

富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)

二 0 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： 中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)		
基金简称	富国中证 500 指数增强 (LOF)		
场内简称	500 增强 LOF		
基金主代码	161017		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2011 年 10 月 12 日		
基金管理人	富国基金管理有限公司		
基金托管人	中国农业银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	2,849,156,738.87 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2011 年 10 月 21 日		
下属分级基金的基金简称	富国中证 500 指数增强 (LOF) A/B	富国中证 500 指数增强 (LOF) C	富国中证 500 指数增强 (LOF) Y
下属分级基金场内简称	500 增强 LOF	—	—
下属分级基金的交易代码	前端	后端	013332
	161017	161021	
报告期末下属分级基金的份额总额	2,392,081,914.31 份	453,361,586.75 份	3,713,237.81 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富国基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	任航
	联系电话	021-20361818	010-66060069
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		95105686、4008880688	95599
传真		021-20361616	010-68121816
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		200120	100031
法定代表人		裴长江	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告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 中国农业银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

(1) 富国中证 500 指数增强 (LOF) A/B

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	125,812,218.89
本期利润	203,070,400.85
加权平均基金份额本期利润	0.0745
本期加权平均净值利润率	3.82%
本期基金份额净值增长率	3.38%
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	2,434,932,322.28
期末可供分配基金份额利润	1.0179
期末基金资产净值	4,827,014,236.59
期末基金份额净值	2.018
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	186.46%

(2) 富国中证 500 指数增强 (LOF) C

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	23,791,649.50
本期利润	28,523,807.74
加权平均基金份额本期利润	0.0558
本期加权平均净值利润率	2.88%
本期基金份额净值增长率	3.30%
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	454,312,997.29
期末可供分配基金份额利润	1.0021
期末基金资产净值	907,674,584.04
期末基金份额净值	2.002
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	-9.50%

(3) 富国中证 500 指数增强 (LOF) Y

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	135,525.49
本期利润	308,006.81
加权平均基金份额本期利润	0.0987
本期加权平均净值利润率	5.04%
本期基金份额净值增长率	3.69%
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	3,802,403.20
期末可供分配基金份额利润	1.0240
期末基金资产净值	7,515,641.01
期末基金份额净值	2.024
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	1.56%

注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

(1) 富国中证 500 指数增强 (LOF) A/B

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.81%	0.62%	4.18%	0.76%	-0.37%	-0.14%
过去三个月	2.28%	1.31%	1.22%	1.43%	1.06%	-0.12%
过去六个月	3.38%	1.18%	3.71%	1.29%	-0.33%	-0.11%
过去一年	12.71%	1.49%	20.00%	1.64%	-7.29%	-0.15%
过去三年	-4.82%	1.20%	-4.84%	1.29%	0.02%	-0.09%
自基金合同生效起至今	186.46%	1.46%	77.37%	1.49%	109.09%	-0.03%

(2) 富国中证 500 指数增强 (LOF) C

阶段	份额净值增长	份额净值增长	业绩比较基准	业绩比较基准收益	①—③	②—④
----	--------	--------	--------	----------	-----	-----

	率①	率标准 差②	收益率 ③	率标准差 ④		
过去一个月	3.78%	0.61%	4.18%	0.76%	-0.40%	-0.15%
过去三个月	2.19%	1.32%	1.22%	1.43%	0.97%	-0.11%
过去六个月	3.30%	1.19%	3.71%	1.29%	-0.41%	-0.10%
过去一年	12.52%	1.50%	20.00%	1.64%	-7.48%	-0.14%
过去三年	-5.38%	1.20%	-4.84%	1.29%	-0.54%	-0.09%
自基金分级生效 日起至今	-9.50%	1.22%	-10.41%	1.29%	0.91%	-0.07%

(3) 富国中证 500 指数增强 (LOF) Y

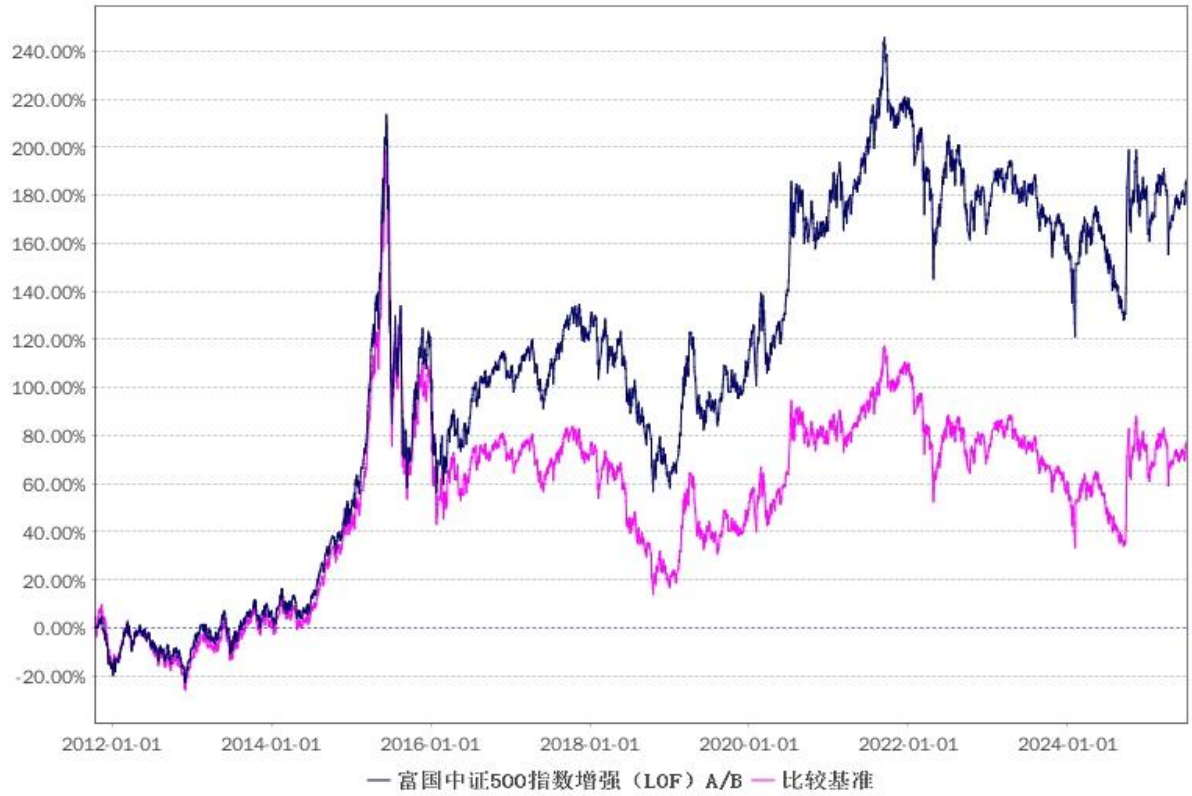
阶段	份额净 值增长 率①	份额净 值增长 率标准 差②	业绩比 较基准 收益率 ③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	3.85%	0.62%	4.18%	0.76%	-0.33%	-0.14%
过去三个月	2.38%	1.31%	1.22%	1.43%	1.16%	-0.12%
过去六个月	3.69%	1.19%	3.71%	1.29%	-0.02%	-0.10%
自基金分级生效 日起至今	1.56%	1.17%	-0.56%	1.28%	2.12%	-0.11%

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

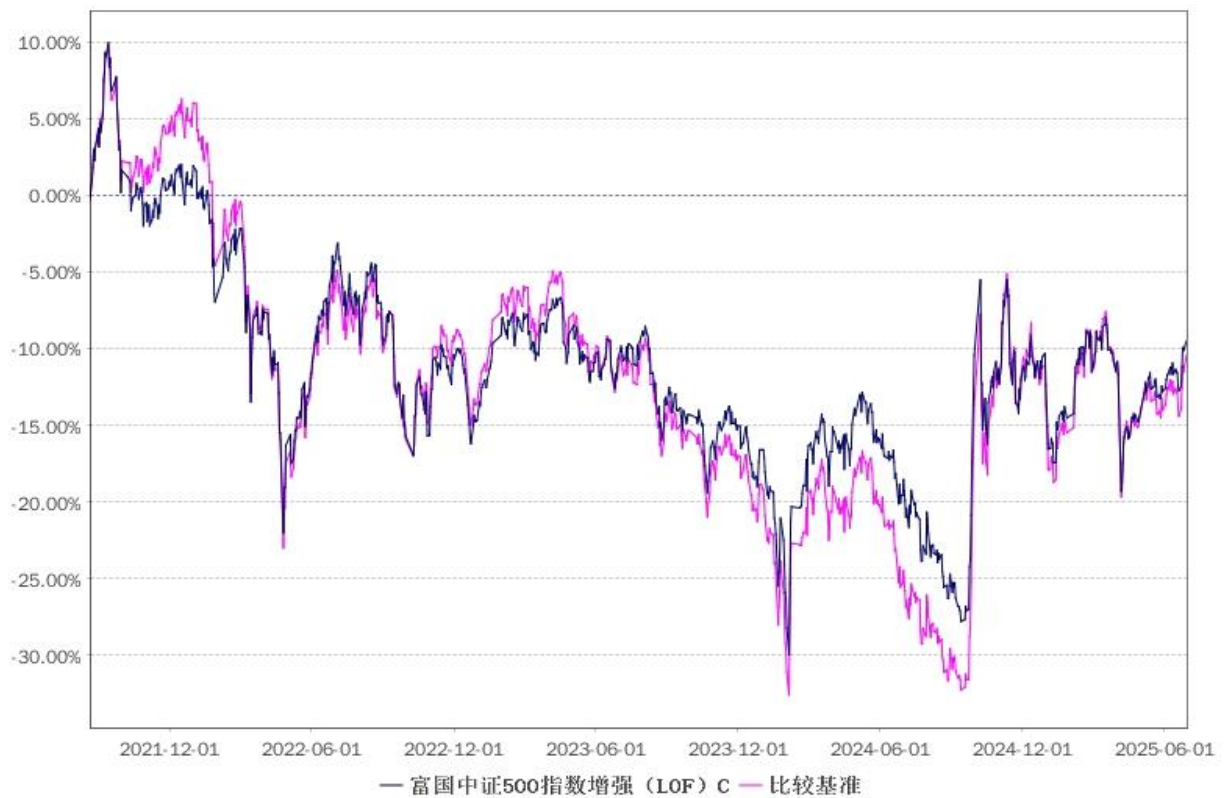
(1) 自基金合同生效以来富国中证 500 指数增强 (LOF) A/B 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2025 年 6 月 30 日。

2、本基金于 2011 年 10 月 12 日成立，建仓期 6 个月，从 2011 年 10 月 12 日起至 2012 年 4 月 11 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

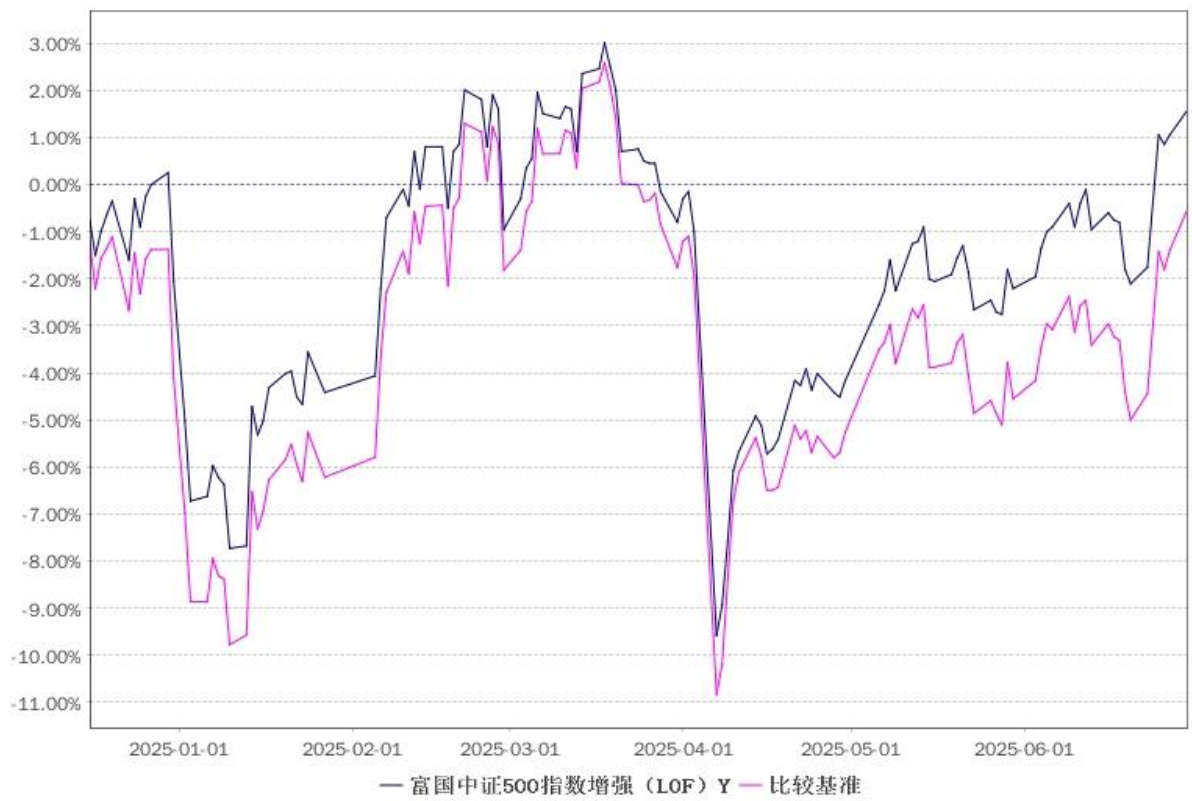
（2）自基金合同生效以来富国中证 500 指数增强 (LOF) C 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2025 年 6 月 30 日。

