧龙电驱	480	9,489.60	0.01
457	300677	英科医疗	400	9,472.00	0.01
458	000157	中联重科	1,300	9,399.00	0.01
459	603659	璞泰来	500	9,390.00	0.01
460	002698	博实股份	600	9,324.00	0.01
461	688580	伟思医疗	200	9,298.00	0.01
462	002402	和而泰	400	9,268.00	0.01
463	605111	新洁能	300	9,222.00	0.01
464	601615	明阳智能	800	9,192.00	0.01
465	300827	上能电气	300	9,165.00	0.01
466	603456	九洲药业	600	9,126.00	0.01
467	301662	宏工科技	110	9,075.00	0.01
468	002709	天赐材料	500	9,060.00	0.01
469	300693	盛弘股份	300	8,988.00	0.01
470	001696	宗申动力	400	8,980.00	0.01
471	300136	信维通信	400	8,960.00	0.01
472	002812	恩捷股份	300	8,787.00	0.01
473	300118	东方日升	900	8,622.00	0.01
474	688472	阿特斯	938	8,582.70	0.01
475	002653	海思科	200	8,444.00	0.01
476	601399	国机重装	2,800	8,400.00	0.01
477	688567	孚能科技	575	8,337.50	0.01
478	002262	恩华药业	400	8,312.00	0.01
479	688110	东芯股份	270	8,278.20	0.01
480	688488	艾迪药业	597	8,268.45	0.01
481	300083	创世纪	1,000	8,220.00	0.01
482	688676	金盘科技	245	8,195.25	0.01
483	603341	龙旗科技	200	8,126.00	0.01
484	002747	埃斯顿	400	8,096.00	0.01
485	601222	林洋能源	1,400	7,980.00	0.01
486	688303	大全能源	370	7,888.40	0.01
487	002745	木林森	1,000	7,880.00	0.01
488	002922	伊戈尔	500	7,865.00	0.01
489	301479	弘景光电	101	7,864.87	0.01
490	300122	智飞生物	400	7,836.00	0.01
491	603305	旭升集团	600	7,830.00	0.01
492	603197	保隆科技	200	7,814.00	0.01
493	603806	福斯特	600	7,776.00	0.01
494	300142	沃森生物	700	7,700.00	0.01
495	002129	TCL 中环	1,000	7,680.00	0.01

496	603568	伟明环保	400	7,632.00	0.01
497	600884	杉杉股份	800	7,568.00	0.01
498	603203	快克智能	300	7,461.00	0.01
499	300576	容大感光	200	7,430.00	0.01
500	600733	北汽蓝谷	1,000	7,370.00	0.01
501	600211	西藏药业	200	7,364.00	0.01
502	601012	隆基绿能	487	7,314.74	0.01
503	000513	丽珠集团	200	7,208.00	0.01
504	601100	恒立液压	100	7,200.00	0.01
505	002422	科伦药业	200	7,184.00	0.01
506	300850	新强联	200	7,164.00	0.01
507	002456	欧菲光	600	7,110.00	0.01
508	300747	锐科激光	300	7,104.00	0.01
509	301658	首航新能	309	7,100.82	0.01
510	688062	迈威生物	249	7,041.72	0.01
511	688556	高测股份	975	7,000.50	0.01
512	600699	均胜电子	400	6,976.00	0.01
513	300751	迈为股份	100	6,956.00	0.01
514	300446	航天智造	400	6,928.00	0.01
515	300456	赛微电子	400	6,876.00	0.01
516	600171	上海贝岭	200	6,850.00	0.01
517	605319	无锡振华	200	6,832.00	0.01
518	603063	禾望电气	200	6,772.00	0.01
519	301665	泰禾股份	300	6,717.00	0.01
520	688146	中船特气	230	6,649.30	0.01
521	002049	紫光国微	100	6,586.00	0.01
522	300919	中伟股份	200	6,576.00	0.01
523	000997	新大陆	200	6,476.00	0.01
524	600707	彩虹股份	1,000	6,460.00	0.01
525	300685	艾德生物	300	6,459.00	0.01
526	300124	汇川技术	100	6,457.00	0.01
527	603662	柯力传感	100	6,393.00	0.01
528	002755	奥赛康	400	6,392.00	0.01
529	301275	汉朔科技	109	6,124.71	0.01
530	688085	三友医疗	317	6,095.91	0.01
531	688378	奥来德	358	6,032.30	0.01
532	600363	联创光电	100	5,833.00	0.00
533	301011	华立科技	200	5,740.00	0.00
534	300763	锦浪科技	100	5,739.00	0.00
535	002151	北斗星通	200	5,738.00	0.00
536	001382	新亚电缆	275	5,557.75	0.00

