

富国沪深 300 增强证券投资基金

二 0 二六年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	5
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	8
§ 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的说明	14
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
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	半年度财务报告（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	44
7.1	期末基金资产组合情况	44

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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.....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
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.....	59
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	59
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	59
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	59
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.12 投资组合报告附注	59
§ 8 基金份额持有人信息	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
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.....	61
§ 9 开放式基金份额变动	62
§ 10 重大事件揭示	63
10.1 基金份额持有人大会决议	63
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.....	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
10.4 基金投资策略的改变	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	63
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.....	64
10.8 其他重大事件	66
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	67
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	67
§ 12 备查文件目录	68

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国沪深 300 增强证券投资基金		
基金简称	富国沪深 300 指数增强		
基金主代码	100038		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2009 年 12 月 16 日		
基金管理人	富国基金管理有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	2,765,755,882.67 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	富国沪深 300 指数增强 A/B	富国沪深 300 指数增强 C	富国沪深 300 指数增强 Y
下属分级基金的交易代码	前端	后端	013291
	100038	000154	
报告期末下属分级基金的份额总额	2,325,463,254.77 份	394,140,179.80 份	46,152,448.10 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，在力求对沪深 300 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。在复制目标指数的基础上本基金一定程度地调整个股，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 7.75%。本基金的标的指数、对目标指数的跟踪调整、存托凭证、债券、金融衍生工具投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	95%×沪深 300 指数收益率+1.5%（指年收益率，评价时按期间折算）
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	郭明
	联系电话	021-20361818	010—66105799
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105686、4008880688	95588
传真		021-20361616	010—66105798
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大	北京市西城区复兴门内大街 55 号

	道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	
办公地址	上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	陈戈	廖林

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 中国工商银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街 55 号

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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

§ 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) 富国沪深 300 指数增强 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	525,666,891.29
本期利润	527,958,145.66
加权平均基金份额本期利润	0.2149
本期加权平均净值利润率	10.95%
本期基金份额净值增长率	11.43%
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	2,527,681,789.89
期末可供分配基金份额利润	1.0870
期末基金资产净值	4,853,145,044.66
期末基金份额净值	2.087
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	196.41%

(2) 富国沪深 300 指数增强 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	103,762,117.00
本期利润	107,825,894.68
加权平均基金份额本期利润	0.2165
本期加权平均净值利润率	11.16%
本期基金份额净值增长率	11.31%
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	420,464,421.26
期末可供分配基金份额利润	1.0668
期末基金资产净值	814,604,601.06
期末基金份额净值	2.067
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	11.82%

(3) 富国沪深 300 指数增强 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	8,439,563.24
本期利润	9,217,908.24
加权平均基金份额本期利润	0.2292
本期加权平均净值利润率	11.55%
本期基金份额净值增长率	11.72%
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	51,077,295.48
期末可供分配基金份额利润	1.1067
期末基金资产净值	97,229,743.58
期末基金份额净值	2.107
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 06 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	34.46%

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) 富国沪深 300 指数增强 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	11.72%	1.22%	11.71%	1.19%	0.01%	0.03%
过去六个月	11.43%	1.13%	7.99%	1.07%	3.44%	0.06%
过去一年	29.63%	0.99%	26.99%	0.97%	2.64%	0.02%
过去三年	39.04%	1.02%	34.09%	1.06%	4.95%	-0.04%
过去五年	7.44%	1.04%	3.36%	1.06%	4.08%	-0.02%
过去七年	52.40%	1.10%	43.47%	1.11%	8.93%	-0.01%
过去十年	121.20%	1.09%	80.66%	1.09%	40.54%	0.00%
自基金合同生效起至今	196.41%	1.28%	78.32%	1.29%	118.09%	-0.01%

(2) 富国沪深 300 指数增强 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	11.67%	1.23%	11.71%	1.19%	-0.04%	0.04%
过去六个月	11.31%	1.13%	7.99%	1.07%	3.32%	0.06%
过去一年	29.35%	0.99%	26.99%	0.97%	2.36%	0.02%
过去三年	38.26%	1.02%	34.09%	1.06%	4.17%	-0.04%
自基金分级生效日起 至今	11.82%	1.02%	9.82%	1.05%	2.00%	-0.03%

(3) 富国沪深 300 指数增强 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	11.90%	1.23%	11.71%	1.19%	0.19%	0.04%
过去六个月	11.72%	1.13%	7.99%	1.07%	3.73%	0.06%
过去一年	30.38%	0.99%	26.99%	0.97%	3.39%	0.02%
自基金分级生效日起 至今	34.46%	0.97%	28.15%	0.96%	6.31%	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。

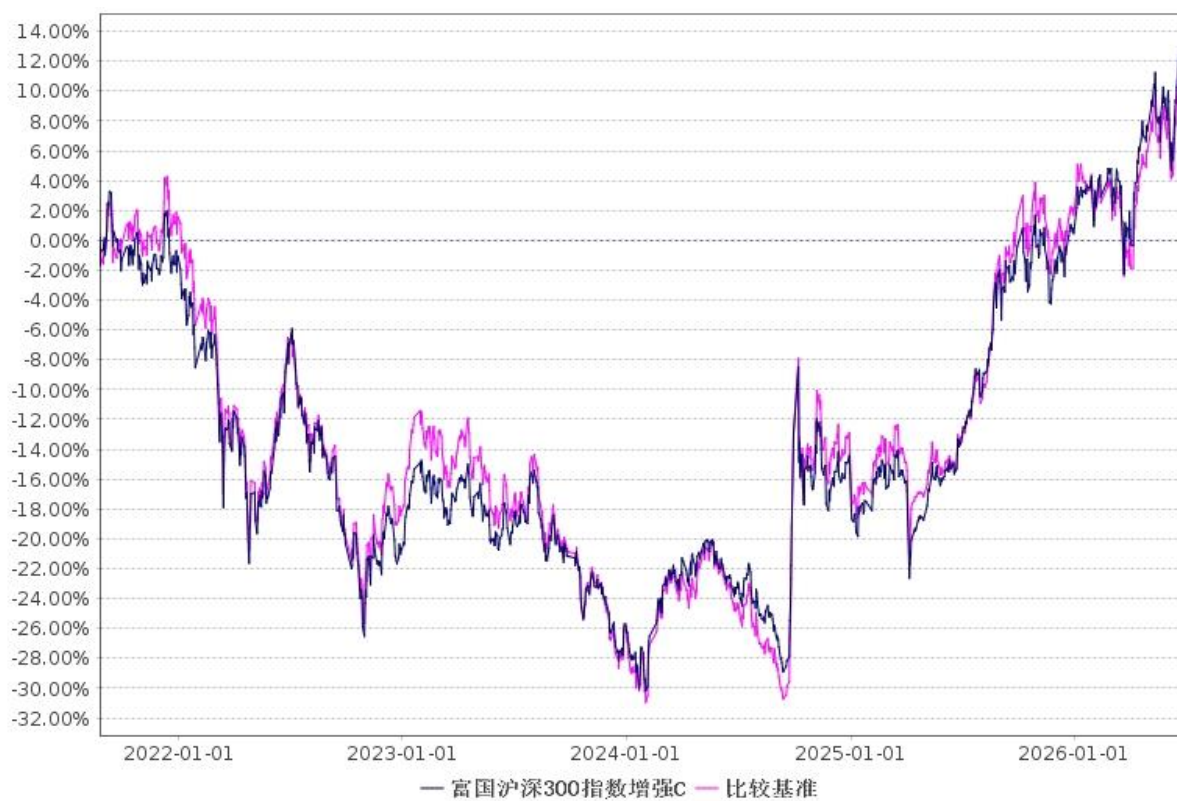
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