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

(3) 自基金合同生效以来富国中证 500 指数增强 (LOF) Y 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 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。

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		
徐幼华	本基金现任基金经理	2011-10-12	—	20	硕士，曾任上海京华创业投资有限公司投资部经理助理；自 2006 年 7 月加入富国基金管理有限公司，历任助理数量研究员、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副总监，量化与海外投资部量化投资总监；现任富国基金量化投资部副总经理，兼任富国基金资深定量基金经理。自 2011 年 05 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 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；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 2018 年 07 月起任富国大盘价值量化精选混合型证券投资基金基金经理；自 2018 年 12 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 2024 年 04 月起任富国 MSCI 中国 A50 互联互通增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2025 年 01 月起任富国中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。
李笑薇	本基金现任基金经理	2011-10-12	—	23	博士，曾任摩根士丹利资本国际 Barra 公司（MSCIBARRA）高级研究员，巴克莱国际投资管理公司 (BarclaysGlobal Investors) 大中华主动股票投资总监、高级基金经理及高级研究员；自 2009 年 6 月加入富国基金管理有限公司，历任量化与海外投资部总经理、基金经理、公司总经理助理；现任富国基金副

					总经理，兼任富国基金资深定量基金经理。自 2009 年 12 月起任富国沪深 300 增强证券投资基金基金经理；自 2011 年 10 月起任富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金经理；具有基金从业资格。
方旻	本基金现任基金经理	2014-11-19	—	15	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 2022 年 11 月起任富国中证 1000 优选股票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、公司已于 2025 年 8 月 12 日发布公告，徐幼华自 2025 年 8 月 8 日起不再担任本基金基金经理。

2、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。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据《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 53 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，中美一度进入“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 500 指数增强（LOF）A/B 为 2.018 元，富国中证 500 指数增强（LOF）C 为 2.002 元，富国中证 500 指数增强（LOF）Y 为 2.024 元；份额累计净值富国中证 500 指数增强（LOF）A/B 为 2.624 元，富国中证 500 指数增强（LOF）C 为 2.239 元，富国中证 500 指数增强（LOF）Y 为 2.024 元；本报告期，本基金份额净值增长率情况：富国中证 500 指数增强（LOF）A/B 为 3.38%，富国中证 500 指数增强（LOF）C 为 3.30%，富国中证 500 指数增强（LOF）Y 为 3.69%；同期业绩比较基准收益率情况：富国中证 500 指数增强（LOF）A/B 为 3.71%，富国中证 500 指数增强（LOF）C 为 3.71%，富国中证 500 指数增强（LOF）Y 为 3.71%。

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—富国基金管理有限公司报告期内基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，富国基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，富国基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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 500 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	310,260,765.80	481,601,879.16
结算备付金	18,315,641.96	30,391,391.43
存出保证金	1,191,143.11	1,909,908.62
交易性金融资产	5,438,584,294.51	6,828,407,602.21
其中：股票投资	5,434,515,837.03	6,823,837,137.14
基金投资	—	—
债券投资	4,068,457.48	4,570,465.07
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	31,425.33	3,312,397.84
应收股利	—	—
应收申购款	938,634.46	3,936,812.43
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	5,769,321,905.17	7,349,559,991.69
负债和净资产	本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 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	2.48	4,823,614.21
应付赎回款	19,379,603.61	13,960,088.40
应付管理人报酬	4,671,149.42	6,534,111.06
应付托管费	700,672.40	980,116.62
应付销售服务费	147,179.54	171,859.82
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	2,218,836.08	4,037,459.60
负债合计	27,117,443.53	30,507,249.71
净资产：		
实收基金	2,849,156,738.87	3,753,435,355.51
其他综合收益	—	—
未分配利润	2,893,047,722.77	3,565,617,386.47
净资产合计	5,742,204,461.64	7,319,052,741.98
负债和净资产总计	5,769,321,905.17	7,349,559,991.69

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.015 元，基金份额总额 2,849,156,738.87 份。其中：富国中证 500 指数增强（LOF）A/B 份额净值 2.018 元，份额总额 2,392,081,914.31 份；富国中证 500 指数增强（LOF）C 份额净值 2.002 元，份额总额 453,361,586.75 份；富国中证 500 指数增强（LOF）Y 份额净值 2.024 元，份额总额 3,713,237.81 份。

6.2 利润表

会计主体：富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)

本报告期：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	269,292,685.58	-372,801,272.48
1. 利息收入	950,472.99	2,491,584.92
其中：存款利息收入	950,472.99	2,491,584.92
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）	183,688,702.77	-233,142,826.37
其中：股票投资收益	110,911,592.82	-345,825,225.84
基金投资收益	—	—
债券投资收益	456,376.74	54,450.82
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	72,320,733.21	112,627,948.65
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）	82,162,821.52	-143,070,879.39
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	2,490,688.30	920,848.36
减：二、营业总支出	37,390,470.18	44,332,515.07
1. 管理人报酬	31,355,944.61	37,326,084.84
2. 托管费	4,703,391.70	5,598,912.78
3. 销售服务费	976,977.04	709,439.97
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	0.73	1.15
8. 其他费用	354,156.10	698,076.33
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	231,902,215.40	-417,133,787.55
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	231,902,215.40	-417,133,787.55
五、其他综合收益的税后净额	—	—
六、综合收益总额	231,902,215.40	-417,133,787.55

6.3 净资产变动表

会计主体：富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)

本报告期：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	3,753,435,355.51	3,565,617,386.47	7,319,052,741.98
二、本期期初净资产	3,753,435,355.51	3,565,617,386.47	7,319,052,741.98
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-904,278,616.64	-672,569,663.70	-1,576,848,280.34
(一)、综合收益总额	—	231,902,215.40	231,902,215.40
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-904,278,616.64	-904,471,879.10	-1,808,750,495.74
其中：1. 基金申购款	295,185,609.35	282,674,266.17	577,859,875.52

2. 基金赎回款	-1, 199, 464, 22 5. 99	-1, 187, 146, 14 5. 27	-2, 386, 610, 37 1. 26
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	—	—	—
(四)、其他综合收益结转留存收益	—	—	—
四、本期期末净资产	2, 849, 156, 738 . 87	2, 893, 047, 722 . 77	5, 742, 204, 461 . 64
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	3, 400, 265, 532 . 78	3, 801, 121, 675 . 96	7, 201, 387, 208 . 74
二、本期期初净资产	3, 400, 265, 532 . 78	3, 801, 121, 675 . 96	7, 201, 387, 208 . 74
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1, 370, 455, 161 . 56	1, 180, 576, 190 . 33	2, 551, 031, 351 . 89
(一)、综合收益总额	—	-417, 133, 787. 55	-417, 133, 787. 55
(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, 370, 455, 161 . 56	1, 597, 709, 977 . 88	2, 968, 165, 139 . 44
其中：1. 基金申购款	2, 090, 662, 512 . 03	2, 360, 078, 816 . 57	4, 450, 741, 328 . 60
2. 基金赎回款	-720, 207, 350. 47	-762, 368, 838. 69	-1, 482, 576, 18 9. 16
(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	4, 770, 720, 694 . 34	4, 981, 697, 866 . 29	9, 752, 418, 560 . 63

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
_____	_____	_____
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。其中，股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产的 90%，投资于中证 500 指数成份股和备选成份股的资产（均含存托凭证）不低于股票资产的 80%；保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁

布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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	310,260,765.80

等于：本金	310,229,157.97
加：应计利息	31,607.83
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	310,260,765.80

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		5,309,401,291.39	—	5,434,515,837.03	125,114,545.64
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	4,011,020.00	21,232.80	4,068,457.48	36,204.68
	银行间市场	—	—	—	—
	合计	4,011,020.00	21,232.80	4,068,457.48	36,204.68
资产支持证券		—	—	—	—
基金		—	—	—	—
其他		—	—	—	—
合计		5,313,412,311.39	21,232.80	5,438,584,294.51	125,150,750.32

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	67,242.79
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	1,745,956.66
其中：交易所市场	1,745,956.66
银行间市场	—
应付利息	—
预提信息披露费	60,000.00
预提审计费	101,720.30
应付指数使用费	243,916.33
合计	2,218,836.08

6.4.7.7 实收基金

富国中证 500 指数增强（LOF）A/B：

金额单位：人民币元

项目	本期（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	3,241,973,482.36	3,241,973,482.36
本期申购	142,700,875.47	142,700,875.47
本期赎回（以“-”号填列）	-992,592,443.52	-992,592,443.52
本期末	2,392,081,914.31	2,392,081,914.31

富国中证 500 指数增强（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	510,247,925.66	510,247,925.66
本期申购	149,406,749.17	149,406,749.17
本期赎回（以“-”号填列）	-206,293,088.08	-206,293,088.08
本期末	453,361,586.75	453,361,586.75

富国中证 500 指数增强（LOF）Y：

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	1, 213, 947. 49	1, 213, 947. 49
本期申购	3, 077, 984. 71	3, 077, 984. 71
本期赎回（以“-”号填列）	-578, 694. 39	-578, 694. 39
本期末	3, 713, 237. 81	3, 713, 237. 81

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

富国中证 500 指数增强（LOF）A/B：

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3, 525, 502, 533. 48	-439, 862, 766. 70	3, 085, 639, 766. 78
本期期初	3, 525, 502, 533. 48	-439, 862, 766. 70	3, 085, 639, 766. 78
本期利润	125, 812, 218. 89	77, 258, 181. 96	203, 070, 400. 85
本期基金份额交易产生的变动数	-951, 291, 605. 06	97, 513, 759. 71	-853, 777, 845. 35
其中：基金申购款	158, 013, 025. 28	-25, 199, 754. 37	132, 813, 270. 91
基金赎回款	-1, 109, 304, 630. 34	122, 713, 514. 08	-986, 591, 116. 26
本期已分配利润	—	—	—
本期末	2, 700, 023, 147. 31	-265, 090, 825. 03	2, 434, 932, 322. 28

富国中证 500 指数增强（LOF）C：

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	548, 201, 750. 68	-69, 379, 775. 96	478, 821, 974. 72
本期期初	548, 201, 750. 68	-69, 379, 775. 96	478, 821, 974. 72
本期利润	23, 791, 649. 50	4, 732, 158. 24	28, 523, 807. 74
本期基金份额交易产生的变动数	-67, 206, 578. 73	14, 173, 793. 56	-53, 032, 785. 17
其中：基金申购款	162, 733, 680. 59	-15, 777, 343. 42	146, 956, 337. 17
基金赎回款	-229, 940, 259. 32	29, 951, 136. 98	-199, 989, 122. 34
本期已分配利润	—	—	—
本期末	504, 786, 821. —	-50, 473, 824. —	454, 312, 997. 29

	45	. 16	
--	----	------	--

富国中证 500 指数增强 (LOF) Y:

单位: 人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1, 320, 324. 09	-164, 679. 12	1, 155, 644. 97
本期期初	1, 320, 324. 09	-164, 679. 12	1, 155, 644. 97
本期利润	135, 525. 49	172, 481. 32	308, 006. 81
本期基金份额交易产生的变动数	2, 757, 454. 17	-418, 702. 75	2, 338, 751. 42
其中: 基金申购款	3, 404, 808. 96	-500, 150. 87	2, 904, 658. 09
基金赎回款	-647, 354. 79	81, 448. 12	-565, 906. 67
本期已分配利润	—	—	—
本期末	4, 213, 303. 75	-410, 900. 55	3, 802, 403. 20

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	896, 580. 86
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	38, 755. 08
其他	15, 137. 05
合计	950, 472. 99

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	17, 827, 648, 916. 13
减: 卖出股票成本总额	17, 701, 011, 690. 24
减: 交易费用	15, 725, 633. 07
买卖股票差价收入	110, 911, 592. 82

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	123, 689. 99
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	332, 686. 75
合计	456, 376. 74

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期（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	85,288,832.78
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	84,397,080.00
减：应计利息总额	559,002.72
减：交易费用	63.31
买卖债券差价收入	332,686.75

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	72,320,733.21
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	72,320,733.21

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	82,162,821.52
股票投资	82,125,266.84
债券投资	37,554.68
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	82,162,821.52

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	1,803,707.74
基金转换费收入	686,980.56
合计	2,490,688.30