537	603786	科博达	100	5,541.00	0.00
538	300438	鹏辉能源	200	5,522.00	0.00
539	002409	雅克科技	100	5,469.00	0.00
540	300593	新雷能	400	5,360.00	0.00
541	300347	泰格医药	100	5,332.00	0.00
542	300776	帝尔激光	100	5,321.00	0.00
543	688687	凯因科技	200	5,318.00	0.00
544	688575	亚辉龙	363	5,296.17	0.00
545	300294	博雅生物	200	5,198.00	0.00
546	603606	东方电缆	100	5,171.00	0.00
547	002025	航天电器	100	5,141.00	0.00
548	301501	恒鑫生活	112	5,064.64	0.00
549	301173	毓恬冠佳	110	4,947.80	0.00
550	001356	富岭股份	336	4,851.84	0.00
551	301301	川宁生物	400	4,816.00	0.00
552	000403	派林生物	260	4,713.80	0.00
553	603179	新泉股份	100	4,697.00	0.00
554	301029	怡合达	200	4,572.00	0.00
555	300762	上海瀚讯	200	4,526.00	0.00
556	603730	岱美股份	780	4,438.20	0.00
557	002979	雷赛智能	100	4,428.00	0.00
558	300482	万孚生物	200	4,270.00	0.00
559	002859	洁美科技	200	3,982.00	0.00
560	605088	冠盛股份	100	3,792.00	0.00
561	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
562	002997	瑞鹄模具	100	3,685.00	0.00
563	301636	泽润新能	77	3,654.42	0.00
564	301560	众捷汽车	123	3,376.35	0.00
565	600933	爱柯迪	200	3,202.00	0.00
566	300633	开立医疗	100	2,972.00	0.00
567	601163	三角轮胎	200	2,810.00	0.00
568	300003	乐普医疗	200	2,756.00	0.00
569	300443	金雷股份	100	2,260.00	0.00
570	300298	三诺生物	100	2,259.00	0.00
571	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
572	603100	川仪股份	100	2,063.00	0.00
573	002430	杭氧股份	100	1,942.00	0.00
574	600967	内蒙一机	100	1,935.00	0.00
575	300491	通合科技	100	1,910.00	0.00
576	600761	安徽合力	100	1,774.00	0.00
577	300258	精锻科技	100	1,382.00	0.00

578	600877	电科芯片	100	1,268.00	0.00
579	002531	天顺风能	100	714.00	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	600660	福耀玻璃	2,655,619.00	2.10
2	603259	药明康德	2,265,179.00	1.79
3	002415	海康威视	2,199,205.36	1.74
4	688008	澜起科技	2,023,646.50	1.60
5	600276	恒瑞医药	1,943,983.00	1.54
6	002371	北方华创	1,827,568.00	1.44
7	002475	立讯精密	1,812,126.00	1.43
8	601012	隆基绿能	1,758,311.00	1.39
9	002594	比亚迪	1,748,928.00	1.38
10	600482	中国动力	1,738,119.00	1.37
11	300308	中际旭创	1,705,837.00	1.35
12	002595	豪迈科技	1,704,895.00	1.35
13	600406	国电南瑞	1,683,116.00	1.33
14	000063	中兴通讯	1,677,409.00	1.33
15	300750	宁德时代	1,611,775.00	1.27
16	688981	中芯国际	1,609,466.42	1.27
17	600031	三一重工	1,595,476.00	1.26
18	000100	TCL 科技	1,590,998.00	1.26
19	000977	浪潮信息	1,489,505.00	1.18
20	002028	思源电气	1,470,385.00	1.16

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	3,226,728.00	2.55
2	002594	比亚迪	2,926,857.00	2.31
3	300308	中际旭创	2,732,393.00	2.16
4	600660	福耀玻璃	2,553,503.00	2.02
5	002415	海康威视	2,317,984.00	1.83
6	601012	隆基绿能	2,213,560.00	1.75
7	600183	生益科技	2,076,263.00	1.64

8	688235	百济神州	2,047,660.36	1.62
9	002371	北方华创	1,882,022.00	1.49
10	600276	恒瑞医药	1,875,819.00	1.48
11	600031	三一重工	1,870,563.00	1.48
12	300408	三环集团	1,835,944.00	1.45
13	603259	药明康德	1,731,145.00	1.37
14	300433	蓝思科技	1,730,736.00	1.37
15	002475	立讯精密	1,708,063.00	1.35
16	300502	新易盛	1,671,989.00	1.32
17	603501	豪威集团	1,652,955.91	1.31
18	601766	中国中车	1,493,295.00	1.18
19	300274	阳光电源	1,480,999.00	1.17
20	300394	天孚通信	1,437,472.00	1.14