(1) 富国沪深 300 指数增强 A/B



注：1、截止日期为 2026 年 6 月 30 日。

(2) 富国沪深 300 指数增强 C



注：1、截止日期为 2026 年 6 月 30 日。

2、本基金自 2021 年 8 月 24 日起增加 C 类份额，相关数据按实际存续期计算。

(3) 富国沪深 300 指数增强 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	2009-12-23	—	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（Barclays Global 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。

注：1、上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国沪深 300 增强证券投资基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国沪深 300 增强证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险、力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定收益为目标，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。

在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本基金与公司管理的其他投资组合之间，出现 37 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沪深 300 指数增强 A/B 为 2.087 元，富国沪深 300 指数增强 C 为 2.067 元，富国沪深 300 指数增强 Y 为 2.107 元；份额累计净值富国沪深 300 指数增强 A/B 为 2.673 元，富国沪深 300 指数增强 C 为 2.297 元，富国沪深 300 指数增强 Y 为 2.107 元；本报告期，本基金份额净值增长率情况：富国沪深 300 指数增强 A/B 为 11.43%，富国沪深 300 指数增强 C 为 11.31%，富国沪深 300 指数增强 Y 为 11.72%；同期业绩比较基准收益率情况：富国沪深 300 指数增强 A/B 为 7.99%，富国沪深 300 指数增强 C 为 7.99%，富国沪深 300 指数增强 Y 为 7.99%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，随着部分不确定因素逐步明朗，市场或仍以震荡运行为主。从外部环境来看，地缘政治局势仍可能对市场风险偏好产生扰动，油价冲高后有所回落；美国通胀数据环比回落，叠加非农数据走弱，后续美联储加息预期或有所降温，对全球流动性的压制可能相应缓解。国内方面，经济修复态势短期或将延续，内需仍有待进一步修复，后续稳增长政策及相关工程项目的实施效果值得关注。整体来看，受资金博弈等因素影响，市场运行过程中仍可能伴随节奏波动与反复。8 月中报密集披露期可能促使市场进一步关注企业盈利表现，市场机会或更多体现为具有业绩支撑品种的估值修复。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等法律法规、估值指引的相关规定，以及基金合同对估值程序的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、基金份额净值的

计算由基金管理人独立完成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、本基金《基金合同》的约定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——富国基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现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真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对富国基金管理有限公司编制和披露的本基金 2026 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：富国沪深 300 增强证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：		
货币资金	352,934,043.37	444,377,866.24
结算备付金	24,397,025.83	23,903,524.34
存出保证金	1,205,417.36	1,052,076.51
交易性金融资产	5,424,285,768.79	5,564,340,753.91
其中：股票投资	5,424,285,768.79	5,563,550,338.60
基金投资	—	—
债券投资	—	790,415.31
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	65,775.51	108,762.03
应收股利	—	—
应收申购款	6,293,820.27	4,511,627.88
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	5,809,181,851.13	6,038,294,610.91
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	58,435.70	62,951.00
应付赎回款	35,248,838.85	102,037,920.12
应付管理人报酬	4,623,034.30	5,298,006.02
应付托管费	832,146.16	953,641.10
应付销售服务费	132,583.97	222,135.18
应付投资顾问费	—	—
应交税费	0.37	0.66

应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	3,307,422.48	3,141,104.93
负债合计	44,202,461.83	111,715,759.01
净资产：		
实收基金	2,765,755,882.67	3,168,102,533.38
未分配利润	2,999,223,506.63	2,758,476,318.52
净资产合计	5,764,979,389.30	5,926,578,851.90
负债和净资产总计	5,809,181,851.13	6,038,294,610.91

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.084 元，基金份额总额 2,765,755,882.67 份。其中：富国沪深 300 指数增强 A/B 份额净值 2.087 元，份额总额 2,325,463,254.77 份；富国沪深 300 指数增强 C 份额净值 2.067 元，份额总额 394,140,179.80 份；富国沪深 300 指数增强 Y 份额净值 2.107 元，份额总额 46,152,448.10 份。

6.2 利润表

会计主体：富国沪深 300 增强证券投资基金

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

单位：人民币元

项目	本期 (2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日)	上年度可比期间 (2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日)
一、营业总收入	680,170,874.27	230,476,090.50
1. 利息收入	726,176.66	1,032,811.56
其中：存款利息收入	726,176.66	1,032,811.56
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）	670,647,269.51	288,537,981.13
其中：股票投资收益	625,060,008.86	175,065,288.26
基金投资收益	—	—
债券投资收益	1,344,388.22	230,911.85
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	44,242,872.43	113,241,781.02
其他投资收益	—	—
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7,133,377.05	-62,628,017.44
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	1,664,051.05	3,533,315.25

减：二、营业总支出	35,168,925.69	54,162,642.58
1. 管理人报酬	28,900,868.99	43,625,539.01
2. 托管费	5,202,156.38	7,852,597.02
3. 销售服务费	961,827.97	2,239,667.64
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	0.47	0.66
8. 其他费用	104,071.88	444,838.25
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	645,001,948.58	176,313,447.92
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	645,001,948.58	176,313,447.92
五、其他综合收益的税后净额	—	—
六、综合收益总额	645,001,948.58	176,313,447.92

6.3 净资产变动表

会计主体：富国沪深 300 增强证券投资基金

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

单位：人民币元

项目	本期 (2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日)		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	3,168,102,533.38	2,758,476,318.52	5,926,578,851.90
二、本期期初净资产	3,168,102,533.38	2,758,476,318.52	5,926,578,851.90
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-402,346,650.71	240,747,188.11	-161,599,462.60
（一）、综合收益总额	—	645,001,948.58	645,001,948.58
（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）	-402,346,650.71	-404,254,760.47	-806,601,411.18
其中：1. 基金申购款	721,130,723.06	688,473,600.32	1,409,604,323.38
2. 基金赎回款	—	—	—
	1,123,477,373.77	1,092,728,360.79	2,216,205,734.56
（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	2,765,755,882.67	2,999,223,506.63	5,764,979,389.30
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	6,458,819,658.84	3,671,433,532.37	10,130,253,191.21

二、本期期初净资产	6,458,819,658.84	3,671,433,532.37	10,130,253,191.21
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	- 1,529,276,183.09	-680,491,994.81	- 2,209,768,177.90
（一）、综合收益总额	-	176,313,447.92	176,313,447.92
（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）	- 1,529,276,183.09	-856,805,442.73	- 2,386,081,625.82
其中：1. 基金申购款	1,120,960,804.81	619,455,159.97	1,740,415,964.78
2. 基金赎回款	- 2,650,236,987.90	- 1,476,260,602.70	- 4,126,497,590.60
（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	4,929,543,475.75	2,990,941,537.56	7,920,485,013.31

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

富国沪深 300 增强证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2009]1106 号文《关于核准富国沪深 300 增强证券投资基金募集的批复》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 2009 年 12 月 16 日正式生效，首次设立募集规模为 3,489,909,303.02 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 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 24 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和注册登记机构为富国基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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、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。其中，股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产的 90%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的

资产不低于股票及存托凭证资产的 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： $95\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 1.5\%$ （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 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	352,934,043.37
等于：本金	352,898,820.14
加：应计利息	35,223.23
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	352,934,043.37

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		5,118,918,968.98	—	5,424,285,768.79	305,366,799.81
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	—	—	—	—
	银行间市场	—	—	—	—
	合计	—	—	—	—
资产支持证券		—	—	—	—
基金		—	—	—	—
其他		—	—	—	—
合计		5,118,918,968.98	—	5,424,285,768.79	305,366,799.81

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	75,464.74
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	3,058,237.44
其中：交易所市场	3,058,237.44
银行间市场	—
应付利息	—
预提信息披露费	60,000.00
预提审计费	113,720.30
合计	3,307,422.48

6.4.7.7 实收基金

富国沪深 300 指数增强 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	2,593,858,047.69	2,593,858,047.69
本期申购	371,534,061.57	371,534,061.57
本期赎回（以“-”号填列）	-639,928,854.49	-639,928,854.49
本期末	2,325,463,254.77	2,325,463,254.77