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	33,720.30
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	15,498.02
指数使用费	243,916.33
其他	1,021.45
合计	354,156.10

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
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	基金托管人、基金代销机构
富国鑫汇养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）	纳入基金管理人合并财务报表合并范围内的证券投资基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。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	3,809,878,333.55	11.19	—	—
海通证券	598,278,858.76	1.76	1,473,295,066.24	6.75
申万宏源	1,434,423,692.46	4.21	1,428,868,484.76	6.55

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 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	517,873.86	11.19	517,873.86	29.66
海通证券	81,308.45	1.76	—	—
申万宏源	194,950.87	4.21	1.67	0.00
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	1,084,205.31	6.75	1,084,205.31	10.74
申万宏源	1,051,496.17	6.55	1,051,496.17	10.42

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	31,355,944.61	37,326,084.84
其中：应支付销售机构的客户维护费	10,123,967.24	11,360,215.90
应支付基金管理人的净管理费	21,231,977.37	25,965,868.94

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

管理费的计算方法如下：

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

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

基金管理费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元		
项目	本期（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	4,703,391.70	5,598,912.78

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

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

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 500 指数增强(LOF)A/B	富国中证 500 指数增强（LOF）C	富国中证 500 指数增强（LOF）Y	合计
富国基金管理有限公司	—	739,573.81	—	739,573.81
国泰海通证券股份有限公司	—	80.37	—	80.37
海通证券股份有限公司	—	16.44	—	16.44
申万宏源证券有限公司	—	326.37	—	326.37
合计	—	739,996.99	—	739,996.99

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 500 指数增强(LOF)A/B	富国中证 500 指数增强（LOF）C	富国中证 500 指数增强（LOF）Y	合计
富国基金管理有限公司	—	444,680.93	—	444,680.93
海通证券股份有限公司	—	51.45	—	51.45
申万宏源证券有限公司	—	836.14	—	836.14
合计	—	445,568.52	—	445,568.52

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：

$H=E\times0.20\%\div\text{当年天数}$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份		
项目	本期（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)

	富国中证 500 指数增 强 (LOF) A/B	富国中证 500 指数 增强 (LOF) C	富国中证 500 指数 增强 (LOF) Y	富国中证 500 指数 增强 (LOF) A/B	富国中证 500 指数 增强 (LOF) C	富国中证 500 指数 增强 (LOF) Y
基金合同生效日（2011 年 10 月 12 日）持有的 基金份额	20,003,333 .00	—	—	20,003,33 3.00	—	—
期初持有的基金份额	12,657,866 .18	—	—	12,657,86 6.18	—	—
期间申购/买入总份额	—	—	—	—	—	—
期间因拆分变动份额	—	—	—	—	—	—
减：期间赎回/卖出总份 额	—	—	—	—	—	—
期末持有的基金份额	12,657,866 .18	—	—	12,657,86 6.18	—	—
期末持有的基金份额占 基金总份额比例	0.53%	—	—	0.30%	—	—

注：本基金管理人投资本基金按照公告的费率条款执行，不存在费率优惠的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

富国中证 500 指数增强（LOF）C：

份额单位：份

关联方名称	本期末（2025 年 06 月 30 日）		上期末（2024 年 12 月 31 日）	
	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例 (%)
富国鑫汇养老目 标日期 2045 五年 持有期混合型发 起式基金中基金 (FOF)	—	—	3,042,228.40	0.60

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
中国农业银行股份有限公司	310,260,765.80	896,580.86	873,321,611.47	2,044,265.67

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	709	3,757.70	10,237.96	—
001382	新亚电缆	2025-03-13	6 个月	新股限售	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	—
001390	古麒绒材	2025-05-21	6 个月	新股限售	12.08	18.12	178	2,150.24	3,225.36	—
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	173	4,901.09	7,781.54	—
301275	汉朔科技	2025-03-04	6 个月	新股限售	27.50	56.19	397	10,917.50	22,307.43	—
301458	钧崴电子	2025-01-02	6 个月	新股限售	10.40	34.11	701	7,290.40	23,911.11	—
301501	恒鑫生活	2025-03-11	6 个月	新股限售	39.92	45.22	350	9,620.72	15,827.00	—
301560	众捷汽车	2025-04-17	6 个月	新股限售	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	—
301590	优优绿能	2025-05-28	6 个月	新股限售	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	—

301595	太力科技	2025-05-12	6 个月	新股限售	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	—
301602	超研股份	2025-01-15	6 个月	新股限售	6.70	24.80	658	4,408.60	16,318.40	—
301662	宏工科技	2025-04-10	6 个月	新股限售	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	—
301665	泰禾股份	2025-04-02	6 个月	新股限售	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	—
301678	新恒汇	2025-06-13	6 个月	新股限售	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	—
603014	威高血净	2025-05-12	6 个月	新股限售	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	—
603049	中策橡胶	2025-05-27	6 个月	新股限售	46.50	42.85	724	33,666.00	31,023.40	—
603072	天和磁材	2024-12-24	6 个月	新股限售	12.30	54.45	226	2,779.80	12,305.70	—
603120	肯特催化	2025-04-09	6 个月	新股限售	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	—
603124	江南新材	2025-03-12	6 个月	新股限售	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	—
603202	天有为	2025-04-16	6 个月	新股限售	93.50	90.66	166	15,521.00	15,049.56	—
603210	泰鸿万立	2025-04-01	6 个月	新股限售	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	—
603257	中国瑞林	2025-03-28	6 个月	新股限售	20.52	37.47	78	1,600.56	2,922.66	—
603271	永杰新材	2025-03-04	6 个月	新股限售	20.60	35.08	126	2,595.60	4,420.08	—
603382	海阳科技	2025-06-05	6 个月	新股限售	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	—
603409	汇通控股	2025-02-25	6 个月	新股限售	24.18	33.32	100	2,418.00	3,332.00	—
688545	兴福电子	2025-01-15	6 个月	新股限售	11.68	26.95	994	11,609.92	26,788.30	—
688583	思看科技	2025-01-08	6 个月	新股限售	33.46	79.68	227	5,855.50	18,087.36	—
688755	汉邦科技	2025-05-09	6 个月	新股限售	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	—
688757	胜科纳米	2025-03-18	6 个月	新股限售	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	—
688758	赛分科技	2025-01-02	6 个月	新股限售	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	—
688775	影石创新	2025-06-04	6 个月	新股限售	47.27	124.16	573	27,085.71	71,143.68	—

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 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	50,827.89	—
未评级	—	—
合计	50,827.89	—

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	310,260,765.80	—	—	—	—	—	310,260,765.80
结算备付金	18,315,641.96	—	—	—	—	—	18,315,641.96
存出保证金	1,191,143.11	—	—	—	—	—	1,191,143.11
交易性金融资产	—	—	4,068,457.48	—	—	5,434,515,837.03	5,438,584,294.51
应收清算款	—	—	—	—	—	31,425.33	31,425.33
应收申购款	—	—	—	—	—	938,634.46	938,634.46
资产总计	329,767,550.87	—	4,068,457.48	—	—	5,435,485,896.82	5,769,321,905.17
负债							
应付清算款	—	—	—	—	—	2.48	2.48
应付赎回款	—	—	—	—	—	19,379,603.61	19,379,603.61
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	4,671,149.42	4,671,149.42
应付托管费	—	—	—	—	—	700,672.40	700,672.40
应付销售服务费	—	—	—	—	—	147,179.54	147,179.54
其他负债	—	—	—	—	—	2,218,836.08	2,218,836.08
负债总计	—	—	—	—	—	27,117,443.53	27,117,443.53
利率敏感度缺口	329,767,550.87	—	4,068,457.48	—	—	5,408,368,453.29	5,742,204,461.64
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	481,601,879.16	—	—	—	—	—	481,601,879.16
结算备付金	30,391,391.43	—	—	—	—	—	30,391,391.43
存出保证金	1,909,908.62	—	—	—	—	—	1,909,908.62
交易性金融资产	—	—	4,570,465.07	—	—	6,823,837,137.14	6,828,407,602.21
应收清算款	—	—	—	—	—	3,312,397.84	3,312,397.84
应收申购款	92,904.40	—	—	—	—	3,843,908.03	3,936,812.43
资产总计	513,996,083.61	—	4,570,465.07	—	—	6,830,993,443.01	7,349,559,991.69
负债							
应付清算款	—	—	—	—	—	4,823,614.21	4,823,614.21
应付赎回款	—	—	—	—	—	13,960,088.40	13,960,088.40
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	6,534,111.06	6,534,111.06
应付托管费	—	—	—	—	—	980,116.62	980,116.62
应付销售服务费	—	—	—	—	—	171,859.82	171,859.82
其他负债	—	—	—	—	—	4,037,459.60	4,037,459.60
负债总计	—	—	—	—	—	30,507,249.71	30,507,249.71
利率敏感度缺口	513,996,083.61	—	4,570,465.07	—	—	6,800,486,193.30	7,319,052,741.98

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

下表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

假设	1. 影响生息资产公允价值的其他变量不变，仅利率发生变动；2. 利率变动范围合理。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 (2025 年 06 月 30 日)	上年度末 (2024 年 12 月 31 日)
	1. 基准点利率增加 0.1%	-2,174.74	-2,082.30
	2. 基准点利率减少 0.1%	2,174.74	2,082.30

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，所面临的最大的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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。其中，股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产的 90%，投资于中证 500 指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的资产不低于股票资产的

80%。保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

项目	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)	
	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	5,434,515,837.03	94.64	6,823,837,137.14	93.23
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	4,068,457.48	0.07	4,570,465.07	0.06
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	5,438,584,294.51	94.71	6,828,407,602.21	93.30

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%	52,475,136.34	66,978,836.66
	2. 业绩比较基准减少 1%	-52,475,136.34	-66,978,836.66

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	5,434,155,013.77	6,818,670,911.50
第二层次	4,017,629.59	9,291,329.57
第三层次	411,651.15	445,361.14
合计	5,438,584,294.51	6,828,407,602.21

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	5,434,515,837.03	94.20
	其中：股票	5,434,515,837.03	94.20
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	4,068,457.48	0.07
	其中：债券	4,068,457.48	0.07
	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	328,576,407.76	5.70
8	其他各项资产	2,161,202.90	0.04
9	合计	5,769,321,905.17	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	24,942,159.92	0.43
B	采矿业	218,231,006.43	3.80
C	制造业	2,405,396,974.50	41.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	326,907,572.78	5.69
E	建筑业	22,909,318.80	0.40
F	批发和零售业	139,768,080.92	2.43
G	交通运输、仓储和邮政业	79,476,252.23	1.38
H	住宿和餐饮业	1,037,349.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	275,553,285.13	4.80
J	金融业	731,268,868.03	12.73
K	房地产业	39,984,457.71	0.70
L	租赁和商务服务业	41,371,623.40	0.72

M	科学研究和技术服务业	3,695,209.20	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	11,760,493.96	0.20
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	5,116,014.00	0.09
Q	卫生和社会工作	12,213,699.60	0.21
R	文化、体育和娱乐业	101,382,011.70	1.77
S	综合	1,189,749.00	0.02
	合计	4,442,204,126.31	77.36

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	5,242,763.00	0.09
B	采矿业	58,680,312.28	1.02
C	制造业	438,980,289.45	7.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,464,801.00	0.29
E	建筑业	6,520,219.00	0.11
F	批发和零售业	16,896,007.58	0.29
G	交通运输、仓储和邮政业	65,946,327.26	1.15
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	143,815,327.89	2.50
J	金融业	185,634,686.84	3.23
K	房地产业	6,735,942.00	0.12
L	租赁和商务服务业	11,866,549.00	0.21
M	科学研究和技术服务业	13,999,377.80	0.24
N	水利、环境和公共设施管理业	7,730,176.62	0.13
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	2,254,896.00	0.04
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	11,544,035.00	0.20
S	综合	—	—
	合计	992,311,710.72	17.28

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	002926	华西证券	5,644,200	50,459,148.00	0.88
2	002966	苏州银行	5,723,540	50,252,681.20	0.88
3	300383	光环新网	3,382,400	48,368,320.00	0.84
4	600535	天士力	3,072,935	48,091,432.75	0.84