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	250,607,487.52
卖出股票收入（成交）总额	264,642,539.14

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（元）	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）	21,150.93	0.02
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	21,150.93	0.02

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	123256	恒帅转债	57	13,050.40	0.01
2	123257	安克转债	81	8,100.53	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，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金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规定的备选股票库

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	13,249.03
2	应收清算款	1,954,133.48
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	15,372.40
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,982,754.91

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(元)	占基金资产净 值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688313	仕佳光子	538,673.85	0.45	筹划重大事项

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 (%)
富国中证高端制造 指数增强型 (LOF) A	10,840	5,236.68	45,548.60	0.08	56,720,05 5.69	99.92
富国中证高端制造 指数增强型 (LOF) C	538	18,036.73	6,463,145. 08	66.60	3,240,617 .39	33.40
合计	11,378	5,841.92	6,508,693. 68	9.79	59,960,67 3.08	90.21

8.2 期末上市基金前十名持有人

富国中证高端制造指数增强型 (LOF) A

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	张灵瑶	325,242.00	4.28
2	张胜利	260,000.00	3.42
3	杜晶晶	209,000.00	2.75
4	刘怡	180,659.00	2.38
5	钱红华	158,800.00	2.09
6	顾红	145,500.00	1.92
7	龙倩	100,029.00	1.32
8	何淑仪	100,000.00	1.32
9	高启亮	96,592.00	1.27
10	黄艳	90,000.00	1.19

8.3 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	富国中证高端制造指数 增强型 (LOF) A	454,403.05	0.8005
	富国中证高端制造指数 增强型 (LOF) C	4,234.93	0.0436
	合计	458,637.98	0.6900

8.4 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的情况

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	富国中证高端制造指数增强型（LOF）A	10~50
	富国中证高端制造指数增强型（LOF）C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	富国中证高端制造指数增强型（LOF）A	0~10
	富国中证高端制造指数增强型（LOF）C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	富国中证高端制造指数增强型（LOF）A	富国中证高端制造指数增强型（LOF）C
基金合同生效日(2017年04月27日)基金份额总额	281,495,289.54	—
报告期期初基金份额总额	65,273,902.82	9,436,080.78
本报告期基金总申购份额	8,585,905.28	7,804,970.89
减：本报告期基金总赎回份额	17,094,203.81	7,537,289.20
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	56,765,604.29	9,703,762.47

§ 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无重大人事变动。

中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用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 （%）	
渤海证券	2	—	—	—	—	—
长城证券	1	—	—	—	—	—
长江证券	3	337,719.00	0.07	45.86	0.07	—
东北证券	2	—	—	—	—	—
东财证券	2	—	—	—	—	—
方正证券	2	36,493,334.66	7.09	4,958.99	7.09	—
高盛中国	1	—	—	—	—	—
光大证券	2	—	—	—	—	—
广发证券	2	—	—	—	—	—
国海证券	2	—	—	—	—	—
国盛证券	2	—	—	—	—	—
国泰海通	4	23,206,400.65	4.51	3,153.42	4.51	—
国泰君安	2	—	—	—	—	—
国投证券	2	—	—	—	—	—
国信证券	2	45,759,139.73	8.89	6,219.65	8.89	—
海通证券	2	—	—	—	—	—
华泰证券	2	5,951,747.00	1.16	808.79	1.16	—
华源证券	2	—	—	—	—	—
平安证券	2	139,275,360.81	27.05	18,928.65	27.05	—
瑞银证券	2	—	—	—	—	—
上海证券	1	—	—	—	—	—
申万宏源	2	54,934,115.00	10.67	7,465.60	10.67	—
太平洋证券	2	—	—	—	—	—
天风证券	2	—	—	—	—	—
西南证券	2	—	—	—	—	—
湘财证券	2	—	—	—	—	—
信达证券	2	—	—	—	—	—
兴业证券	1	—	—	—	—	—
招商证券	1	77,560,797.92	15.07	10,540.86	15.07	—
中航证券	2	—	—	—	—	—

中金公司	2	109,806,209.24	21.33	14,923.05	21.33	—
中泰证券	2	—	—	—	—	—
中信建投	2	4,639,282.00	0.90	630.41	0.90	—
中信证券	3	16,848,628.14	3.27	2,289.63	3.27	—
中银证券	1	—	—	—	—	—