富国沪深 300 指数增强 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	546,753,330.59	546,753,330.59
本期申购	320,861,164.87	320,861,164.87
本期赎回（以“-”号填列）	-473,474,315.66	-473,474,315.66
本期末	394,140,179.80	394,140,179.80

富国沪深 300 指数增强 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	27,491,155.10	27,491,155.10
本期申购	28,735,496.62	28,735,496.62
本期赎回（以“-”号填列）	-10,074,203.62	-10,074,203.62
本期末	46,152,448.10	46,152,448.10

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

富国沪深 300 指数增强 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	3,849,595,409.62	— 1,584,186,938.92	2,265,408,470.70
本期期初	3,849,595,409.62	— 1,584,186,938.92	2,265,408,470.70
本期利润	525,666,891.29	2,291,254.37	527,958,145.66
本期基金份额交易产生的变动数	-429,747,873.68	164,063,047.21	-265,684,826.47
其中：基金申购款	599,430,315.92	-240,316,227.15	359,114,088.77
基金赎回款	-1,029,178,189.60	404,379,274.36	-624,798,915.24
本期已分配利润	—	—	—
本期末	3,945,514,427.23	— 1,417,832,637.34	2,527,681,789.89

富国沪深 300 指数增强 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	802,614,375.11	-333,891,277.28	468,723,097.83
本期期初	802,614,375.11	-333,891,277.28	468,723,097.83
本期利润	103,762,117.00	4,063,777.68	107,825,894.68
本期基金份额交易产生的变动数	-245,623,496.11	89,538,924.86	-156,084,571.25
其中：基金申购款	510,001,793.73	-208,304,999.11	301,696,794.62
基金赎回款	-755,625,289.84	297,843,923.97	-457,781,365.87
本期已分配利润	—	—	—
本期末	660,752,996.00	-240,288,574.74	420,464,421.26

富国沪深 300 指数增强 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	41,137,772.76	-16,793,022.77	24,344,749.99
本期期初	41,137,772.76	-16,793,022.77	24,344,749.99
本期利润	8,439,563.24	778,345.00	9,217,908.24
本期基金份额交易产生的变动数	29,638,480.80	-12,123,843.55	17,514,637.25
其中：基金申购款	46,158,347.91	-18,495,630.98	27,662,716.93
基金赎回款	-16,519,867.11	6,371,787.43	-10,148,079.68
本期已分配利润	—	—	—
本期末	79,215,816.80	-28,138,521.32	51,077,295.48

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	664,320.90
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	44,075.64
其他	17,780.12
合计	726,176.66

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	21,863,886,051.05
减：卖出股票成本总额	21,219,306,893.88
减：交易费用	19,519,148.31
买卖股票差价收入	625,060,008.86

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	131.36
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,344,256.86
合计	1,344,388.22

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	2,507,512.84
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,163,000.00
减：应计利息总额	155.65
减：交易费用	100.33
买卖债券差价收入	1,344,256.86

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	44,242,872.43
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	44,242,872.43

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	7,133,377.05
股票投资	7,378,672.05
债券投资	-245,295.00
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	7,133,377.05

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	1,540,353.77
基金转换费收入	123,697.28
合计	1,664,051.05

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	33,720.30
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	633.00
债券账户维护费	9,000.00
其他	718.58
合计	104,071.88

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
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、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	11,237,397,064.67	26.17	1,505,998,964.89	3.73
海通证券	—	—	1,778,526,550.67	4.40
申万宏源	6,309,255,054.89	14.70	1,874,422,407.42	4.64

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）		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	1,064,206.37	42.44	—	—

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	1,527,219.78	26.17	831,239.12	27.18
申万宏源	857,665.30	14.70	563,815.68	18.44
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	204,666.63	3.73	87,407.57	3.78
海通证券	241,722.49	4.40	—	—
申万宏源	254,730.73	4.64	169,215.65	7.31

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	28,900,868.99	43,625,539.01
其中：应支付销售机构的客户维护费	8,484,796.07	9,768,122.13
应支付基金管理人的净管理费	20,416,072.92	33,857,416.88

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 1.0%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：

$$H = E \times \text{该类份额的管理费年费率} \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，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（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	5,202,156.38	7,852,597.02

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 0.18%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 0.09%的年费率计提。

托管费的计算方法如下： $H=E\times \text{该类份额的托管费年费率}\div \text{当年天数}$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，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			
	富国沪深 300 指数 增强 A/B	富国沪深 300 指数 增强 C	富国沪深 300 指数 增强 Y	合计
富国基金管理有限公司	—	634,764.29	—	634,764.29
国泰海通证券股份有限公司	—	1,493.67	—	1,493.67
申万宏源证券有限公司	—	149.79	—	149.79
中国工商银行股份有限公司	—	42,079.20	—	42,079.20
合计	—	678,486.95	—	678,486.95

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			
	富国沪深 300 指数 增强 A/B	富国沪深 300 指数 增强 C	富国沪深 300 指数 增强 Y	合计
富国基金管理有限公司	—	1,587,644.21	—	1,587,644.21
国泰海通证券股份有限公司	—	814.95	—	814.95
海通证券股份有限公司	—	560.39	—	560.39
申万宏源证券有限公司	—	9.61	—	9.61
中国工商银行股份有限公司	—	156,690.21	—	156,690.21
合计	—	1,745,719.37	—	1,745,719.37

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 0.2% 年费率计提。销售服务费计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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（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
中国工商银行股份有限公司	352,934,043.37	664,320.90	490,699,203.68	943,586.29

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：本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
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	2026-05-08	6个月	新股限售	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	—
001399	惠科股份	2026-06-16	6个月	新股限售	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	—
301513	尚水智能	2026-04-	6个月	新股限售	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	—

		10								
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	—
688712	北芯生命	2026-01-28	6 个月	新股限售	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	—
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	2026-04-01	6 个月	新股限售	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	—
688813	泰金新能	2026-03-	6 个月	新股限售	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	—

		24								
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	—

6.4.12.2 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	42,140.00	30,575,711.27	35,060,480.00	—

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	—	790,415.31
未评级	—	—
合计	—	790,415.31

注：本基金本报告期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

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	352,934,043.37	—	—	—	352,934,043.37
结算备付金	24,397,025.83	—	—	—	24,397,025.83
存出保证金	1,205,417.36	—	—	—	1,205,417.36
交易性金融资产	—	—	—	5,424,285,768.79	5,424,285,768.79
应收清算款	—	—	—	65,775.51	65,775.51
应收申购款	—	—	—	6,293,820.27	6,293,820.27
资产总计	378,536,486.56	—	—	5,430,645,364.57	5,809,181,851.13
负债					
应付清算款	—	—	—	58,435.70	58,435.70
应付赎回款	—	—	—	35,248,838.85	35,248,838.85
应付管理人报酬	—	—	—	4,623,034.30	4,623,034.30
应付托管费	—	—	—	832,146.16	832,146.16
应付销售服务费	—	—	—	132,583.97	132,583.97
应交税费	—	—	—	0.37	0.37
其他负债	—	—	—	3,307,422.48	3,307,422.48
负债总计	—	—	—	44,202,461.83	44,202,461.83
利率敏感度缺口	378,536,486.56	—	—	5,386,442,902.74	5,764,979,389.30
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	444,377,866.24	—	—	—	444,377,866.24
结算备付金	23,903,524.34	—	—	—	23,903,524.34
存出保证金	1,052,076.51	—	—	—	1,052,076.51
交易性金融资产	790,415.31	—	—	5,563,550,338.60	5,564,340,753.91
应收清算款	—	—	—	108,762.03	108,762.03
应收申购款	—	—	—	4,511,627.88	4,511,627.88
资产总计	470,123,882.40	—	—	5,568,170,728.51	6,038,294,610.91
负债					
应付清算款	—	—	—	62,951.00	62,951.00
应付赎回款	—	—	—	102,037,920.12	102,037,920.12
应付管理人报酬	—	—	—	5,298,006.02	5,298,006.02
应付托管费	—	—	—	953,641.10	953,641.10
应付销售服务费	—	—	—	222,135.18	222,135.18

