富兰克林国海中证A100指数增强型证券投资基金（LOF）
2026年中期报告

2026年6月30日

基金管理人：国海富兰克林基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2026年8月31日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。

基金管理人承诺以诚实信用、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 6
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 6

3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7

§4 管理人报告 8

4.1 基金管理人及基金经理情况 8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 9
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 10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 11
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 11

§5 托管人报告 11

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 11
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 11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 12

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 12

6.1 资产负债表 12
6.2 利润表 13
6.3 净资产变动表 14
6.4 报表附注 16

§7 投资组合报告 35

7.1 期末基金资产组合情况 35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 35
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 37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 41
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 41

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 41
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 41
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 41
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 42
7.12 投资组合报告附注 42

§8 基金份额持有人信息 43

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 43
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 43

§9 开放式基金份额变动 43

§10 重大事件揭示 43

10.1 基金份额持有人大会决议 43
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 43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 44
10.4 基金投资策略的改变 44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 44
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 44
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 44
10.8 其他重大事件 46

§11 影响投资者决策的其他重要信息 47

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 47
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 47

§12 备查文件目录 48

12.1 备查文件目录 48
12.2 存放地点 48
12.3 查阅方式 48

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富兰克林国海中证 A100 指数增强型证券投资基金（LOF）
基金简称	国富中证 A100 指数增强（LOF）
场内简称	国富中证 A100LOF
基金主代码	164508
交易代码	164508
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2015 年 3 月 26 日
基金管理人	国海富兰克林基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	26,057,615.58 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	2020 年 4 月 22 日

注：根据《富兰克林国海中证 100 指数增强型分级证券投资基金基金合同》和《关于富兰克林国海中证 100 指数增强型分级证券投资基金 5 年分级运作期届满与基金份额转换的公告》，本基金基金合同生效后 5 年期届满，本基金无需召开基金份额持有人大会，自动转换为上市开放式基金(LOF)，本基金转型日为 2020 年 3 月 26 日，自 2020 年 3 月 27 日（基金转型后首个运作日）起基金名称变更为“富兰克林国海中证 100 指数增强型证券投资基金(LOF)”。因标的指数名称变更，自 2024 年 10 月 28 日起，富兰克林国海中证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）相应更名为富兰克林国海中证 A100 指数增强型证券投资基金（LOF）。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金。通过量化风险管理方法，控制基金投资组合与标的指数构成的偏差，同时采取适当的增强策略，在严格控制跟踪误差风险的基础上，力争获得超越业绩比较基准的投资收益，追求基金资产的长期增值。在正常市场情况下，本基金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%。
投资策略	本基金基于被动复制的指数化投资方法，在严格控制跟踪误差风险的基础上，适度运用资产配置调整、行业配置调整、指数成份股权重优化等主动增强策略，力争获得超越业绩比较基准的投资收益。在资产配置上，本基金采取指数增强策略。为控制基金的跟踪误差风险，本基金的资产配置将保持与业绩比较基准基本一致，只在股票、债券（主要是国债）、现金等各大类资产间进行小幅度的主动调整，追求适度超越业绩比较基准的收益目标。在股票投资上，为严格控制跟踪误差风险，本基金的股票投资以被动复制跟踪标的指数

	为主，辅以适度的增强策略。在债券投资上，本基金债券投资的主要目的是在保证基金资产流动性的前提下，提高基金资产的投资收益。 本基金也可进行股指期货投资。
业绩比较基准	中证A100指数收益率*95%+银行同业存款利率*5%
风险收益特征	本基金是股票指数增强型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金，属于较高风险收益特征的证券投资基金。

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		国海富兰克林基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	储丽莉	许俊
	联系电话	021-3855 5555	010-66596688
	电子邮箱	service@ftsfund.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-700-4518、9510-5680和021－38789555	95566
传真		021-6888 3050	010-66594942
注册地址		南宁高新区中国-东盟企业总部基地三期综合楼A座17层1707室	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期9层	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		刘峻	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.ftsfund.com
基金中期报告置备地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区金融大街27号投资广场23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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026年1月1日-2026年6月30日)
本期已实现收益	2,185,606.79
本期利润	3,361,806.34
加权平均基金份额本期利润	0.1234
本期加权平均净值利润率	9.17%

本期基金份额净值增长率	9.58%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026年6月30日)
期末可供分配利润	14,183,248.75
期末可供分配基金份额利润	0.5443
期末基金资产净值	36,943,940.10
期末基金份额净值	1.418
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026年6月30日)
基金份额累计净值增长率	37.00%