5	601991	大唐发电	14,597,762	46,274,905.54	0.81
6	601997	贵阳银行	6,888,910	42,986,798.40	0.75
7	601717	中创智领	2,555,541	42,473,091.42	0.74
8	601958	金钼股份	3,864,400	42,276,536.00	0.74
9	601577	长沙银行	4,176,805	41,517,441.70	0.72
10	600901	江苏金租	6,832,183	41,403,028.98	0.72
11	600704	物产中大	7,789,860	41,052,562.20	0.71
12	601128	常熟银行	5,454,654	40,200,799.98	0.70
13	600004	白云机场	4,348,338	39,569,875.80	0.69
14	600925	苏能股份	7,421,767	38,815,841.41	0.68
15	000060	中金岭南	8,390,265	38,427,413.70	0.67
16	600109	国金证券	4,372,000	38,342,440.00	0.67
17	600578	京能电力	8,535,300	38,323,497.00	0.67
18	000988	华工科技	800,506	37,631,787.06	0.66
19	600380	健康元	3,378,661	37,266,630.83	0.65
20	601568	北元集团	8,970,650	37,228,197.50	0.65
21	601555	东吴证券	4,127,584	36,116,360.00	0.63
22	000050	深天马A	4,237,149	36,100,509.48	0.63
23	300017	网宿科技	3,310,400	35,487,488.00	0.62
24	002414	高德红外	3,446,698	35,328,654.50	0.62
25	600873	梅花生物	3,269,100	34,946,679.00	0.61
26	002223	鱼跃医疗	980,260	34,897,256.00	0.61
27	688469	芯联集成	7,248,775	34,576,656.75	0.60
28	600956	新天绿能	4,465,000	34,469,800.00	0.60
29	600098	广州发展	5,507,531	34,422,068.75	0.60
30	002273	水晶光电	1,691,024	33,769,749.28	0.59
31	000426	兴业银锡	2,098,406	33,154,814.80	0.58
32	600126	杭钢股份	3,640,900	32,768,100.00	0.57
33	601857	中国石油	3,827,200	32,722,560.00	0.57
34	600329	达仁堂	980,203	32,699,572.08	0.57
35	300803	指南针	384,945	31,049,663.70	0.54
36	601928	凤凰传媒	2,742,781	30,636,863.77	0.53
37	002958	青农商行	8,438,600	30,463,346.00	0.53
38	300373	扬杰科技	580,800	30,143,520.00	0.52
39	002595	豪迈科技	503,445	29,814,012.90	0.52
40	601398	工商银行	3,807,350	28,897,786.50	0.50
41	600096	云天化	1,267,976	27,857,432.72	0.49
42	600909	华安证券	4,737,188	27,617,806.04	0.48
43	688017	绿的谐波	207,882	25,962,382.98	0.45
44	600299	安迪苏	2,660,571	25,674,510.15	0.45
45	600350	山东高速	2,395,071	25,531,456.86	0.44

46	002203	海亮股份	2, 473, 131	25, 522, 711. 92	0. 44
47	688220	翱捷科技	325, 360	25, 475, 688. 00	0. 44
48	300496	中科创达	445, 120	25, 469, 766. 40	0. 44
49	600688	上海石化	8, 431, 075	24, 028, 563. 75	0. 42
50	002185	华天科技	2, 365, 017	23, 886, 671. 70	0. 42
51	600663	陆家嘴	2, 633, 736	23, 334, 900. 96	0. 41
52	002056	横店东磁	1, 646, 800	23, 302, 220. 00	0. 41
53	300115	长盈精密	1, 086, 820	23, 257, 948. 00	0. 41
54	600863	内蒙华电	5, 611, 200	23, 062, 032. 00	0. 40
55	300058	蓝色光标	3, 512, 040	23, 038, 982. 40	0. 40
56	688114	华大智造	352, 451	22, 849, 398. 33	0. 40
57	000825	太钢不锈	6, 275, 135	22, 527, 734. 65	0. 39
58	601665	齐鲁银行	3, 560, 413	22, 501, 810. 16	0. 39
59	002281	光迅科技	453, 800	22, 381, 416. 00	0. 39
60	000937	冀中能源	3, 851, 830	22, 148, 022. 50	0. 39
61	000598	兴蓉环境	3, 037, 593	21, 901, 045. 53	0. 38
62	600352	浙江龙盛	2, 137, 949	21, 721, 561. 84	0. 38
63	600056	中国医药	2, 072, 568	21, 430, 353. 12	0. 37
64	300140	节能环境	3, 462, 850	21, 365, 784. 50	0. 37
65	300476	胜宏科技	158, 200	21, 258, 916. 00	0. 37
66	600928	西安银行	5, 349, 300	20, 969, 256. 00	0. 37
67	002155	湖南黄金	1, 170, 100	20, 886, 285. 00	0. 36
68	600977	中国电影	1, 929, 802	20, 687, 477. 44	0. 36
69	002939	长城证券	2, 459, 700	20, 612, 286. 00	0. 36
70	000021	深科技	1, 068, 116	20, 016, 493. 84	0. 35
71	600435	北方导航	1, 266, 200	19, 740, 058. 00	0. 34
72	000750	国海证券	4, 773, 100	19, 665, 172. 00	0. 34
73	600271	航天信息	2, 117, 054	19, 561, 578. 96	0. 34
74	600685	中船防务	715, 400	19, 451, 726. 00	0. 34
75	603858	步长制药	1, 189, 730	19, 321, 215. 20	0. 34
76	601118	海南橡胶	4, 068, 200	19, 201, 904. 00	0. 33
77	603728	鸣志电器	332, 500	19, 108, 775. 00	0. 33
78	000729	燕京啤酒	1, 475, 451	19, 077, 581. 43	0. 33
79	300001	特锐德	782, 463	18, 755, 638. 11	0. 33
80	000959	首钢股份	5, 507, 900	18, 726, 860. 00	0. 33
81	600008	首创环保	6, 100, 700	18, 424, 114. 00	0. 32
82	000636	风华高科	1, 325, 167	18, 207, 794. 58	0. 32
83	000623	吉林敖东	1, 067, 912	18, 101, 108. 40	0. 32
84	601168	西部矿业	1, 086, 902	18, 075, 180. 26	0. 31
85	000563	陕国投 A	5, 058, 630	18, 059, 309. 10	0. 31
86	601921	浙版传媒	2, 230, 000	17, 973, 800. 00	0. 31

87	601099	太平洋	4, 562, 300	17, 929, 839. 00	0. 31
88	601061	中信金属	2, 226, 626	17, 612, 611. 66	0. 31
89	603087	甘李药业	320, 080	17, 533, 982. 40	0. 31
90	600295	鄂尔多斯	1, 998, 040	17, 402, 928. 40	0. 30
91	000423	东阿阿胶	330, 300	17, 274, 690. 00	0. 30
92	600839	四川长虹	1, 760, 754	17, 114, 528. 88	0. 30
93	600118	中国卫星	597, 400	17, 067, 718. 00	0. 30
94	000878	云南铜业	1, 293, 200	16, 449, 504. 00	0. 29
95	000987	越秀资本	2, 394, 700	16, 427, 642. 00	0. 29
96	300458	全志科技	412, 340	16, 365, 774. 60	0. 29
97	002673	西部证券	2, 064, 300	16, 266, 684. 00	0. 28
98	603881	数据港	633, 760	16, 192, 568. 00	0. 28
99	002318	久立特材	687, 600	16, 082, 964. 00	0. 28
100	002608	江苏国信	2, 177, 800	15, 963, 274. 00	0. 28
101	600021	上海电力	1, 786, 600	15, 704, 214. 00	0. 27
102	688318	财富趋势	136, 374	15, 672, 100. 08	0. 27
103	002065	东华软件	1, 627, 900	15, 627, 840. 00	0. 27
104	301165	锐捷网络	254, 117	15, 618, 030. 82	0. 27
105	002353	杰瑞股份	437, 400	15, 309, 000. 00	0. 27
106	600582	天地科技	2, 551, 348	15, 282, 574. 52	0. 27
107	000783	长江证券	2, 193, 420	15, 200, 400. 60	0. 26
108	000893	亚钾国际	496, 000	14, 949, 440. 00	0. 26
109	600298	安琪酵母	424, 600	14, 933, 182. 00	0. 26
110	002080	中材科技	760, 400	14, 827, 800. 00	0. 26
111	300738	奥飞数据	705, 800	14, 772, 394. 00	0. 26
112	600497	驰宏锌锗	2, 748, 200	14, 537, 978. 00	0. 25
113	000034	神州数码	384, 661	14, 478, 640. 04	0. 25
114	002352	顺丰控股	293, 950	14, 333, 002. 00	0. 25
115	600153	建发股份	1, 379, 300	14, 303, 341. 00	0. 25
116	601166	兴业银行	611, 200	14, 265, 408. 00	0. 25
117	600998	九州通	2, 764, 208	14, 208, 029. 12	0. 25
118	600348	华阳股份	2, 112, 200	14, 067, 252. 00	0. 24
119	002500	山西证券	2, 407, 950	14, 062, 428. 00	0. 24
120	600517	国网英大	2, 756, 267	14, 056, 961. 70	0. 24
121	300677	英科医疗	592, 666	14, 034, 330. 88	0. 24
122	603444	吉比特	46, 400	14, 010, 480. 00	0. 24
123	300474	景嘉微	191, 600	13, 986, 800. 00	0. 24
124	000027	深圳能源	2, 165, 300	13, 814, 614. 00	0. 24
125	002851	麦格米特	274, 800	13, 778, 472. 00	0. 24
126	600549	厦门钨业	656, 814	13, 740, 548. 88	0. 24
127	600499	科达制造	1, 388, 300	13, 605, 340. 00	0. 24

128	600739	辽宁成大	1, 233, 400	13, 567, 400. 00	0. 24
129	002444	巨星科技	531, 100	13, 548, 361. 00	0. 24
130	000728	国元证券	1, 673, 652	13, 205, 114. 28	0. 23
131	603379	三美股份	273, 940	13, 181, 992. 80	0. 23
132	300604	长川科技	290, 900	13, 064, 319. 00	0. 23
133	300223	北京君正	188, 400	13, 037, 280. 00	0. 23
134	601158	重庆水务	2, 791, 500	12, 952, 560. 00	0. 23
135	300207	欣旺达	637, 400	12, 786, 244. 00	0. 22
136	688525	佰维存储	188, 067	12, 675, 715. 80	0. 22
137	603893	瑞芯微	82, 850	12, 581, 601. 00	0. 22
138	601939	建设银行	1, 306, 800	12, 336, 192. 00	0. 21
139	000009	中国宝安	1, 386, 468	12, 311, 835. 84	0. 21
140	600166	福田汽车	4, 485, 700	12, 156, 247. 00	0. 21
141	600926	杭州银行	719, 700	12, 105, 354. 00	0. 21
142	002945	华林证券	841, 231	12, 088, 489. 47	0. 21
143	300146	汤臣倍健	1, 067, 093	11, 994, 125. 32	0. 21
144	002340	格林美	1, 888, 390	11, 991, 276. 50	0. 21
145	001203	大中矿业	1, 266, 700	11, 970, 315. 00	0. 21
146	300442	润泽科技	239, 300	11, 852, 529. 00	0. 21
147	600906	财达证券	1, 733, 600	11, 823, 152. 00	0. 21
148	600016	民生银行	2, 458, 400	11, 677, 400. 00	0. 20
149	003031	中瓷电子	215, 928	11, 489, 528. 88	0. 20
150	601231	环旭电子	775, 179	11, 340, 868. 77	0. 20
151	300735	光弘科技	450, 927	11, 318, 267. 70	0. 20
152	300369	绿盟科技	1, 452, 500	11, 285, 925. 00	0. 20
153	002821	凯莱英	127, 760	11, 274, 820. 00	0. 20
154	601611	中国核建	1, 224, 100	11, 249, 479. 00	0. 20
155	002850	科达利	97, 667	11, 052, 974. 39	0. 19
156	000629	钒钛股份	4, 292, 900	10, 989, 824. 00	0. 19
157	600486	扬农化工	188, 601	10, 938, 858. 00	0. 19
158	603529	爱玛科技	316, 800	10, 897, 920. 00	0. 19
159	600498	烽火通信	510, 100	10, 727, 403. 00	0. 19
160	002487	大金重工	323, 400	10, 639, 860. 00	0. 19
161	300857	协创数据	122, 940	10, 580, 216. 40	0. 18
162	600879	航天电子	1, 010, 149	10, 576, 260. 03	0. 18
163	600763	通策医疗	255, 845	10, 561, 281. 60	0. 18
164	600482	中国动力	455, 800	10, 515, 306. 00	0. 18
165	000039	中集集团	1, 334, 748	10, 491, 119. 28	0. 18
166	600919	江苏银行	875, 710	10, 455, 977. 40	0. 18
167	002896	中大力德	179, 530	10, 396, 582. 30	0. 18
168	601598	中国外运	2, 078, 100	10, 245, 033. 00	0. 18