应交税费	—	—	—	0.66	0.66
其他负债	—	—	—	3,141,104.93	3,141,104.93
负债总计	—	—	—	111,715,759.01	111,715,759.01
利率敏感度缺口	470,123,882.40	—	—	5,456,454,969.50	5,926,578,851.90

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本期末及上年度末均未持有债券资产（不含可转债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末（2026年06月30日）		上年度末（2025年12月31日）	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	5,424,285,768.79	94.09	5,563,550,338.60	93.87
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	790,415.31	0.01
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	5,424,285,768.79	94.09	5,564,340,753.91	93.89

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%	59,800,720.75	57,780,292.35
	2. 业绩比较基准减少 1%	-59,800,720.75	-57,780,292.35

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	5,373,849,379.10	5,519,654,357.77

第二层次	35,925,938.54	36,980,128.64
第三层次	14,510,451.15	7,706,267.50
合计	5,424,285,768.79	5,564,340,753.91

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	5,424,285,768.79	93.37
	其中：股票	5,424,285,768.79	93.37
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	377,331,069.20	6.50
8	其他各项资产	7,565,013.14	0.13
9	合计	5,809,181,851.13	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	6,345,766.17	0.11
B	采矿业	187,251,682.86	3.25
C	制造业	2,832,974,122.31	49.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	111,160,405.61	1.93
E	建筑业	36,909,368.90	0.64
F	批发和零售业	11,104,128.00	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	136,731,805.99	2.37
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	276,935,742.11	4.80
J	金融业	657,022,364.76	11.40
K	房地产业	14,139,684.20	0.25
L	租赁和商务服务业	14,740,521.00	0.26
M	科学研究和技术服务业	96,231,039.78	1.67

N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	6,335,717.00	0.11
S	综合	—	—
	合计	4,387,882,348.69	76.11

7.2.1.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	27,125,863.82	0.47
C	制造业	824,873,286.70	14.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,548,706.44	0.08
E	建筑业	9,324,772.00	0.16
F	批发和零售业	69,423,784.75	1.20
G	交通运输、仓储和邮政业	8,137,443.46	0.14
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	41,634,844.47	0.72
J	金融业	1,627,070.00	0.03
K	房地产业	16,959,252.00	0.29
L	租赁和商务服务业	15,701,938.00	0.27
M	科学研究和技术服务业	7,195,620.00	0.12
N	水利、环境和公共设施管理业	6,711,248.46	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	3,139,590.00	0.05
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	1,036,403,420.10	17.98

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	276,200	350,774,000.00	6.08
2	300750	宁德时代	490,527	192,782,016.27	3.34

3	300502	新易盛	305,042	185,160,494.00	3.21
4	603259	药明康德	772,878	96,231,039.78	1.67
5	603986	兆易创新	105,147	85,694,805.00	1.49
6	600519	贵州茅台	69,324	82,182,908.76	1.43
7	002384	东山精密	309,800	81,276,030.00	1.41
8	688256	寒武纪	49,006	78,191,523.30	1.36
9	600036	招商银行	2,115,480	75,099,540.00	1.30
10	002463	沪电股份	472,250	72,159,800.00	1.25
11	600919	江苏银行	6,326,513	68,199,810.14	1.18
12	301308	江波龙	92,400	65,031,120.00	1.13
13	002709	天赐材料	1,213,875	62,429,591.25	1.08
14	002466	天齐锂业	975,136	59,795,339.52	1.04
15	002916	深南电路	128,796	58,975,688.40	1.02
16	002371	北方华创	61,643	54,526,932.08	0.95
17	688008	澜起科技	169,697	52,589,100.30	0.91
18	600176	中国巨石	704,613	51,352,195.44	0.89
19	601899	紫金矿业	2,037,842	51,231,347.88	0.89
20	300033	同花顺	210,900	50,826,900.00	0.88
21	603799	华友钴业	1,014,330	48,951,565.80	0.85
22	605117	德业股份	430,423	45,702,314.14	0.79
23	601872	招商轮船	2,418,860	42,499,370.20	0.74
24	603993	洛阳钼业	2,255,700	39,587,535.00	0.69
25	600183	生益科技	221,900	38,477,460.00	0.67
26	601138	工业富联	527,043	38,026,152.45	0.66
27	000333	美的集团	500,082	37,771,193.46	0.66
28	300661	圣邦股份	260,999	37,448,136.52	0.65
29	002602	世纪华通	2,592,600	36,555,660.00	0.63
30	002532	天山铝业	3,276,640	35,158,347.20	0.61
31	688072	拓荆科技	42,140	35,060,480.00	0.61
32	000651	格力电器	923,537	34,632,637.50	0.60
33	688111	金山办公	160,735	34,244,591.75	0.59
34	601009	南京银行	3,438,928	34,010,997.92	0.59
35	688012	中微公司	72,214	33,832,259.00	0.59
36	688521	芯原股份	91,080	33,803,431.20	0.59
37	600900	长江电力	1,268,125	33,567,268.75	0.58
38	601939	建设银行	3,428,240	33,013,951.20	0.57
39	000975	山金国际	1,909,400	32,459,800.00	0.56
40	600026	中远海能	1,777,300	31,884,762.00	0.55
41	000988	华工科技	172,333	31,814,395.13	0.55
42	601318	中国平安	663,889	31,694,060.86	0.55
43	600233	圆通速递	1,983,300	31,236,975.00	0.54

44	002049	紫光国微	346,316	30,735,545.00	0.53
45	300014	亿纬锂能	472,354	30,717,180.62	0.53
46	601058	赛轮轮胎	2,586,900	29,826,957.00	0.52
47	600999	招商证券	1,403,383	29,611,381.30	0.51
48	300274	阳光电源	183,539	29,186,371.78	0.51
49	601838	成都银行	1,575,400	27,884,580.00	0.48
50	600809	山西汾酒	241,000	26,358,170.00	0.46
51	002415	海康威视	764,567	26,148,191.40	0.45
52	000792	盐湖股份	863,647	26,073,502.93	0.45
53	002460	赣锋锂业	397,969	26,027,172.60	0.45
54	300476	胜宏科技	74,595	25,841,945.85	0.45
55	002558	巨人网络	928,800	25,597,728.00	0.44
56	000776	广发证券	1,070,928	25,059,715.20	0.43
57	000807	云铝股份	1,111,300	24,604,182.00	0.43
58	002493	荣盛石化	2,248,700	24,173,525.00	0.42
59	000100	TCL 科技	3,816,137	22,209,917.34	0.39
60	600741	华域汽车	1,391,201	21,591,439.52	0.37
61	002142	宁波银行	711,417	21,121,970.73	0.37
62	600489	中金黄金	1,164,694	21,022,726.70	0.36
63	601988	中国银行	3,668,920	20,986,222.40	0.36
64	601117	中国化学	2,836,794	20,850,435.90	0.36
65	600989	宝丰能源	1,021,900	20,775,227.00	0.36
66	600015	华夏银行	3,218,778	20,567,991.42	0.36
67	002938	鹏鼎控股	191,500	20,180,270.00	0.35
68	600547	山东黄金	873,117	20,160,271.53	0.35
69	601360	三六零	2,255,872	19,603,527.68	0.34
70	688472	阿特斯	1,798,353	19,458,179.46	0.34
71	002028	思源电气	111,300	19,254,900.00	0.33
72	000725	京东方 A	2,216,621	19,240,270.28	0.33
73	601166	兴业银行	1,130,100	18,714,456.00	0.32
74	002648	卫星化学	761,900	17,897,031.00	0.31
75	300408	三环集团	104,100	17,374,290.00	0.30
76	600893	航发动力	450,700	17,279,838.00	0.30
77	000408	藏格矿业	239,362	16,592,573.84	0.29
78	600570	恒生电子	767,922	16,272,267.18	0.28
79	003816	中国广核	4,124,200	16,125,622.00	0.28
80	601985	中国核电	1,738,000	15,694,140.00	0.27
81	000338	潍柴动力	566,000	15,423,500.00	0.27
82	001965	招商公路	1,633,370	14,961,669.20	0.26
83	601127	赛力斯	241,700	14,804,125.00	0.26
84	000977	浪潮信息	208,200	14,574,000.00	0.25