注：1、上述财务指标采用的计算公式，详见证监会发布的证券投资基金信息披露编报规则－第1号《主要财务指标的计算及披露》。

2、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。

3、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）。

4、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如，开放式基金的申购赎回费等，计入费用后实际收益要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	12.81%	1.33%	11.76%	1.30%	1.05%	0.03%
过去六个月	9.58%	1.20%	8.08%	1.16%	1.50%	0.04%
过去一年	31.30%	1.05%	28.86%	1.05%	2.44%	0.00%
过去三年	29.85%	1.05%	30.50%	1.09%	-0.65%	-0.04%
过去五年	-3.86%	1.07%	-5.75%	1.10%	1.89%	-0.03%
自基金合同生效起至今	37.00%	1.10%	27.86%	1.12%	9.14%	-0.02%

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



注：本基金已在转换基准日 2020 年 3 月 26 日日终转换为上市开放式基金（LOF）。本基金在 6 个月建仓期结束时，各项投资比例符合基金合同约定。

§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

国海富兰克林基金管理有限公司成立于 2004 年 11 月，由国海证券股份有限公司和富兰克林邓普顿全资子公司邓普顿国际股份有限公司共同出资组建，国海证券股份有限公司持有 51%的股份，邓普顿国际股份有限公司持有 49%的股份。目前公司注册资本 2.2 亿元人民币。

国海证券股份有限公司是国内 A 股市场第 16 家上市券商，是拥有全业务牌照，营业网点遍布中国主要城市的全国性综合类证券公司。富兰克林邓普顿是世界知名基金管理公司，在全球市场具备超过 75 年的投资管理经验。国海富兰克林基金管理有限公司引进富兰克林邓普顿享誉全球的投资机制、研究平台和风险控制体系，借助国海证券股份有限公司的综合业务优势，力争成为国内一流的基金管理公司。

国海富兰克林基金管理有限公司具有丰富的基金管理经验，截至 2026 年 6 月末，公司旗下合计管理 50 只公募基金产品。

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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张志强	公司量化与指数投资总监、金融工程部总经理，国富沪深300指数增强基金、国富中证A100指数增强（LOF）基金及国富国证港股通科技指数基金的基金经理	2015年3月26日	-	23年	张志强先生，CFA，纽约州立大学（布法罗）计算机科学硕士，中国科学技术大学数学专业硕士。历任美国Enreach Technology Inc.软件工程师，海通证券股份有限公司研究所高级研究员，友邦华泰基金管理有限公司高级数量分析师，国海富兰克林基金管理有限公司首席数量分析师、风险控制部总经理、业务发展部总经理、兼任投资经理、职工监事。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司量化与指数投资总监、金融工程部总经理，国富沪深300指数增强基金、国富中证A100指数增强（LOF）基金及国富国证港股通科技指数基金的基金经理。

注：

1. 表中“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期，其中，首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日。

2. 表中“证券从业年限”的计算标准为该名员工从事过的所有诸如基金、证券、投资等相关金融领域的工作年限的总和。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律、法规和《富兰克林国海中证A100指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》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，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。基金投资组合符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定。

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

报告期内公司严格执行《公平交易管理制度》，明确了公平交易的原则和目标，制订了实现公平交易的具体措施，并在技术上按照公平交易原则实现了严格的交易公平分配。

因本基金的基金经理兼任私募资产管理计划投资经理，本基金管理人依据相关法律法规加强了对本基金公平交易执行情况的监控，报告期内基金经理无在管私募资产管理计划。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司严格按照《异常交易监控与报告制度》和《同日反向交易管理办法》对异常交易进行监控。

报告期内公司不存在投资组合之间发生交易所公开竞价同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。

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年上半年，国内经济的总体特点是生产稳定、内需改善缓慢、外需景气度高。流动性方面，上半年资金面总体保持宽松，5、6月间阶段性出现边际收敛的迹象，但在央行精准操作下很快平复了波动。上半年，全球地缘政治事件频发、美国降息周期受阻、金融市场波动较大，对A股市场有一定负面影响。好在这轮AI技术引领的全球科技周期仍处于上行期，科技板块的景气度高，科技股的良好表现提高了市场活跃度和投资者的风险偏好，提升了A股的整体表现。