169	600900	长江电力	339,600	10,235,544.00	0.18
170	002138	顺络电子	363,500	10,221,620.00	0.18
171	002739	万达电影	877,964	10,035,128.52	0.17
172	688235	百济神州	42,881	10,018,716.84	0.17
173	003022	联泓新科	628,201	9,944,421.83	0.17
174	002266	浙富控股	3,204,230	9,869,028.40	0.17
175	300623	捷捷微电	329,400	9,816,120.00	0.17
176	300033	同花顺	35,600	9,719,156.00	0.17
177	600959	江苏有线	2,807,510	9,657,834.40	0.17
178	603565	中谷物流	1,009,500	9,640,725.00	0.17
179	000543	皖能电力	1,371,429	9,600,003.00	0.17
180	600208	衢州发展	3,234,400	9,573,824.00	0.17
181	688027	国盾量子	34,610	9,518,096.10	0.17
182	000528	柳工	982,885	9,445,524.85	0.16
183	600707	彩虹股份	1,453,651	9,390,585.46	0.16
184	603868	飞科电器	261,500	9,380,005.00	0.16
185	002690	美亚光电	553,655	9,340,159.85	0.16
186	600808	马钢股份	2,704,700	9,331,215.00	0.16
187	600483	福能股份	957,700	9,232,228.00	0.16
188	601108	财通证券	1,164,576	9,211,796.16	0.16
189	601990	南京证券	1,122,400	9,068,992.00	0.16
190	601838	成都银行	447,600	8,996,760.00	0.16
191	300573	兴齐眼药	173,709	8,996,389.11	0.16
192	603187	海容冷链	764,600	8,991,696.00	0.16
193	300657	弘信电子	322,031	8,981,444.59	0.16
194	601016	节能风电	3,104,800	8,972,872.00	0.16
195	301261	恒工精密	122,600	8,936,314.00	0.16
196	600062	华润双鹤	477,725	8,914,348.50	0.16
197	688608	恒玄科技	25,523	8,881,493.54	0.15
198	600563	法拉电子	81,000	8,836,290.00	0.15
199	300580	贝斯特	357,300	8,778,861.00	0.15
200	688766	普冉股份	138,817	8,773,234.40	0.15
201	600428	中远海特	1,331,400	8,321,250.00	0.14
202	000960	锡业股份	543,600	8,317,080.00	0.14
203	605589	圣泉集团	299,700	8,316,675.00	0.14
204	688563	航材股份	145,954	8,265,375.02	0.14
205	688578	艾力斯	88,653	8,248,275.12	0.14
206	002624	完美世界	543,330	8,242,316.10	0.14
207	603662	柯力传感	128,600	8,221,398.00	0.14
208	300002	神州泰岳	692,500	8,171,500.00	0.14
209	600741	华域汽车	462,006	8,154,405.90	0.14

210	002373	千方科技	869,800	8,089,140.00	0.14
211	600885	宏发股份	362,376	8,084,608.56	0.14
212	688568	中科星图	220,573	7,942,833.73	0.14
213	605358	立昂微	340,753	7,939,544.90	0.14
214	301368	丰立智能	128,248	7,929,573.84	0.14
215	300454	深信服	83,800	7,892,284.00	0.14
216	688225	亚信安全	384,073	7,831,248.47	0.14
217	000559	万向钱潮	1,000,287	7,652,195.55	0.13
218	300251	光线传媒	376,600	7,633,682.00	0.13
219	603298	杭叉集团	364,000	7,625,800.00	0.13
220	688561	奇安信	223,065	7,579,748.70	0.13
221	601988	中国银行	1,342,300	7,543,726.00	0.13
222	300024	机器人	438,200	7,528,276.00	0.13
223	688008	澜起科技	91,105	7,470,610.00	0.13
224	688188	柏楚电子	56,727	7,468,676.82	0.13
225	300699	光威复材	235,537	7,459,456.79	0.13
226	601138	工业富联	342,400	7,320,512.00	0.13
227	603885	吉祥航空	542,580	7,308,552.60	0.13
228	002202	金风科技	711,530	7,293,182.50	0.13
229	600884	杉杉股份	770,100	7,285,146.00	0.13
230	300627	华测导航	205,240	7,183,400.00	0.13
231	000719	中原传媒	576,800	7,158,088.00	0.12
232	600733	北汽蓝谷	961,400	7,085,518.00	0.12
233	000001	平安银行	578,500	6,982,495.00	0.12
234	002831	裕同科技	297,141	6,959,042.22	0.12
235	002841	视源股份	200,700	6,944,220.00	0.12
236	002439	启明星辰	434,100	6,941,259.00	0.12
237	600988	赤峰黄金	278,800	6,936,544.00	0.12
238	603993	洛阳钼业	823,100	6,930,502.00	0.12
239	000032	深桑达A	342,500	6,928,775.00	0.12
240	600057	厦门象屿	981,300	6,898,539.00	0.12
241	600369	西南证券	1,577,500	6,862,125.00	0.12
242	688183	生益电子	133,790	6,850,048.00	0.12
243	601139	深圳燃气	1,068,600	6,796,296.00	0.12
244	600487	亨通光电	443,930	6,792,129.00	0.12
245	300953	震裕科技	66,740	6,764,099.00	0.12
246	002738	中矿资源	209,576	6,739,964.16	0.12
247	600801	华新水泥	567,100	6,714,464.00	0.12
248	688387	信科移动	1,183,121	6,684,633.65	0.12
249	002517	恺英网络	344,300	6,648,433.00	0.12
250	603156	养元饮品	311,775	6,597,159.00	0.11

251	300142	沃森生物	598,000	6,578,000.00	0.11
252	600867	通化东宝	800,200	6,561,640.00	0.11
253	600132	重庆啤酒	118,994	6,556,569.40	0.11
254	301160	翔楼新材	81,600	6,534,528.00	0.11
255	300757	罗博特科	43,540	6,529,693.80	0.11
256	300432	富临精工	497,300	6,499,711.00	0.11
257	688278	特宝生物	89,974	6,488,025.14	0.11
258	002648	卫星化学	373,419	6,471,351.27	0.11
259	002206	海利得	1,236,300	6,317,493.00	0.11
260	301308	江波龙	72,000	6,299,280.00	0.11
261	601019	山东出版	662,484	6,273,723.48	0.11
262	603228	景旺电子	149,700	6,263,448.00	0.11
263	688023	安恒信息	110,071	6,245,428.54	0.11
264	600038	中直股份	160,640	6,234,438.40	0.11
265	300037	新宙邦	177,100	6,233,920.00	0.11
266	688819	天能股份	222,816	6,185,372.16	0.11
267	688778	厦钨新能	109,515	6,124,078.80	0.11
268	603927	中科软	314,676	6,085,833.84	0.11
269	688196	卓越新能	126,158	6,064,415.06	0.11
270	002130	沃尔核材	252,400	6,012,168.00	0.10
271	601328	交通银行	742,300	5,938,400.00	0.10
272	600050	中国联通	1,111,800	5,937,012.00	0.10
273	002865	钧达股份	151,700	5,916,300.00	0.10
274	600602	云赛智联	290,800	5,865,436.00	0.10
275	300751	迈为股份	84,000	5,843,040.00	0.10
276	601098	中南传媒	440,139	5,774,623.68	0.10
277	300502	新易盛	45,429	5,770,391.58	0.10
278	600598	北大荒	398,076	5,740,255.92	0.10
279	002416	爱施德	475,000	5,709,500.00	0.10
280	601318	中国平安	102,600	5,692,248.00	0.10
281	001286	陕西能源	652,550	5,677,185.00	0.10
282	600390	五矿资本	969,800	5,653,934.00	0.10
283	300136	信维通信	252,400	5,653,760.00	0.10
284	688172	燕东微	281,641	5,537,062.06	0.10
285	601169	北京银行	810,000	5,532,300.00	0.10
286	688728	格科微	357,862	5,511,074.80	0.10
287	601916	浙商银行	1,618,600	5,487,054.00	0.10
288	601456	国联民生	528,400	5,468,940.00	0.10
289	002507	涪陵榨菜	420,690	5,380,625.10	0.09
290	601233	桐昆股份	506,800	5,372,080.00	0.09
291	601918	新集能源	830,500	5,365,030.00	0.09

292	688281	华秦科技	88,231	5,338,857.81	0.09
293	002683	广东宏大	156,800	5,321,792.00	0.09
294	300418	昆仑万维	157,400	5,293,362.00	0.09
295	688425	铁建重工	1,295,805	5,286,884.40	0.09
296	688327	云从科技	372,613	5,138,333.27	0.09
297	002607	中公教育	1,671,900	5,116,014.00	0.09
298	002461	珠江啤酒	452,700	5,110,983.00	0.09
299	000560	我爱我家	1,694,900	5,033,853.00	0.09
300	002410	广联达	374,800	5,026,068.00	0.09
301	000723	美锦能源	1,159,600	5,009,472.00	0.09
302	002156	通富微电	195,400	5,006,148.00	0.09
303	600760	中航沈飞	83,300	4,883,046.00	0.09
304	002007	华兰生物	310,900	4,871,803.00	0.08
305	301358	湖南裕能	156,100	4,868,759.00	0.08
306	601658	邮储银行	884,900	4,840,403.00	0.08
307	600862	中航高科	185,500	4,837,840.00	0.08
308	000063	中兴通讯	148,600	4,828,014.00	0.08
309	000887	中鼎股份	269,400	4,738,746.00	0.08
310	601162	天风证券	956,400	4,715,052.00	0.08
311	002714	牧原股份	111,700	4,692,517.00	0.08
312	600660	福耀玻璃	81,500	4,646,315.00	0.08
313	603707	健友股份	415,768	4,635,813.20	0.08
314	603909	建发合诚	475,000	4,626,500.00	0.08
315	601216	君正集团	836,700	4,618,584.00	0.08
316	600282	南钢股份	1,097,100	4,607,820.00	0.08
317	600418	江淮汽车	114,532	4,591,587.88	0.08
318	600111	北方稀土	182,000	4,531,800.00	0.08
319	001339	智微智能	92,600	4,475,358.00	0.08
320	600655	豫园股份	798,300	4,430,565.00	0.08
321	688668	鼎通科技	70,917	4,429,475.82	0.08
322	000932	华菱钢铁	1,001,900	4,408,360.00	0.08
323	002603	以岭药业	312,500	4,406,250.00	0.08
324	600511	国药股份	150,286	4,382,339.76	0.08
325	601919	中远海控	290,660	4,371,526.40	0.08
326	601899	紫金矿业	223,900	4,366,050.00	0.08
327	000885	城发环境	324,060	4,316,479.20	0.08
328	601006	大秦铁路	653,800	4,315,080.00	0.08
329	301328	维峰电子	102,200	4,307,730.00	0.08
330	603309	维力医疗	336,000	4,273,920.00	0.07
331	002001	新 和 成	196,284	4,174,960.68	0.07
332	000703	恒逸石化	707,500	4,160,100.00	0.07

333	603160	汇顶科技	58,503	4,155,468.09	0.07
334	603986	兆易创新	32,800	4,150,184.00	0.07
335	002701	奥瑞金	693,100	4,123,945.00	0.07
336	600528	中铁工业	558,200	4,119,516.00	0.07
337	603612	索通发展	222,100	4,082,198.00	0.07
338	601998	中信银行	475,046	4,037,891.00	0.07
339	000415	渤海租赁	1,210,000	4,029,300.00	0.07
340	601600	中国铝业	568,600	4,002,944.00	0.07
341	600000	浦发银行	286,890	3,982,033.20	0.07
342	300390	天华新能	208,284	3,971,975.88	0.07
343	002230	科大讯飞	82,900	3,969,252.00	0.07
344	300595	欧普康视	257,276	3,928,604.52	0.07
345	002384	东山精密	103,500	3,909,195.00	0.07
346	002797	第一创业	551,072	3,901,589.76	0.07
347	600941	中国移动	33,900	3,815,445.00	0.07
348	601818	光大银行	918,400	3,811,360.00	0.07
349	300679	电连技术	83,100	3,771,078.00	0.07
350	601668	中国建筑	648,600	3,742,422.00	0.07
351	688120	华海清科	22,072	3,723,546.40	0.06
352	000726	鲁 泰 A	582,700	3,694,318.00	0.06
353	000591	太阳能	826,900	3,630,091.00	0.06
354	603601	再升科技	889,400	3,610,964.00	0.06
355	002532	天山铝业	433,660	3,603,714.60	0.06
356	600361	创新新材	900,448	3,592,787.52	0.06
357	601933	永辉超市	730,800	3,580,920.00	0.06
358	600392	盛和资源	271,400	3,574,338.00	0.06
359	603979	金诚信	76,700	3,561,948.00	0.06
360	000089	深圳机场	514,700	3,551,430.00	0.06
361	688095	福昕软件	52,231	3,547,007.21	0.06
362	603000	人民网	171,400	3,463,994.00	0.06
363	603737	三棵树	94,000	3,463,900.00	0.06
364	603129	春风动力	15,900	3,442,350.00	0.06
365	002790	瑞尔特	468,200	3,403,814.00	0.06
366	600219	南山铝业	882,700	3,380,741.00	0.06
367	300718	长盛轴承	48,400	3,363,316.00	0.06
368	688702	盛科通信	54,940	3,355,735.20	0.06
369	002299	圣农发展	234,100	3,345,289.00	0.06
370	002236	大华股份	210,100	3,336,388.00	0.06
371	002965	祥鑫科技	84,541	3,315,698.02	0.06
372	603605	珀莱雅	39,656	3,283,120.24	0.06
373	002472	双环传动	98,000	3,282,020.00	0.06