85	002475	立讯精密	199,423	14,039,379.20	0.24
86	300394	天孚通信	45,994	13,921,463.92	0.24
87	600875	东方电气	481,700	13,858,509.00	0.24
88	601688	华泰证券	671,401	13,844,288.62	0.24
89	002736	国信证券	1,371,897	13,705,251.03	0.24
90	000001	平安银行	1,311,500	13,180,575.00	0.23
91	600030	中信证券	456,199	13,106,597.27	0.23
92	600515	海南机场	4,773,730	13,080,020.20	0.23
93	600438	通威股份	1,067,300	12,925,003.00	0.22
94	601668	中国建筑	2,937,000	12,746,580.00	0.22
95	601288	农业银行	2,084,668	12,653,934.76	0.22
96	600150	中国船舶	357,909	12,093,745.11	0.21
97	300413	芒果超媒	825,600	12,078,528.00	0.21
98	600011	华能国际	1,570,258	11,918,258.22	0.21
99	600584	长电科技	113,800	11,783,990.00	0.20
100	601328	交通银行	1,804,863	11,605,269.09	0.20
101	688041	海光信息	30,850	11,423,755.00	0.20
102	600938	中国海油	418,600	11,364,990.00	0.20
103	002625	光启技术	362,895	11,002,976.40	0.19
104	601077	渝农商行	1,798,600	10,989,446.00	0.19
105	601100	恒立液压	102,130	10,985,102.80	0.19
106	601658	邮储银行	2,223,400	10,961,362.00	0.19
107	300316	晶盛机电	180,900	10,926,360.00	0.19
108	601229	上海银行	1,224,372	10,627,548.96	0.18
109	605499	东鹏饮料	82,660	10,202,723.80	0.18
110	000596	古井贡酒	126,700	10,110,660.00	0.18
111	000938	紫光股份	343,100	9,901,866.00	0.17
112	002001	新 和 成	340,144	9,666,892.48	0.17
113	600941	中国移动	109,400	9,422,622.00	0.16
114	601995	中金公司	260,000	9,399,000.00	0.16
115	600016	民生银行	2,855,819	9,195,737.18	0.16
116	600000	浦发银行	1,054,053	9,075,396.33	0.16
117	603369	今世缘	377,600	8,952,896.00	0.16
118	000768	中航西飞	435,700	8,923,136.00	0.15
119	600926	杭州银行	590,501	8,532,739.45	0.15
120	002050	三花智控	191,841	8,408,391.03	0.15
121	000657	中钨高新	85,500	8,184,060.00	0.14
122	300124	汇川技术	120,500	7,992,765.00	0.14
123	600023	浙能电力	1,517,321	7,981,108.46	0.14
124	600089	特变电工	351,100	7,899,750.00	0.14
125	601877	正泰电器	308,400	7,731,588.00	0.13

126	000963	华东医药	274,400	7,716,128.00	0.13
127	603501	豪威集团	77,815	7,380,752.75	0.13
128	000708	中信特钢	584,200	7,372,604.00	0.13
129	601888	中国中免	136,700	7,342,157.00	0.13
130	600886	国投电力	542,500	7,220,675.00	0.13
131	600887	伊利股份	292,200	7,001,112.00	0.12
132	002600	领益智造	398,493	6,909,868.62	0.12
133	002353	杰瑞股份	44,500	6,786,250.00	0.12
134	600050	中国联通	1,695,100	6,780,400.00	0.12
135	600219	南山铝业	1,591,600	6,350,484.00	0.11
136	300251	光线传媒	571,300	6,335,717.00	0.11
137	601628	中国人寿	175,653	6,209,333.55	0.11
138	601916	浙商银行	2,357,100	6,199,173.00	0.11
139	688223	晶科能源	1,289,418	6,124,735.50	0.11
140	600795	国电电力	1,303,600	6,087,812.00	0.11
141	600426	华鲁恒升	251,100	6,006,312.00	0.10
142	601600	中国铝业	727,450	5,979,639.00	0.10
143	002241	歌尔股份	265,384	5,979,101.52	0.10
144	600025	华能水电	640,862	5,697,263.18	0.10
145	000630	铜陵有色	863,300	5,490,588.00	0.10
146	603893	瑞芯微	27,083	5,101,353.88	0.09
147	300628	亿联网络	149,200	5,045,944.00	0.09
148	688271	联影医疗	49,566	5,017,566.18	0.09
149	688981	中芯国际	31,529	5,007,435.78	0.09
150	601169	北京银行	1,019,776	4,996,902.40	0.09
151	000895	双汇发展	221,285	4,956,784.00	0.09
152	601766	中国中车	943,142	4,904,338.40	0.09
153	601336	新华保险	81,700	4,874,222.00	0.08
154	600660	福耀玻璃	95,222	4,802,997.68	0.08
155	600019	宝钢股份	881,707	4,787,669.01	0.08
156	000301	东方盛虹	405,800	4,646,410.00	0.08
157	601059	信达证券	282,449	4,572,849.31	0.08
158	002027	分众传媒	912,900	4,418,436.00	0.08
159	002179	中航光电	94,029	4,344,139.80	0.08
160	600027	华电国际	975,500	4,340,975.00	0.08
161	601818	光大银行	1,450,700	4,192,523.00	0.07
162	300498	温氏股份	339,461	4,182,159.52	0.07
163	600066	宇通客车	147,100	3,943,751.00	0.07
164	601006	大秦铁路	850,819	3,922,275.59	0.07
165	002236	大华股份	231,000	3,809,190.00	0.07
166	600028	中国石化	847,400	3,779,404.00	0.07

167	601825	沪农商行	480,600	3,599,694.00	0.06
168	603296	华勤技术	47,900	3,557,533.00	0.06
169	688506	百利天恒	11,739	3,451,618.17	0.06
170	601319	中国人保	502,843	3,399,218.68	0.06
171	002594	比亚迪	42,586	3,394,104.20	0.06
172	601607	上海医药	220,000	3,388,000.00	0.06
173	600118	中国卫星	40,700	3,339,435.00	0.06
174	300803	指南针	35,000	3,208,450.00	0.06
175	002074	国轩高科	112,200	3,086,622.00	0.05
176	601088	中国神华	77,800	3,037,312.00	0.05
177	600415	小商品城	293,300	2,979,928.00	0.05
178	300442	润泽科技	35,700	2,965,599.00	0.05
179	600115	中国东航	774,200	2,949,702.00	0.05
180	002422	科伦药业	68,500	2,638,620.00	0.05
181	600690	海尔智家	124,200	2,534,922.00	0.04
182	300450	先导智能	58,000	2,361,760.00	0.04
183	688047	龙芯中科	15,148	2,342,941.16	0.04
184	601998	中信银行	335,200	2,322,936.00	0.04
185	603019	中科曙光	21,383	2,292,899.09	0.04
186	601816	京沪高铁	502,800	2,277,684.00	0.04
187	600585	海螺水泥	129,300	2,191,635.00	0.04
188	002714	牧原股份	61,835	2,163,606.65	0.04
189	601919	中远海控	159,200	2,110,992.00	0.04
190	002352	顺丰控股	64,000	2,000,640.00	0.03
191	688036	传音控股	33,557	1,978,185.15	0.03
192	002920	德赛西威	23,600	1,923,400.00	0.03
193	600918	中泰证券	349,400	1,858,808.00	0.03
194	601633	长城汽车	117,700	1,776,093.00	0.03
195	600039	四川路桥	225,600	1,764,192.00	0.03
196	601225	陕西煤业	77,405	1,575,191.75	0.03
197	600061	国投资本	232,300	1,521,565.00	0.03
198	601857	中国石油	173,500	1,505,980.00	0.03
199	000568	泸州老窖	19,050	1,476,756.00	0.03
200	600482	中国动力	44,200	1,449,760.00	0.03
201	603392	万泰生物	52,800	1,424,016.00	0.02
202	600905	三峡能源	373,300	1,384,943.00	0.02
203	000999	华润三九	60,900	1,369,641.00	0.02
204	002202	金风科技	55,022	1,315,025.80	0.02
205	601111	中国国航	217,200	1,314,060.00	0.02
206	600276	恒瑞医药	25,226	1,312,761.04	0.02
207	600031	三一重工	73,300	1,266,624.00	0.02