上半年A股市场震荡上行，波动幅度高于去年下半年。风格方面，科技成长优势明显。行业方面，电子、通信、建筑材料、机械设备等行业上涨幅度较大，而商贸零售、保险、农林牧渔、美容护理、食品饮料、钢铁、传媒、汽车、休闲服务、房地产等行业跌幅较大。上半年，中证A100指数上涨8.47%。

报告期内，本基金在保持均衡的组合配置以控制主动投资风险的前提下，继续使用量化选股模型精选个股并构建投资组合，取得了一定的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金（各类）份额净值及业绩表现请见“3.1主要会计数据和财务指标”及“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”部分披露。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年，在内需提振乏力、但流动性充裕、政策宽松、科技板块景气度高的大背景下，预计市场将延续前期的风格。但短期而言，前期部分板块和个股涨幅较大，市场交易非常拥挤，存在回调压力。中期来看，我们仍然处于全球科技周期上行期，国内流动性环境和政策环境保持友好，顺应科技产业发展趋势、满足新质生产力要求、符合国家经济发展大战略的人工智能基础设施建设和应用、半导体芯片等核心科技产业、高端制造业等具备较好的投资价值。

投资策略方面，本基金下半年仍将保持均衡配置，控制主动投资风险。同时，力争通过选股

和其它有效策略，积极争取超额收益。本基金将继续按照基金合同及相关法律法规要求，努力做好基金投资工作，争取未来更好的长期投资收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司在报告期内有效控制基金估值流程，按照相关法律法规的规定设有投资资产估值委员会（简称“估值委员会”），并已制订了《投资产品估值管理办法》。估值委员会审核和决定投资资产估值的相关事务，确保基金估值的公允、合理，保证估值未被歪曲以免对基金持有人产生不利影响。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由总经理或其任命者负责，成员包括投研、风险控制、监察稽核、交易、基金核算方面的部门主管，相关人员均具有丰富的证券基金行业从业经验和专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，应向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截至本报告期末，根据基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未分配的利润。

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

报告期内，本基金已连续60个工作日基金资产净值低于五千万元，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。本报告期内本基金管理人积极开展持续营销，努力落实解决方案。

因前述情形，经公司决策，自2024年7月1日起，由基金管理人承担本基金项下相关固定费用。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在富兰克林国海中证A100指数增强型证券投资基金（LOF）（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：富兰克林国海中证A100指数增强型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2026年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	470,583.16	675,894.17
结算备付金		62,377.29	57,663.37
存出保证金		4,760.47	1,367.05
交易性金融资产	6.4.7.2	36,450,364.42	36,059,622.44
其中：股票投资		34,530,429.00	34,138,427.81
基金投资		-	-
债券投资		1,919,935.42	1,921,194.63
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		4,978.39	55,270.91
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		36,993,063.73	36,849,817.94
负债和净资产	**附注号**	**本期末**	**上年度末**

		2026年6月30日	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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		10,009.06	123,027.21
应付管理人报酬		25,222.37	26,382.61
应付托管费		4,450.98	4,655.74
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		70.22	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	9,371.00	6,709.28
负债合计		49,123.63	160,774.84
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	22,760,691.35	24,761,005.03
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	14,183,248.75	11,928,038.07
净资产合计		36,943,940.10	36,689,043.10
负债和净资产总计		36,993,063.73	36,849,817.94

注： 报告截止日2026年06月30日，基金份额净值1.418元，基金份额总额26,057,615.58份。

6.2 利润表

会计主体：富兰克林国海中证A100指数增强型证券投资基金（LOF）

本报告期：2026年1月1日至2026年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
一、营业总收入		3,544,944.85	715,475.73
1.利息收入		1,214.57	2,170.65
其中：存款利息收入	6.4.7.13	1,214.57	2,170.65
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）		2,364,918.54	576,194.93

其中：股票投资收益	6.4.7.14	2,044,588.78	173,280.04
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	17,444.24	7,322.30
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	302,885.52	395,592.59
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	1,176,199.55	135,478.59
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	2,612.19	1,631.56
减：二、营业总支出		183,138.51	169,788.76
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	154,389.85	143,368.42
2．托管费	6.4.10.2.2	27,245.27	25,300.32
3．销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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	6.4.7.22	-	-
7．税金及附加		41.94	-
8．其他费用	6.4.7.23	1,461.45	1,120.02
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,361,806.34	545,686.97
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,361,806.34	545,686.97
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3,361,806.34	545,686.97