374	688676	金盘科技	96,634	3,232,407.30	0.06
375	002837	英维克	107,910	3,206,006.10	0.06
376	002407	多氟多	262,660	3,201,825.40	0.06
377	601000	唐山港	785,650	3,189,739.00	0.06
378	603916	苏博特	349,800	3,169,188.00	0.06
379	300558	贝达药业	53,869	3,121,708.55	0.05
380	603341	龙旗科技	76,778	3,119,490.14	0.05
381	600820	隧道股份	508,358	3,100,983.80	0.05
382	600968	海油发展	756,900	3,088,152.00	0.05
383	300100	双林股份	65,380	3,078,090.40	0.05
384	300547	川环科技	101,500	3,067,330.00	0.05
385	002867	周大生	232,450	3,063,691.00	0.05
386	600795	国电电力	630,900	3,053,556.00	0.05
387	000429	粤高速A	229,000	3,052,570.00	0.05
388	002459	晶澳科技	305,000	3,043,900.00	0.05
389	600312	平高电气	197,100	3,033,369.00	0.05
390	600764	中国海防	88,800	3,019,200.00	0.05
391	600079	人福医药	143,200	3,004,336.00	0.05
392	600859	王府井	215,700	2,996,073.00	0.05
393	688361	中科飞测	35,160	2,960,120.40	0.05
394	603259	药明康德	42,400	2,948,920.00	0.05
395	688582	芯动联科	43,447	2,919,638.40	0.05
396	603808	歌力思	349,700	2,902,510.00	0.05
397	600908	无锡银行	457,100	2,884,301.00	0.05
398	688551	科威尔	97,478	2,864,878.42	0.05
399	002142	宁波银行	104,200	2,850,912.00	0.05
400	601155	新城控股	206,000	2,818,080.00	0.05
401	600710	苏美达	293,000	2,815,730.00	0.05
402	002312	川发龙蟒	244,700	2,809,156.00	0.05
403	688029	南微医学	41,512	2,804,135.60	0.05
404	003021	兆威机电	25,700	2,779,455.00	0.05
405	300395	菲利华	54,200	2,769,620.00	0.05
406	002212	天融信	356,400	2,744,280.00	0.05
407	600816	建元信托	907,700	2,677,715.00	0.05
408	301413	安培龙	34,700	2,652,815.00	0.05
409	300529	健帆生物	122,300	2,638,011.00	0.05
410	688180	君实生物	77,012	2,616,867.76	0.05
411	688249	晶合集成	128,829	2,611,363.83	0.05
412	603057	紫燕食品	119,410	2,610,302.60	0.05
413	601336	新华保险	44,600	2,609,100.00	0.05
414	600566	济川药业	98,300	2,588,239.00	0.05

415	688692	达梦数据	11,463	2,554,988.07	0.04
416	688208	道通科技	83,450	2,553,570.00	0.04
417	601777	千里科技	300,000	2,547,000.00	0.04
418	600141	兴发集团	122,900	2,523,137.00	0.04
419	601077	渝农商行	350,200	2,500,428.00	0.04
420	301078	孩子王	190,700	2,492,449.00	0.04
421	600377	宁沪高速	162,150	2,487,381.00	0.04
422	603323	苏农银行	437,234	2,452,882.74	0.04
423	600131	国网信通	137,100	2,426,670.00	0.04
424	600155	华创云信	348,501	2,425,566.96	0.04
425	600737	中粮糖业	254,510	2,405,119.50	0.04
426	601601	中国太保	64,000	2,400,640.00	0.04
427	300888	稳健医疗	58,400	2,400,240.00	0.04
428	002756	永兴材料	74,170	2,354,897.50	0.04
429	601696	中银证券	218,600	2,336,834.00	0.04
430	600177	雅戈尔	319,000	2,328,700.00	0.04
431	601865	福莱特	152,500	2,319,525.00	0.04
432	688308	欧科亿	124,918	2,304,737.10	0.04
433	000537	中绿电	275,628	2,304,250.08	0.04
434	301338	凯格精机	48,100	2,294,851.00	0.04
435	603899	晨光股份	79,100	2,293,109.00	0.04
436	002152	广电运通	170,382	2,289,934.08	0.04
437	301171	易点天下	85,300	2,280,069.00	0.04
438	002913	奥士康	77,200	2,270,452.00	0.04
439	301195	北路智控	63,400	2,269,720.00	0.04
440	300788	中信出版	70,700	2,268,056.00	0.04
441	000778	新兴铸管	606,400	2,255,808.00	0.04
442	002659	凯文教育	447,400	2,254,896.00	0.04
443	002008	大族激光	91,900	2,239,603.00	0.04
444	002085	万丰奥威	140,300	2,229,367.00	0.04
445	688389	普门科技	172,285	2,225,922.20	0.04
446	002128	电投能源	112,376	2,222,797.28	0.04
447	002436	兴森科技	167,000	2,211,080.00	0.04
448	600866	星湖科技	318,800	2,202,908.00	0.04
449	002245	蔚蓝锂芯	170,100	2,182,383.00	0.04
450	002558	巨人网络	91,900	2,164,245.00	0.04
451	000683	博源化工	451,580	2,163,068.20	0.04
452	300681	英搏尔	77,700	2,149,182.00	0.04
453	300737	科顺股份	444,300	2,141,526.00	0.04
454	300339	润和软件	41,900	2,129,777.00	0.04
455	002261	拓维信息	68,800	2,129,360.00	0.04

456	600995	南网储能	216,600	2,118,348.00	0.04
457	603466	风语筑	209,900	2,117,891.00	0.04
458	688279	峰岬科技	11,392	2,113,216.00	0.04
459	688046	药康生物	136,337	2,050,508.48	0.04
460	002064	华峰化学	304,934	2,015,613.74	0.04
461	601208	东材科技	212,600	2,015,448.00	0.04
462	302132	中航成飞	22,800	2,005,032.00	0.03
463	002600	领益智造	232,000	1,992,880.00	0.03
464	688025	杰普特	27,872	1,992,848.00	0.03
465	000066	中国长城	134,600	1,992,080.00	0.03
466	688088	虹软科技	41,276	1,991,567.00	0.03
467	688213	思特威	19,461	1,989,303.42	0.03
468	002429	兆驰股份	451,000	1,975,380.00	0.03
469	688099	晶晨股份	27,748	1,970,385.48	0.03
470	002078	太阳纸业	145,855	1,963,208.30	0.03
471	002010	传化智联	350,400	1,955,232.00	0.03
472	600536	中国软件	41,395	1,936,044.15	0.03
473	000100	TCL 科技	445,500	1,929,015.00	0.03
474	601179	中国西电	313,817	1,926,836.38	0.03
475	002465	海格通信	138,066	1,924,640.04	0.03
476	688521	芯原股份	19,886	1,918,999.00	0.03
477	600039	四川路桥	193,600	1,916,640.00	0.03
478	300346	南大光电	60,400	1,911,056.00	0.03
479	605090	九丰能源	73,900	1,907,359.00	0.03
480	688002	睿创微纳	27,272	1,901,403.84	0.03
481	600143	金发科技	183,300	1,889,823.00	0.03
482	300450	先导智能	75,000	1,863,750.00	0.03
483	601311	骆驼股份	206,300	1,862,889.00	0.03
484	000933	神火股份	111,200	1,850,368.00	0.03
485	000831	中国稀土	51,100	1,845,732.00	0.03
486	603589	口子窖	52,200	1,816,560.00	0.03
487	002563	森马服饰	342,925	1,803,785.50	0.03
488	600580	卧龙电驱	90,720	1,793,534.40	0.03
489	689009	九号公司	30,196	1,786,697.32	0.03
490	002294	信立泰	37,700	1,784,341.00	0.03
491	300993	玉马科技	117,700	1,784,332.00	0.03
492	002385	大北农	441,400	1,783,256.00	0.03
493	688677	海泰新光	45,265	1,765,787.65	0.03
494	603071	物产环能	137,400	1,749,102.00	0.03
495	600895	张江高科	67,300	1,729,610.00	0.03
496	605499	东鹏饮料	5,500	1,727,275.00	0.03

497	301220	亚香股份	38,460	1,726,854.00	0.03
498	002153	石基信息	196,874	1,704,928.84	0.03
499	600383	金地集团	449,100	1,702,089.00	0.03
500	002120	韵达股份	252,800	1,693,760.00	0.03
501	002195	岩山科技	299,001	1,683,375.63	0.03
502	603659	璞泰来	89,100	1,673,298.00	0.03
503	300662	科锐国际	56,000	1,663,760.00	0.03
504	002539	云图控股	175,100	1,642,438.00	0.03
505	601228	广州港	508,200	1,641,486.00	0.03
506	300590	移为通信	125,800	1,636,658.00	0.03
507	603338	浙江鼎力	33,923	1,607,950.20	0.03
508	002468	申通快递	150,100	1,604,569.00	0.03
509	688169	石头科技	10,210	1,598,375.50	0.03
510	301029	怡合达	69,700	1,593,342.00	0.03
511	603826	坤彩科技	81,280	1,590,649.60	0.03
512	001283	豪鹏科技	29,100	1,584,495.00	0.03
513	603606	东方电缆	30,500	1,577,155.00	0.03
514	688617	惠泰医疗	5,298	1,573,506.00	0.03
515	000738	航发控制	75,145	1,559,258.75	0.03
516	688480	赛恩斯	48,054	1,544,936.10	0.03
517	688363	华熙生物	30,070	1,544,094.50	0.03
518	600637	东方明珠	204,326	1,526,315.22	0.03
519	300765	新诺威	29,308	1,514,930.52	0.03
520	688538	和辉光电	647,268	1,514,607.12	0.03
521	601198	东兴证券	134,900	1,504,135.00	0.03
522	300763	锦浪科技	26,200	1,503,618.00	0.03
523	000333	美的集团	20,824	1,503,492.80	0.03
524	002484	江海股份	73,200	1,499,868.00	0.03
525	300054	鼎龙股份	52,200	1,497,096.00	0.03
526	688777	中控技术	33,280	1,494,604.80	0.03
527	605305	中际联合	53,700	1,491,786.00	0.03
528	688072	拓荆科技	9,679	1,487,759.09	0.03
529	300777	中简科技	41,000	1,486,250.00	0.03
530	603236	移远通信	17,200	1,475,760.00	0.03
531	300073	当升科技	33,200	1,456,484.00	0.03
532	600363	联创光电	24,800	1,446,584.00	0.03
533	002170	芭田股份	140,600	1,441,150.00	0.03
534	603303	得邦照明	119,000	1,436,330.00	0.03
535	002025	航天电器	27,912	1,434,955.92	0.02
536	300724	捷佳伟创	26,329	1,429,664.70	0.02
537	002262	恩华药业	68,368	1,420,687.04	0.02

538	601688	华泰证券	79,700	1,419,457.00	0.02
539	600060	海信视像	61,300	1,411,126.00	0.02
540	600160	巨化股份	48,900	1,402,452.00	0.02
541	601369	陕鼓动力	158,600	1,390,922.00	0.02
542	002463	沪电股份	32,500	1,383,850.00	0.02
543	300750	宁德时代	5,480	1,382,165.60	0.02
544	300012	华测检测	117,000	1,367,730.00	0.02
545	603816	顾家家居	53,500	1,365,320.00	0.02
546	300212	易华录	62,069	1,350,621.44	0.02
547	300938	信测标准	64,000	1,344,640.00	0.02
548	600516	方大炭素	287,240	1,332,793.60	0.02
549	600171	上海贝岭	38,800	1,328,900.00	0.02
550	301363	美好医疗	74,180	1,308,535.20	0.02
551	688122	西部超导	25,123	1,303,381.24	0.02
552	000733	振华科技	26,000	1,301,300.00	0.02
553	002014	永新股份	106,900	1,295,628.00	0.02
554	603486	科沃斯	21,900	1,275,237.00	0.02
555	000519	中兵红箭	58,100	1,271,809.00	0.02
556	688153	唯捷创芯	40,745	1,263,502.45	0.02
557	002637	赞宇科技	126,200	1,259,476.00	0.02
558	688052	纳芯微	7,064	1,232,597.36	0.02
559	000997	新大陆	38,062	1,232,447.56	0.02
560	600961	株冶集团	109,600	1,225,328.00	0.02
561	300003	乐普医疗	88,886	1,224,849.08	0.02
562	000657	中钨高新	103,200	1,223,952.00	0.02
563	002432	九安医疗	33,322	1,213,920.46	0.02
564	300059	东方财富	52,400	1,212,012.00	0.02
565	000739	普洛药业	86,200	1,206,800.00	0.02
566	600875	东方电气	71,800	1,201,932.00	0.02
567	603179	新泉股份	25,500	1,197,735.00	0.02
568	600699	均胜电子	68,607	1,196,506.08	0.02
569	600765	中航重机	70,800	1,195,104.00	0.02
570	002478	常宝股份	227,500	1,194,375.00	0.02
571	600673	东阳光	102,300	1,189,749.00	0.02
572	688065	凯赛生物	25,160	1,185,036.00	0.02
573	600129	太极集团	55,600	1,184,836.00	0.02
574	603596	伯特利	22,380	1,179,202.20	0.02
575	600373	中文传媒	114,203	1,172,864.81	0.02
576	600398	海澜之家	167,000	1,162,320.00	0.02
577	600583	海油工程	210,300	1,148,238.00	0.02
578	688059	华锐精密	24,466	1,144,030.16	0.02