208	601601	中国太保	44,085	1,257,304.20	0.02
209	300122	智飞生物	103,400	1,208,746.00	0.02
210	600803	新奥股份	72,300	1,142,340.00	0.02
211	300059	东方财富	54,302	1,106,674.76	0.02
212	601878	浙商证券	113,400	1,077,300.00	0.02
213	601456	国联民生	120,700	1,066,988.00	0.02
214	001979	招商蛇口	164,800	1,059,664.00	0.02
215	601066	中信建投	34,400	1,000,008.00	0.02
216	601390	中国中铁	220,300	918,651.00	0.02
217	601898	中煤能源	74,900	912,282.00	0.02
218	600600	青岛啤酒	17,100	893,133.00	0.02
219	600372	中航机载	82,300	892,955.00	0.02
220	601377	兴业证券	147,300	889,692.00	0.02
221	600029	南方航空	155,000	802,900.00	0.01
222	600018	上港集团	163,300	770,776.00	0.01
223	000625	长安汽车	107,500	770,775.00	0.01
224	601728	中国电信	148,100	768,639.00	0.01
225	301165	锐捷网络	9,300	748,185.00	0.01
226	000157	中联重科	106,700	743,699.00	0.01
227	600522	中天科技	11,900	722,092.00	0.01
228	300760	迈瑞医疗	5,300	719,899.00	0.01
229	000538	云南白药	14,800	701,076.00	0.01
230	002304	洋河股份	17,500	667,625.00	0.01
231	600406	国电南瑞	28,500	651,225.00	0.01
232	601186	中国铁建	105,800	629,510.00	0.01
233	600188	兖矿能源	34,600	614,842.00	0.01
234	000858	五 粮 液	8,212	607,688.00	0.01
235	300999	金龙鱼	24,800	576,848.00	0.01
236	600104	上汽集团	58,700	572,912.00	0.01
237	300433	蓝思科技	500	26,830.00	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	688525	佰维存储	103,803	51,354,458.19	0.89
2	300972	万辰集团	198,875	34,486,913.75	0.60
3	002653	海思科	509,600	33,806,864.00	0.59
4	300438	鹏辉能源	374,500	31,027,325.00	0.54
5	688002	睿创微纳	180,821	27,971,200.49	0.49
6	300223	君正股份	97,600	24,292,640.00	0.42

7	688498	源杰科技	12,021	22,671,606.00	0.39
8	688578	艾力斯	201,062	21,955,970.40	0.38
9	301536	星辰科技	167,600	21,571,796.00	0.37
10	688331	荣昌生物	150,715	19,632,135.90	0.34
11	688221	前沿生物	856,274	19,180,537.60	0.33
12	605599	菜百股份	1,395,690	19,120,953.00	0.33
13	688519	南亚新材	49,984	18,995,919.36	0.33
14	600487	亨通光电	165,300	18,073,902.00	0.31
15	300953	震裕科技	133,320	17,824,884.00	0.31
16	002738	中矿资源	287,400	16,953,726.00	0.29
17	603507	振江股份	511,700	16,829,813.00	0.29
18	002379	宏桥控股	1,070,800	15,815,716.00	0.27
19	000415	渤海租赁	3,725,200	15,161,564.00	0.26
20	001389	广合科技	60,400	14,329,900.00	0.25
21	601512	中新集团	1,780,700	13,889,460.00	0.24
22	688428	诺诚健华	478,728	13,629,386.16	0.24
23	002497	雅化集团	636,582	12,967,175.34	0.22
24	300724	捷佳伟创	181,700	12,828,020.00	0.22
25	688266	泽璟制药	108,694	12,680,242.04	0.22
26	600418	江淮汽车	486,600	12,568,878.00	0.22
27	301216	万凯新材	540,450	12,424,945.50	0.22
28	003010	若羽臣	504,000	12,247,200.00	0.21
29	301200	大族数控	32,400	11,685,060.00	0.20
30	688326	经纬恒润	163,763	11,607,521.44	0.20
31	301031	中熔电气	94,878	11,333,177.10	0.20
32	300926	博俊科技	619,918	11,003,544.50	0.19
33	688235	百济神州	43,065	10,964,779.65	0.19
34	688503	聚和材料	78,935	10,474,674.50	0.18
35	603057	紫燕食品	447,400	9,977,020.00	0.17
36	688052	纳芯微	34,128	9,839,443.68	0.17
37	603619	中曼石油	502,900	9,409,259.00	0.16
38	300054	鼎龙股份	85,900	9,102,823.00	0.16
39	301377	鼎泰高科	15,900	8,759,310.00	0.15
40	600502	安徽建工	1,893,420	8,236,377.00	0.14
41	600299	安迪苏	1,012,030	7,944,435.50	0.14
42	300483	首华燃气	428,400	7,531,272.00	0.13
43	002780	三夫户外	604,600	7,339,844.00	0.13
44	688795	摩尔线程	10,828	7,329,906.32	0.13
45	688301	奕瑞科技	56,249	6,974,876.00	0.12
46	300373	扬杰科技	44,000	6,918,120.00	0.12
47	300604	长川科技	19,000	6,486,980.00	0.11

48	300037	新宙邦	69,600	6,462,360.00	0.11
49	300857	协创数据	18,700	6,356,130.00	0.11
50	000729	燕京啤酒	617,000	6,250,210.00	0.11
51	002266	浙富控股	1,229,500	6,221,270.00	0.11
52	002345	潮宏基	665,100	6,098,967.00	0.11
53	688717	艾罗能源	72,803	6,011,343.71	0.10
54	688127	蓝特光学	60,484	5,903,238.40	0.10
55	002245	蔚蓝锂芯	313,000	5,856,230.00	0.10
56	603256	宏和科技	21,500	5,704,595.00	0.10
57	688516	奥特维	98,179	5,634,492.81	0.10
58	002803	吉宏股份	212,400	5,488,416.00	0.10
59	300277	汽轮科技	355,341	5,344,328.64	0.09
60	688390	固德威	48,374	5,249,062.74	0.09
61	601339	百隆东方	772,300	5,228,471.00	0.09
62	601567	三星电气	342,600	5,118,444.00	0.09
63	300740	水羊股份	272,491	5,016,559.31	0.09
64	688502	茂莱光学	6,765	4,692,204.00	0.08
65	300129	泰胜风能	542,700	4,640,085.00	0.08
66	688102	斯瑞新材	97,544	4,602,125.92	0.08
67	300850	新强联	162,200	4,346,960.00	0.08
68	301101	明月镜片	153,500	4,181,340.00	0.07
69	601598	中国外运	829,500	4,114,320.00	0.07
70	688196	卓越新能	110,559	3,969,068.10	0.07
71	300049	福瑞医科	100,700	3,915,216.00	0.07
72	300842	帝科股份	43,600	3,887,812.00	0.07
73	688536	思瑞浦	10,513	3,827,678.17	0.07
74	002402	和而泰	146,533	3,784,947.39	0.07
75	605090	九丰能源	99,500	3,698,415.00	0.06
76	600885	宏发股份	107,165	3,696,120.85	0.06
77	300677	英科医疗	91,900	3,599,723.00	0.06
78	600988	赤峰黄金	130,600	3,437,392.00	0.06
79	600096	云天化	110,100	3,347,040.00	0.06
80	002850	科达利	17,400	3,293,820.00	0.06
81	603345	安井食品	40,800	3,271,752.00	0.06
82	300492	华图山鼎	91,400	3,139,590.00	0.05
83	002273	水晶光电	87,468	3,103,364.64	0.05
84	688802	沐曦股份	3,994	3,070,946.66	0.05
85	001914	招商积余	376,200	3,069,792.00	0.05
86	002364	中恒电气	55,100	2,964,380.00	0.05
87	001339	智微智能	28,660	2,931,344.80	0.05
88	688279	峰昭科技	12,979	2,913,006.76	0.05