注：1、我对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。本报告期本基金新增券商交易单元：华源证券（019189、63156）。

2、国泰海通证券有限公司（简称“国泰海通”）是由国泰君安证券股份有限公司与海通证券股份有限公司于2025年3月14日合并组建而成。上表显示的国泰海通数据为自2025年3月15日至2025年6月30日通过国泰海通证券席位交易的情况，本期海通证券、国泰君安数据为自2025年1月1日至2025年3月14日通过海通证券、国泰君安席位交易的情况。

10.7.2 基金租用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（%）
渤海证券	—	—	—	—	—	—
长城证券	—	—	—	—	—	—
长江证券	—	—	—	—	—	—
东北证券	—	—	—	—	—	—
东财证券	—	—	—	—	—	—
方正证券	—	—	—	—	—	—
高盛中国	—	—	—	—	—	—
光大证券	—	—	—	—	—	—
广发证券	—	—	—	—	—	—
国海证券	—	—	—	—	—	—
国盛证券	—	—	—	—	—	—
国泰海通	—	—	—	—	—	—
国泰君安	—	—	—	—	—	—
国投证券	—	—	—	—	—	—
国信证券	—	—	—	—	—	—
海通证券	—	—	—	—	—	—

华泰证券	—	—	—	—	—	—
华源证券	—	—	—	—	—	—
平安证券	—	—	—	—	—	—
瑞银证券	—	—	—	—	—	—
上海证券	—	—	—	—	—	—
申万宏源	8,475.50	100.00	—	—	—	—
太平洋证券	—	—	—	—	—	—
天风证券	—	—	—	—	—	—
西南证券	—	—	—	—	—	—
湘财证券	—	—	—	—	—	—
信达证券	—	—	—	—	—	—
兴业证券	—	—	—	—	—	—
招商证券	—	—	—	—	—	—
中航证券	—	—	—	—	—	—
中金公司	—	—	—	—	—	—
中泰证券	—	—	—	—	—	—
中信建投	—	—	—	—	—	—
中信证券	—	—	—	—	—	—
中银证券	—	—	—	—	—	—

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调整旗下基金长期停牌股票估值方法的公告	规定披露媒介	2025年01月02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	2025年01月09日
3	富国基金管理有限公司关于变更主要股东事项获得中国证券监督管理委员会批复的公告	规定披露媒介	2025年01月21日
4	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2025年03月07日
5	富国基金管理有限公司关于公司主要股东变更的公告	规定披露媒介	2025年03月18日
6	关于富国基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	规定披露媒介	2025年03月20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	2025年03月27日
8	富国基金管理有限公司关于调整旗下基金长期停牌股票估值方法的公告	规定披露媒介	2025年04月08日
9	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	2025年05月06日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期无单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

一、本报告期内，根据中国证券监督管理委员会于 2025 年 1 月 17 日出具的《关于同意国泰君安证券股份有限公司吸收合并海通证券股份有限公司并募集配套资金注册、核准国泰君安证券股份有限公司吸收合并海通证券股份有限公司、海富通基金管理有限公司变更主要股东及实际控制人、富国基金管理有限公司变更主要股东、海通期货股份有限公司变更主要股东及实际控制人的批复》，国泰君安证券股份有限公司（以下简称“国泰君安”）吸收合并海通证券股份有限公司，并依法承接富国基金管理有限公司 14,443 万元出资（占注册资本比例 27.775%）。自吸收合并交割日（即 2025 年 3 月 14 日）起，合并后的国泰君安成为基金管理人的主要股东。具体可参见基金管理人于 2025 年 1 月 21 日发布的《富国基金管理有限公司关于变更主要股东事项获得中国证券监督管理委员会批复的公告》、2025 年 3 月 18 日发布的《富国基金管理有限公司关于公司主要股东变更的公告》。根据国泰海通证券股份有限公司于 2025 年 4 月 4 日发布的相关公告，国泰君安的公司名称变更为国泰海通证券股份有限公司。

二、本报告期内，根据《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规的规定和基金合同的约定，为降低投资者的理财成本，经与本基金托管人协商一致，自 2025 年 3 月 21 日起，本基金指数使用费调整为由基金管理人承担，并相应修订基金合同有关内容。具体可参见基金管理人于 2025 年 3 月 20 日发布的《关于富国基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告》及修订后的基金合同、托管协议等法律文件。

§ 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高端制造指数增强型证券投资基金（LOF）的文件 2、富国中证高端制造指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同 3、富国中证高端制造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、富国中证高端制造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 。