579	600521	华海药业	61,192	1,140,006.96	0.02
580	300748	金力永磁	47,800	1,139,552.00	0.02
581	002984	森麒麟	60,572	1,135,725.00	0.02
582	002653	海思科	26,900	1,135,718.00	0.02
583	688031	星环科技	24,355	1,135,673.65	0.02
584	600316	洪都航空	29,900	1,127,230.00	0.02
585	688236	春立医疗	60,550	1,125,624.50	0.02
586	002044	美年健康	217,800	1,119,492.00	0.02
587	000513	丽珠集团	30,973	1,116,266.92	0.02
588	300809	华辰装备	29,600	1,112,368.00	0.02
589	601728	中国电信	143,400	1,111,350.00	0.02
590	688385	复旦微电	22,321	1,099,755.67	0.02
591	601615	明阳智能	95,600	1,098,444.00	0.02
592	688543	国科军工	18,175	1,093,953.25	0.02
593	002409	雅克科技	19,883	1,087,401.27	0.02
594	601106	中国一重	386,500	1,082,200.00	0.02
595	000403	派林生物	59,150	1,072,389.50	0.02
596	600562	国睿科技	34,000	1,070,660.00	0.02
597	300919	中伟股份	32,540	1,069,915.20	0.02
598	603920	世运电路	34,900	1,064,799.00	0.02
599	000400	许继电气	48,626	1,058,588.02	0.02
600	001696	宗申动力	47,000	1,055,150.00	0.02
601	688162	巨一科技	38,515	1,049,148.60	0.02
602	000921	海信家电	40,500	1,040,850.00	0.02
603	301498	乖宝宠物	9,500	1,039,015.00	0.02
604	601009	南京银行	88,700	1,030,694.00	0.02
605	603583	捷昌驱动	28,091	1,025,883.32	0.02
606	300308	中际旭创	7,000	1,021,020.00	0.02
607	002658	雪迪龙	129,300	1,012,419.00	0.02
608	600475	华光环能	97,000	1,010,740.00	0.02
609	688698	伟创电气	21,348	1,007,625.60	0.02
610	300070	碧水源	222,500	1,001,250.00	0.02
611	688301	奕瑞科技	11,396	998,403.56	0.02
612	603345	安井食品	12,400	997,208.00	0.02
613	600755	厦门国贸	164,560	995,588.00	0.02
614	688332	中科蓝讯	9,601	989,671.08	0.02
615	000651	格力电器	21,900	983,748.00	0.02
616	601212	白银有色	314,200	983,446.00	0.02
617	688100	威胜信息	26,392	977,823.60	0.02
618	688073	毕得医药	16,841	977,114.82	0.02
619	300487	蓝晓科技	19,400	975,820.00	0.02

620	601333	广深铁路	336,900	973,641.00	0.02
621	601966	玲珑轮胎	66,200	971,154.00	0.02
622	600872	中炬高新	51,100	970,900.00	0.02
623	601608	中信重工	221,500	967,955.00	0.02
624	601901	方正证券	122,000	965,020.00	0.02
625	601766	中国中车	135,200	951,808.00	0.02
626	603009	北特科技	22,800	950,760.00	0.02
627	688032	禾迈股份	9,411	939,782.46	0.02
628	002568	百润股份	36,500	934,765.00	0.02
629	688378	奥来德	53,892	908,080.20	0.02
630	600595	中孚实业	205,200	898,776.00	0.02
631	600985	淮北矿业	79,200	898,128.00	0.02
632	603568	伟明环保	46,657	890,215.56	0.02
633	600036	招商银行	19,300	886,835.00	0.02
634	600958	东方证券	91,500	885,720.00	0.02
635	688475	萤石网络	27,994	882,370.88	0.02
636	600325	华发股份	181,100	881,957.00	0.02
637	603939	益丰药房	35,536	869,565.92	0.02
638	600170	上海建工	361,100	863,029.00	0.02
639	600480	凌云股份	70,400	856,768.00	0.01
640	603277	银都股份	53,330	853,280.00	0.01
641	300285	国瓷材料	49,100	851,885.00	0.01
642	300676	华大基因	16,900	841,113.00	0.01
643	300856	科思股份	55,500	840,825.00	0.01
644	001309	德明利	7,100	840,214.00	0.01
645	300957	贝泰妮	18,700	826,914.00	0.01
646	002244	滨江集团	84,289	821,817.75	0.01
647	300567	精测电子	13,300	806,113.00	0.01
648	002773	康弘药业	27,700	802,469.00	0.01
649	600095	湘财股份	79,500	797,385.00	0.01
650	601001	晋控煤业	64,200	784,524.00	0.01
651	601686	友发集团	137,100	778,728.00	0.01
652	605080	浙江自然	27,900	775,620.00	0.01
653	002706	良信股份	86,800	773,388.00	0.01
654	600529	山东药玻	34,900	772,686.00	0.01
655	002139	拓邦股份	55,800	770,598.00	0.01
656	000062	深圳华强	28,600	768,196.00	0.01
657	600970	中材国际	89,400	767,052.00	0.01
658	002423	中粮资本	62,400	763,152.00	0.01
659	600167	联美控股	134,900	758,138.00	0.01
660	000709	河钢股份	350,900	757,944.00	0.01

661	688248	南网科技	24,070	757,242.20	0.01
662	300416	苏试试验	52,800	756,624.00	0.01
663	600012	皖通高速	44,400	753,912.00	0.01
664	603688	石英股份	21,338	751,524.36	0.01
665	000958	电投产融	109,400	748,296.00	0.01
666	601666	平煤股份	100,600	745,446.00	0.01
667	000155	川能动力	75,700	743,374.00	0.01
668	688286	敏芯股份	10,513	743,163.97	0.01
669	300755	华致酒行	38,500	743,050.00	0.01
670	000977	浪潮信息	14,588	742,237.44	0.01
671	688297	中无人机	13,717	732,487.80	0.01
672	601156	东航物流	55,887	731,560.83	0.01
673	600378	昊华科技	26,900	728,183.00	0.01
674	688520	神州细胞	12,060	721,791.00	0.01
675	000539	粤电力A	157,200	713,688.00	0.01
676	002430	杭氧股份	36,593	710,636.06	0.01
677	300144	宋城演艺	82,760	707,598.00	0.01
678	000951	中国重汽	40,200	706,716.00	0.01
679	688786	悦安新材	30,255	704,941.50	0.01
680	002916	深南电路	6,500	700,765.00	0.01
681	688234	天岳先进	11,958	700,140.90	0.01
682	600612	老凤祥	14,000	696,500.00	0.01
683	001288	运机集团	33,400	695,722.00	0.01
684	000725	京东方A	174,000	694,260.00	0.01
685	301536	星宸科技	11,500	693,450.00	0.01
686	688185	康希诺	11,510	686,341.30	0.01
687	002508	老板电器	35,700	678,657.00	0.01
688	301332	德尔玛	66,000	675,840.00	0.01
689	603290	斯达半导	8,200	666,414.00	0.01
690	002233	塔牌集团	89,302	660,834.80	0.01
691	301345	涛涛车业	6,100	659,410.00	0.01
692	601866	中远海发	266,300	657,761.00	0.01
693	000661	长春高新	6,600	654,588.00	0.01
694	000792	盐湖股份	38,100	650,748.00	0.01
695	300685	艾德生物	29,500	635,135.00	0.01
696	688599	天合光能	43,590	633,362.70	0.01
697	603203	快克智能	25,400	631,698.00	0.01
698	688396	华润微	13,387	631,330.92	0.01
699	603966	法兰泰克	67,493	626,335.04	0.01
700	000830	鲁西化工	60,324	621,337.20	0.01
701	605507	国邦医药	31,000	612,870.00	0.01

702	000967	盈峰环境	88,100	612,295.00	0.01
703	603889	新澳股份	104,500	606,100.00	0.01
704	688018	乐鑫科技	4,140	604,854.00	0.01
705	600848	上海临港	66,600	604,062.00	0.01
706	601399	国机重装	200,700	602,100.00	0.01
707	600032	浙江新能	78,848	596,090.88	0.01
708	688630	芯碁微装	7,464	592,417.68	0.01
709	001308	康冠科技	26,000	588,120.00	0.01
710	600546	山煤国际	67,102	585,800.46	0.01
711	002572	索菲亚	40,200	563,202.00	0.01
712	301301	川宁生物	46,500	559,860.00	0.01
713	688403	汇成股份	53,810	559,085.90	0.01
714	603650	彤程新材	17,300	556,195.00	0.01
715	605183	确成股份	31,500	551,250.00	0.01
716	605296	神农集团	17,900	550,246.00	0.01
717	601827	三峰环境	65,000	546,000.00	0.01
718	603039	泛微网络	9,800	545,860.00	0.01
719	603556	海兴电力	21,294	542,358.18	0.01
720	600754	锦江酒店	24,000	538,560.00	0.01
721	300601	康泰生物	35,236	535,234.84	0.01
722	301267	华夏眼科	27,800	532,926.00	0.01
723	688369	致远互联	20,172	532,339.08	0.01
724	603997	继峰股份	40,300	525,512.00	0.01
725	000582	北部湾港	63,600	524,700.00	0.01
726	688375	国博电子	8,621	517,346.21	0.01
727	600391	航发科技	17,500	511,000.00	0.01
728	688772	珠海冠宇	35,742	510,753.18	0.01
729	300969	恒帅股份	7,600	509,048.00	0.01
730	000898	鞍钢股份	217,100	503,672.00	0.01
731	600258	首旅酒店	35,300	498,789.00	0.01
732	688349	三一重能	19,782	493,363.08	0.01
733	300910	瑞丰新材	8,500	490,875.00	0.01
734	002452	长高电新	70,000	486,500.00	0.01
735	601858	中国科传	25,000	486,250.00	0.01
736	603081	大丰实业	44,900	485,818.00	0.01
737	002839	张家港行	106,400	478,800.00	0.01
738	688037	芯源微	4,460	478,112.00	0.01
739	300357	我武生物	23,000	474,720.00	0.01
740	000883	湖北能源	102,600	462,726.00	0.01
741	002372	伟星新材	44,300	458,948.00	0.01
742	301091	深城交	15,600	456,144.00	0.01

743	603871	嘉友国际	42,400	455,800.00	0.01
744	605189	富春染织	35,880	445,629.60	0.01
745	002371	北方华创	1,000	442,210.00	0.01
746	603658	安图生物	11,700	438,750.00	0.01
747	000600	建投能源	62,400	431,184.00	0.01
748	603225	新凤鸣	40,100	427,065.00	0.01
749	601636	旗滨集团	84,700	424,347.00	0.01
750	300394	天孚通信	5,260	419,958.40	0.01
751	002543	万和电气	37,000	411,070.00	0.01
752	688386	泛亚微透	7,456	404,935.36	0.01
753	002949	华阳国际	29,600	399,008.00	0.01
754	603233	大参林	23,977	390,825.10	0.01
755	605128	上海沿浦	12,900	390,354.00	0.01
756	601965	中国汽研	21,140	375,235.00	0.01
757	688150	莱特光电	15,134	374,112.48	0.01
758	688484	南芯科技	9,432	373,035.60	0.01
759	600339	中油工程	113,600	371,472.00	0.01
760	000776	广发证券	21,700	364,777.00	0.01
761	600502	安徽建工	77,500	364,250.00	0.01
762	001322	箭牌家居	43,000	363,350.00	0.01
763	003035	南网能源	77,100	353,889.00	0.01
764	300795	米奥会展	23,800	353,430.00	0.01
765	688372	伟测科技	5,730	346,092.00	0.01
766	300378	鼎捷数智	9,300	340,380.00	0.01
767	300652	雷迪克	5,600	329,784.00	0.01
768	002518	科士达	14,500	327,555.00	0.01
769	688082	盛美上海	2,845	324,159.30	0.01
770	688016	心脉医疗	3,624	320,434.08	0.01
771	603368	柳药集团	18,938	320,241.58	0.01
772	603699	纽威股份	10,200	317,934.00	0.01
773	300894	火星人	24,400	313,052.00	0.01
774	601133	柏诚股份	24,500	311,395.00	0.01
775	002270	华明装备	18,400	308,016.00	0.01
776	688157	松井股份	7,698	306,996.24	0.01
777	002466	天齐锂业	9,500	304,380.00	0.01
778	300041	回天新材	31,600	297,672.00	0.01
779	000807	云铝股份	18,600	297,228.00	0.01
780	600927	永安期货	19,700	291,757.00	0.01
781	603859	能科科技	9,000	290,880.00	0.01
782	688112	鼎阳科技	7,696	284,521.12	0.00
783	600720	中交设计	36,200	279,826.00	0.00