89	000534	万泽股份	105,400	2,883,744.00	0.05
90	002946	新乳业	197,100	2,775,168.00	0.05
91	002020	京新药业	206,200	2,575,438.00	0.04
92	688783	西安奕材	44,370	2,547,725.40	0.04
93	603127	昭衍新药	66,600	2,545,452.00	0.04
94	688556	高测股份	187,322	2,487,636.16	0.04
95	300017	网宿科技	187,600	2,440,676.00	0.04
96	688220	翱捷科技	19,168	2,382,965.76	0.04
97	002240	盛新锂能	51,700	2,317,711.00	0.04
98	688025	杰普特	4,800	2,256,000.00	0.04
99	600655	豫园股份	546,600	2,246,526.00	0.04
100	000426	兴业银锡	67,500	2,224,800.00	0.04
101	002851	麦格米特	13,000	2,173,340.00	0.04
102	000933	神火股份	101,500	2,151,800.00	0.04
103	300207	欣旺达	106,100	2,014,839.00	0.03
104	002064	华峰化学	205,600	1,951,144.00	0.03
105	301061	匠心家居	54,400	1,907,808.00	0.03
106	300347	泰格医药	38,700	1,857,600.00	0.03
107	688486	龙迅股份	29,089	1,849,478.62	0.03
108	301607	富特科技	35,220	1,840,245.00	0.03
109	601808	中海油服	165,600	1,790,136.00	0.03
110	688099	晶晨股份	16,874	1,736,334.60	0.03
111	000962	东方钨业	19,100	1,730,460.00	0.03
112	301371	敷尔佳	66,100	1,718,600.00	0.03
113	002025	航天电器	21,200	1,615,864.00	0.03
114	002409	雅克科技	7,100	1,593,950.00	0.03
115	603063	禾望电气	30,100	1,591,989.00	0.03
116	603650	彤程新材	15,900	1,557,882.00	0.03
117	002531	天顺风能	182,200	1,535,946.00	0.03
118	601869	长飞光纤	2,700	1,473,930.00	0.03
119	600350	山东高速	126,300	1,405,719.00	0.02
120	300568	星源材质	72,300	1,353,456.00	0.02
121	603889	新澳股份	261,980	1,338,717.80	0.02
122	300416	苏试试验	64,700	1,318,586.00	0.02
123	600563	法拉电子	6,900	1,316,520.00	0.02
124	000983	山西焦煤	223,400	1,295,720.00	0.02
125	002429	兆驰股份	121,500	1,262,385.00	0.02
126	301093	华兰股份	9,300	1,261,359.00	0.02
127	002922	伊戈尔	38,200	1,252,960.00	0.02
128	600201	生物股份	105,600	1,230,240.00	0.02
129	300672	国科微	4,100	1,209,500.00	0.02

130	002271	东方雨虹	101,300	1,202,431.00	0.02
131	002536	飞龙股份	24,800	1,170,064.00	0.02
132	002170	芭田股份	107,600	1,168,536.00	0.02
133	600391	航发科技	34,400	1,150,680.00	0.02
134	002080	中材科技	12,300	1,107,000.00	0.02
135	601577	长沙银行	126,200	1,099,202.00	0.02
136	002301	齐心集团	149,700	1,082,331.00	0.02
137	603737	三棵树	44,700	1,077,270.00	0.02
138	601611	中国核建	96,300	1,073,745.00	0.02
139	600125	铁龙物流	205,300	1,040,871.00	0.02
140	000039	中集集团	127,700	1,035,647.00	0.02
141	002643	万润股份	46,600	976,270.00	0.02
142	600377	宁沪高速	81,500	942,955.00	0.02
143	002674	兴业科技	32,700	932,931.00	0.02
144	688372	伟测科技	4,947	920,142.00	0.02
145	002158	汉钟精机	23,900	886,212.00	0.02
146	002534	西子洁能	46,900	869,995.00	0.02
147	001248	华润新能源	84,104	850,291.44	0.01
148	603998	方盛制药	93,000	839,790.00	0.01
149	002438	江苏神通	55,500	828,615.00	0.01
150	603505	金石资源	40,700	820,105.00	0.01
151	688409	富创精密	2,659	814,318.75	0.01
152	002212	天融信	135,400	809,692.00	0.01
153	002747	埃斯顿	21,400	798,862.00	0.01
154	002706	良信股份	71,900	784,429.00	0.01
155	000848	承德露露	100,700	745,180.00	0.01
156	603214	爱婴室	61,200	741,132.00	0.01
157	300693	盛弘股份	13,700	667,875.00	0.01
158	688700	东威科技	7,457	666,655.80	0.01
159	000726	鲁 泰 A	120,600	654,858.00	0.01
160	002615	哈尔斯	94,600	652,740.00	0.01
161	000429	粤高速 A	46,300	631,995.00	0.01
162	688507	索辰科技	2,325	627,006.00	0.01
163	002865	钧达股份	10,400	620,672.00	0.01
164	603281	江瀚新材	15,100	613,513.00	0.01
165	301291	明阳电气	17,000	611,830.00	0.01
166	603808	歌力思	79,900	604,843.00	0.01
167	001203	大中矿业	19,400	581,030.00	0.01
168	688510	航亚科技	24,029	573,812.52	0.01
169	603187	海容冷链	49,200	565,308.00	0.01
170	300984	金沃股份	10,500	564,165.00	0.01

171	002949	华阳国际	56,000	553,840.00	0.01
172	688063	派能科技	10,280	547,615.60	0.01
173	600057	厦门象屿	99,700	540,374.00	0.01
174	300593	新雷能	17,800	535,068.00	0.01
175	603566	普莱柯	54,500	533,555.00	0.01
176	603323	苏农银行	136,400	527,868.00	0.01
177	688480	赛恩斯	5,594	489,978.46	0.01
178	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.01
179	688790	昂瑞微	2,319	293,237.55	0.01
180	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.00
181	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.00
182	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.00
183	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
184	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
185	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
186	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
187	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
188	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
189	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
190	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
191	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
192	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
193	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
194	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
195	603163	圣晖集成	100	14,650.00	0.00
196	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
197	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
198	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
199	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
200	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
201	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
202	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
203	002595	豪迈科技	85	3,961.00	0.00
204	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
205	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
206	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
207	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	002475	立讯精密	299,473,064.35	5.05
2	300750	宁德时代	233,200,850.20	3.93
3	300308	中际旭创	230,860,396.00	3.90
4	002371	北方华创	214,698,858.60	3.62
5	300274	阳光电源	207,646,413.41	3.50
6	600150	中国船舶	204,096,777.05	3.44
7	002463	沪电股份	169,716,834.26	2.86
8	603259	药明康德	157,352,830.68	2.66
9	688256	寒武纪	156,249,543.83	2.64
10	603993	洛阳钼业	155,723,827.00	2.63
11	600887	伊利股份	153,413,144.00	2.59
12	601138	工业富联	151,887,630.00	2.56
13	600519	贵州茅台	149,719,849.66	2.53
14	000651	格力电器	146,408,935.00	2.47
15	002384	东山精密	140,544,900.00	2.37
16	000977	浪潮信息	140,232,071.08	2.37
17	002466	天齐锂业	139,526,569.78	2.35
18	002916	深南电路	138,894,075.47	2.34
19	002050	三花智控	138,623,869.00	2.34
20	300502	新易盛	137,643,357.20	2.32
21	600183	生益科技	131,552,544.91	2.22
22	600938	中国海油	131,504,044.00	2.22
23	300476	胜宏科技	129,945,983.25	2.19
24	600030	中信证券	123,161,826.05	2.08
25	601127	赛力斯	122,708,183.38	2.07
26	000338	潍柴动力	122,329,033.00	2.06
27	601899	紫金矿业	122,087,010.00	2.06

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	002475	立讯精密	356,896,952.24	6.02
2	300750	宁德时代	260,325,799.40	4.39
3	002371	北方华创	239,648,106.20	4.04

4	300274	阳光电源	224,454,462.57	3.79
5	600887	伊利股份	218,167,001.21	3.68
6	600519	贵州茅台	205,119,700.30	3.46
7	600150	中国船舶	199,306,031.54	3.36
8	601899	紫金矿业	196,946,328.65	3.32
9	300308	中际旭创	190,736,810.33	3.22
10	600938	中国海油	189,358,158.05	3.20
11	601318	中国平安	186,830,451.90	3.15
12	603019	中科曙光	174,498,530.43	2.94
13	000333	美的集团	167,402,220.60	2.82
14	603993	洛阳钼业	167,280,286.00	2.82
15	600183	生益科技	163,592,962.30	2.76
16	002463	沪电股份	160,647,716.49	2.71
17	601138	工业富联	157,321,772.50	2.65
18	688256	寒武纪	152,335,563.44	2.57
19	600309	万华化学	151,399,381.96	2.55
20	000338	潍柴动力	144,242,344.00	2.43
21	002050	三花智控	143,489,290.54	2.42
22	603259	药明康德	142,434,964.77	2.40
23	300476	胜宏科技	138,829,186.00	2.34
24	300502	新易盛	135,808,660.11	2.29
25	600030	中信证券	134,107,961.00	2.26
26	600584	长电科技	132,216,111.90	2.23
27	000977	浪潮信息	130,955,472.00	2.21
28	600362	江西铜业	130,177,766.84	2.20
29	688041	海光信息	127,875,054.39	2.16
30	000408	藏格矿业	123,350,264.04	2.08
31	000651	格力电器	122,084,560.63	2.06
32	002916	深南电路	120,436,446.76	2.03
33	000063	中兴通讯	119,945,355.98	2.02
34	300433	蓝思科技	118,989,533.10	2.01

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	21,072,663,652.02
卖出股票收入（成交）总额	21,863,886,051.05

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

在法律法规许可时，本基金可基于谨慎原则运用权证、股票指数期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以控制并降低投资组合风险、提高投资效率，降低跟踪误差，从而更好地实现本基金的投资目标。

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

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

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制

度的要求。基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

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

7.12.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,205,417.36
2	应收清算款	65,775.51
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	6,293,820.27
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	7,565,013.14

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(%)
富国沪深 300 指数增强 A/B	720,836	3,226.06	398,887,488.69	17.15	1,926,575,766.08	82.85
富国沪深 300 指数增强 C	164,993	2,388.83	268,532,602.78	68.13	125,607,577.02	31.87
富国沪深 300 指数增强 Y	12,234	3,772.47	—	—	46,152,448.10	100.00
合计	898,063	3,079.69	667,420,091.47	24.13	2,098,335,791.20	75.87

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	富国沪深 300 指数增强 A/B	2,816,995.17	0.1211
	富国沪深 300 指数增强 C	19,974.97	0.0051
	富国沪深 300 指数增强 Y	185,456.04	0.4018
	合计	3,022,426.18	0.1093

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	富国沪深 300 指数增强 A/B	>100
	富国沪深 300 指数增强 C	0
	富国沪深 300 指数增强 Y	0~10
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	富国沪深 300 指数增强 A/B	50~100
	富国沪深 300 指数增强 C	0
	富国沪深 300 指数增强 Y	0~10
	合计	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	富国沪深 300 指数 增强 A/B	富国沪深 300 指数 增强 C	富国沪深 300 指数 增强 Y
基金合同生效日（2009 年 12 月 16 日）基金 份额总额	3,489,909,303.02	—	—
本报告期期初基金份额总额	2,593,858,047.69	546,753,330.59	27,491,155.10
本报告期基金总申购份额	371,534,061.57	320,861,164.87	28,735,496.62
减：本报告期基金总赎回份额	639,928,854.49	473,474,315.66	10,074,203.62
本报告期基金拆分变动份额	—	—	—
本报告期期末基金份额总额	2,325,463,254.77	394,140,179.80	46,152,448.10

§ 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。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产的诉讼。

本报告期，无基金托管业务需要承担民事或刑事责任的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内托管人无重大受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内托管人相关从业人员无重大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(%)	
长江证券	3	533,756,339.69	1.24	72,546.75	1.24	—
诚通证券	2	—	—	—	—	—
东吴证券	1	—	—	—	—	—
方正证券	2	2,340,799,652.37	5.45	318,120.28	5.45	—
广发证券	2	—	—	—	—	—
国都证券	2	—	—	—	—	—
国海证券	1	—	—	—	—	—
国盛证券	2	—	—	—	—	—
国泰海通	2	11,237,397,064.67	26.17	1,527,219.78	26.17	—
国元证券	1	—	—	—	—	—
华创证券	1	—	—	—	—	—
华泰证券	2	3,377,551,059.69	7.87	459,009.19	7.87	—
民生证券	2	—	—	—	—	—
瑞银证券	2	—	—	—	—	—
上海证券	2	—	—	—	—	—
申万宏源	2	6,309,255,054.89	14.70	857,665.30	14.70	—
西部证券	2	—	—	—	—	—
银河证券	2	2,350,399,714.64	5.47	319,445.21	5.47	—

招商证券	1	6,554,063,510.07	15.27	890,699.98	15.26	—
中金公司	2	3,899,431,350.67	9.08	529,944.46	9.08	—
中泰证券	3	—	—	—	—	—
中信建投	2	6,331,060,100.65	14.75	860,443.66	14.75	—
中信证券	1	—	—	—	—	—

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（39041）。

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（%）
长江证券	—	—	—	—	—	—
诚通证券	—	—	—	—	—	—
东吴证券	—	—	—	—	—	—
方正证券	—	—	—	—	—	—
广发证券	—	—	—	—	—	—
国都证券	—	—	—	—	—	—
国海证券	—	—	—	—	—	—
国盛证券	—	—	—	—	—	—
国泰海通	—	—	—	—	—	—
国元证券	—	—	—	—	—	—
华创证券	—	—	—	—	—	—
华泰证券	—	—	—	—	—	—
民生证券	—	—	—	—	—	—
瑞银证券	—	—	—	—	—	—
上海证券	—	—	—	—	—	—
申万宏源	1,064,206.37	42.44	—	—	—	—
西部证券	—	—	—	—	—	—
银河证券	115,464.18	4.60	—	—	—	—
招商证券	—	—	—	—	—	—

中金公司	—	—	—	—	—	—
中泰证券	—	—	—	—	—	—
中信建投	1,327,842.29	52.95	—	—	—	—
中信证券	—	—	—	—	—	—

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沪深300 增强证券投资基金的文件 2、富国沪深 300 增强证券投资基金基金合同 3、富国沪深 300 增强证券投资基金托管协议 4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件 5、富国沪深 300 增强证券投资基金财务报表及报表附注 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费）公司网址： http://www.fullgoal.com.cn 。