784	605555	德昌股份	16,380	271,416.60	0.00
785	603848	好太太	16,900	260,260.00	0.00
786	603730	岱美股份	45,070	256,448.30	0.00
787	301061	匠心家居	3,300	255,882.00	0.00
788	001213	中铁特货	60,800	246,848.00	0.00
789	300785	值得买	7,600	241,908.00	0.00
790	002073	软控股份	26,600	236,474.00	0.00
791	000983	山西焦煤	36,800	235,520.00	0.00
792	001389	广合科技	4,000	235,080.00	0.00
793	603786	科博达	4,200	232,722.00	0.00
794	000408	藏格矿业	5,400	230,418.00	0.00
795	688333	铂力特	3,744	222,992.64	0.00
796	601111	中国国航	28,000	220,920.00	0.00
797	600007	中国国贸	10,700	220,206.00	0.00
798	300218	安利股份	14,400	215,712.00	0.00
799	603667	五洲新春	6,400	214,464.00	0.00
800	605089	味知香	8,600	213,624.00	0.00
801	001380	华纬科技	10,400	212,992.00	0.00
802	301004	嘉益股份	3,200	211,936.00	0.00
803	603919	金徽酒	11,700	211,770.00	0.00
804	002609	捷顺科技	17,600	205,568.00	0.00
805	688156	路德环境	11,252	190,271.32	0.00
806	688232	新点软件	6,115	183,694.60	0.00
807	601528	瑞丰银行	30,800	178,332.00	0.00
808	002315	焦点科技	3,900	178,191.00	0.00
809	300203	聚光科技	8,000	177,040.00	0.00
810	688143	长盈通	4,537	176,943.00	0.00
811	603383	顶点软件	4,000	169,600.00	0.00
812	688001	华兴源创	6,536	165,164.72	0.00
813	002876	三利谱	6,500	163,735.00	0.00
814	603296	华勤技术	2,000	161,360.00	0.00
815	600186	莲花控股	26,800	160,800.00	0.00
816	002918	蒙娜丽莎	19,000	157,700.00	0.00
817	603515	欧普照明	8,700	156,513.00	0.00
818	600104	上汽集团	9,600	154,080.00	0.00
819	000630	铜陵有色	45,200	150,968.00	0.00
820	002807	江阴银行	31,700	150,575.00	0.00
821	002705	新宝股份	10,000	147,000.00	0.00
822	000975	山金国际	6,800	128,792.00	0.00
823	600323	瀚蓝环境	5,000	121,750.00	0.00
824	002469	三维化学	14,400	119,664.00	0.00

825	300620	光库科技	2,500	117,775.00	0.00
826	688793	倍轻松	3,455	115,016.95	0.00
827	300952	恒辉安防	4,000	113,920.00	0.00
828	688295	中复神鹰	5,209	108,347.20	0.00
829	301550	斯菱股份	1,200	107,148.00	0.00
830	000928	中钢国际	16,900	106,132.00	0.00
831	000962	东方钽业	6,400	105,024.00	0.00
832	600028	中国石化	18,400	103,776.00	0.00
833	688337	普源精电	2,255	80,435.85	0.00
834	688581	安杰思	1,240	80,389.20	0.00
835	688550	瑞联新材	1,856	79,826.56	0.00
836	000498	山东路桥	13,500	79,380.00	0.00
837	000685	中山公用	9,000	79,020.00	0.00
838	002838	道恩股份	4,400	78,804.00	0.00
839	300354	东华测试	2,000	77,760.00	0.00
840	300768	迪普科技	4,500	77,175.00	0.00
841	301257	普蕊斯	2,500	77,000.00	0.00
842	002749	国光股份	5,000	74,600.00	0.00
843	603180	金牌家居	3,700	72,039.00	0.00
844	688775	影石创新	573	71,143.68	0.00
845	301349	信德新材	1,800	70,326.00	0.00
846	300274	阳光电源	1,000	67,770.00	0.00
847	688522	纳睿雷达	849	43,485.78	0.00
848	601319	中国人保	3,900	33,969.00	0.00
849	603049	中策橡胶	724	31,023.40	0.00
850	601995	中金公司	800	28,288.00	0.00
851	688545	兴福电子	994	26,788.30	0.00
852	301458	钧崴电子	701	23,911.11	0.00
853	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.00
854	688486	龙迅股份	305	20,398.40	0.00
855	688583	思看科技	227	18,087.36	0.00
856	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
857	301602	超研股份	658	16,318.40	0.00
858	605198	安德利	400	16,124.00	0.00
859	301501	恒鑫生活	350	15,827.00	0.00
860	603202	天有为	166	15,049.56	0.00
861	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
862	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
863	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
864	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
865	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00

866	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
867	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
868	600059	古越龙山	800	8,728.00	0.00
869	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
870	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
871	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
872	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
873	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
874	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
875	603258	电魂网络	200	5,020.00	0.00
876	600481	双良节能	1,000	4,820.00	0.00
877	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
878	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
879	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
880	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
881	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
882	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
883	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
884	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
885	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
886	603120	肯特催化	65	2,172.95	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	601991	大唐发电	93,486,922.64	1.28
2	300001	特锐德	87,620,549.54	1.20
3	600021	上海电力	83,833,888.00	1.15
4	600988	赤峰黄金	82,485,858.00	1.13
5	600839	四川长虹	78,684,430.06	1.08
6	603893	瑞芯微	76,561,266.88	1.05
7	600096	云天化	73,575,464.50	1.01
8	600535	天士力	72,120,694.15	0.99
9	000050	深天马 A	70,358,596.00	0.96
10	601555	东吴证券	69,664,807.00	0.95
11	002223	鱼跃医疗	67,376,315.03	0.92
12	603728	鸣志电器	65,736,331.00	0.90
13	601928	凤凰传媒	65,534,632.00	0.90
14	601398	工商银行	65,484,293.84	0.89

15	002966	苏州银行	64,023,633.00	0.87
16	002065	东华软件	62,595,879.00	0.86
17	002273	水晶光电	62,566,849.00	0.85
18	300383	光环新网	61,854,912.00	0.85
19	002410	广联达	61,220,034.00	0.84
20	002318	久立特材	60,564,128.00	0.83

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	002261	拓维信息	138,631,253.68	1.89
2	300001	特锐德	135,208,286.75	1.85
3	600096	云天化	131,562,897.46	1.80
4	600988	赤峰黄金	121,854,752.16	1.66
5	603893	瑞芯微	113,225,368.82	1.55
6	600021	上海电力	113,157,994.93	1.55
7	600038	中直股份	91,602,350.40	1.25
8	600299	安迪苏	88,981,489.00	1.22
9	000066	中国长城	88,937,582.94	1.22
10	601108	财通证券	88,533,309.00	1.21
11	600839	四川长虹	85,093,264.00	1.16
12	002410	广联达	83,325,594.00	1.14
13	300002	神州泰岳	80,263,935.00	1.10
14	000729	燕京啤酒	79,650,995.80	1.09
15	688578	艾力斯	79,090,202.42	1.08
16	601991	大唐发电	76,761,013.00	1.05
17	002444	巨星科技	76,597,466.20	1.05
18	600352	浙江龙盛	76,166,474.00	1.04
19	300339	润和软件	75,296,545.00	1.03
20	300677	英科医疗	74,912,803.80	1.02

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	16,229,565,123.29
卖出股票收入（成交）总额	17,827,648,916.13

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	4,017,629.59	0.07
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）	50,827.89	0.00
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	4,068,457.48	0.07

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	019766	25 国债 01	40,000	4,017,629.59	0.07
2	123256	恒帅转债	222	50,827.89	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，贵阳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贵州监管局的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，江苏金融租赁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江苏监管局的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，苏州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江苏监管局的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，长沙银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行湖南省分行的处罚。

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	1,191,143.11
2	应收清算款	31,425.33
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	938,634.46
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	2,161,202.90

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未持有流通受限的股票。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中未持有流通受限股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额 比例 (%)	持有份额	占总份额 比例 (%)
富国中证 500 指数增强 (LOF) A/B	427,709	5,592.78	101,099,066.82	4.23	2,290,982,847.49	95.77
富国中证 500 指数增强 (LOF) C	9,966	45,490.83	414,501,244.13	91.43	38,860,342.62	8.57
富国中证 500 指数增强 (LOF) Y	1,420	2,614.96	—	—	3,713,237.81	100.00
合计	439,095	6,488.70	515,600,310.95	18.10	2,333,556,427.92	81.90

8.2 期末上市基金前十名持有人

富国中证 500 指数增强 (LOF) A/B

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	合肥黄山大厦酒店管理集团有限公司	1,673,347.00	3.05
2	吴林萍	707,463.00	1.29
3	范伟	700,000.00	1.28
4	厦门市营嘉系统集成技术有限公司	609,958.00	1.11
5	丁飞	536,100.00	0.98
6	陈阳	500,000.00	0.91
7	唐文萍	414,800.00	0.76
8	董理	404,300.00	0.74
9	孙选艳	401,718.00	0.73
10	李宏伟	362,575.00	0.66

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 500 指数增强 (LOF) A/B	1,172,875.80	0.0490
	富国中证 500 指数增强 (LOF) C	5,191.07	0.0011
	富国中证 500 指数增强 (LOF) Y	62,120.30	1.6729
	合计	1,240,187.17	0.0435

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 500 指数增强（LOF）A/B	50~100
	富国中证 500 指数增强（LOF）C	0
	富国中证 500 指数增强（LOF）Y	0~10
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	富国中证 500 指数增强（LOF）A/B	0~10
	富国中证 500 指数增强（LOF）C	0
	富国中证 500 指数增强（LOF）Y	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	富国中证 500 指数增强(LOF)A/B	富国中证 500 指数增强 (LOF) C	富国中证 500 指数增强 (LOF) Y
基金合同生效日(2011 年 10 月 12 日)基金份额总额	455,487,249.88	—	—
报告期期初基金份额总额	3,241,973,482.36	510,247,925.66	1,213,947.49
本报告期基金总申购份额	142,700,875.47	149,406,749.17	3,077,984.71
减：本报告期基金总赎回份额	992,592,443.52	206,293,088.08	578,694.39
本报告期基金拆分变动份额	—	—	—
本报告期期末基金份额总额	2,392,081,914.31	453,361,586.75	3,713,237.81

§ 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。

2025 年 2 月，中国农业银行总行决定陈振华任托管业务部副总裁。2025 年 3 月，中国农业银行总行决定常佳任托管业务部副总裁。2025 年 4 月，中国农业银行总行决定李亚红任托管业务部高级专家。

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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			比例 (%)		(%)	
德邦证券	1	—	—	—	—	—
东北证券	2	—	—	—	—	—
东方证券	4	1,924,457,729.88	5.65	261,539.98	5.65	—
广发证券	2	8,116,518,539.20	23.83	1,103,394.16	23.84	—
国海证券	2	—	—	—	—	—
国联民生	1	—	—	—	—	—
国泰海通	3	3,809,878,333.55	11.19	517,873.86	11.19	—
国泰君安	2	1,473,405,638.55	4.33	200,244.03	4.33	—
国投证券	2	—	—	—	—	—
国信证券	2	6,534,015,442.97	19.19	888,119.93	19.19	—
海通证券	1	598,278,858.76	1.76	81,308.45	1.76	—
华泰证券	2	—	—	—	—	—
华兴证券	1	—	—	—	—	—
汇丰前海	2	—	—	—	—	—
开源证券	2	—	—	—	—	—
申万宏源	3	1,434,423,692.46	4.21	194,950.87	4.21	—
兴业证券	2	—	—	—	—	—
银河证券	2	2,239,628,441.98	6.58	304,440.67	6.58	—
浙商证券	1	—	—	—	—	—
中金公司	2	—	—	—	—	—
中泰证券	1	—	—	—	—	—
中信建投	2	—	—	—	—	—
中信证券	3	7,924,627,284.69	23.27	1,077,215.20	23.27	—

注：1、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。本报告期本基金新增券商交易单元：华泰证券（018902、62115），银河证券（006939、55402），中金公司（26152、393652）。

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（%）
德邦证券	—	—	—	—	—	—
东北证券	—	—	—	—	—	—
东方证券	4,140,541.88	2.54	—	—	—	—
广发证券	61,813,260.00	37.97	—	—	—	—
国海证券	—	—	—	—	—	—
国联民生	—	—	—	—	—	—
国泰海通	—	—	—	—	—	—
国泰君安	—	—	—	—	—	—
国投证券	—	—	—	—	—	—
国信证券	—	—	—	—	—	—
海通证券	—	—	—	—	—	—
华泰证券	49,978,098.00	30.70	—	—	—	—
华兴证券	—	—	—	—	—	—
汇丰前海	—	—	—	—	—	—
开源证券	—	—	—	—	—	—
申万宏源	—	—	—	—	—	—
兴业证券	—	—	—	—	—	—
银河证券	940,378.88	0.58	—	—	—	—
浙商证券	—	—	—	—	—	—
中金公司	—	—	—	—	—	—
中泰证券	—	—	—	—	—	—
中信建投	—	—	—	—	—	—
中信证券	45,942,060.00	28.22	—	—	—	—

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
3	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
4	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

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2025-02-18 至 2025-03-18	679,530,203.62	100,351,229.30	380,458,604.35	399,422,828.57	14.02%
产品特有风险							
本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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