6.3 净资产变动表

会计主体：富兰克林国海中证A100指数增强型证券投资基金（LOF）

本报告期：2026年1月1日至2026年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	24,761,005.03	-	11,928,038.07	36,689,043.10
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	24,761,005.03	-	11,928,038.07	36,689,043.10
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,000,313.68	-	2,255,210.68	254,897.00
（一）、综合收益总额	-	-	3,361,806.34	3,361,806.34
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-2,000,313.68	-	-1,106,595.66	-3,106,909.34
其中：1.基金申购款	1,310,287.15	-	703,823.17	2,014,110.32
2.基金赎回款	-3,310,600.83	-	-1,810,418.83	-5,121,019.66
（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	22,760,691.35	-	14,183,248.75	36,943,940.10

项目	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	28,531,556.33	-	6,138,188.91	34,669,745.24
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	28,531,556.33	-	6,138,188.91	34,669,745.24
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-926,888.14	-	388,937.23	-537,950.91
（一）、综合收益总额	-	-	545,686.97	545,686.97
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-926,888.14	-	-156,749.74	-1,083,637.88
其中：1.基金申购款	895,343.77	-	186,471.70	1,081,815.47

2.基金赎回款	-1,822,231.91	-	-343,221.44	-2,165,453.35
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	27,604,668.19	-	6,527,126.14	34,131,794.33

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：

徐荔蓉	于意	肖燕
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

富兰克林国海中证 A100 指数增强型证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)是由富兰克林国海中证 100 指数增强型证券投资基金(LOF)(原富兰克林国海中证 100 指数增强型分级证券投资基金,以下简称“国富中证 100 指数增强分级基金”)变更基金名称而来。根据原《富兰克林国海中证 100 指数增强型分级证券投资基金基金合同》以及《富兰克林国海中证 100 指数增强型分级证券投资基金转换结果公告》,国富中证 100 指数增强分级基金以 2020 年 3 月 26 日为基金份额转换基准日，在基金份额转换基准日日终，将国富中证 100 指数增强分级基金之稳健收益类份额及国富中证 100 指数增强分级基金之积极收益类份额以各自的基金份额参考净值为基础，按照国富中证 100 指数增强分级基金基础份额的基金份额净值转换为富兰克林国海中证 100 指数增强型证券投资基金(LOF)基金份额，并自 2020 年 3 月 27 日起，更名为“富兰克林国海中证 100 指数增强型证券投资基金(LOF)”，变更后的《富兰克林国海中证 100 指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同》于同一日生效。经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2020]291 号核准，本基金国富中证 100(LOF)份额 10,331,397.00 份(截至 2020 年 4 月 15 日)于 2020 年 4 月 22 日在深交所挂牌交易。对于托管在场外的国富中证 100(LOF)份额，基金份额持有人将其转托管至深交所场内后即可上市流通。

根据本基金的基金管理人于 2024 年 10 月 24 日发布的《国海富兰克林基金管理有限公司关于旗下富兰克林国海中证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）变更基金名称并修改基金合同等法律文件的公告》，富兰克林国海中证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）更名为“富兰克林国海中

证A100指数增强型证券投资基金（LOF）”。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为国海富兰克林基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海中证A100指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定，本基金资产投资于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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证)、债券、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。如果法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计(轧差计算)占基金资产净值的比例为90%-95%，其中投资于股票资产(含存托凭证)的比例不低于基金资产净值的90%，投资于中证A100指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产净值的80%；债券、现金以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例为5%-10%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或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。本基金投资组合的业绩比较基准为中证A100指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人国海富兰克林基金管理有限公司于2026年8月31日批准报出。

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06月30日的财务状况以及2026年01月01日至2026年06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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

（1）印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；根据财政部、税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

（2）增值税

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令第826号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告2026年第10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自2026年1月1日至2027年12月31日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照3%的规定征收率计算缴纳增值税，公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入免征增值税；自2026年1月1日至2027年12月31日，金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税；本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为适用简易计税方法，按照3%的征收率计算缴纳增值税；

根据财政部、税务总局公告2025年第4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的

规定，自2025年8月8日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在2025年8月8日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

（3）城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育附加。

（4）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（5）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026年6月30日
活期存款	470,583.16
等于：本金	470,543.75
加：应计利息	39.41
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	470,583.16

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026年6月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		29,519,156.21	-	34,530,429.00	5,011,272.79
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,903,515.00	18,605.42	1,919,935.42	-2,185.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,903,515.00	18,605.42	1,919,935.42	-2,185.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		31,422,671.21	18,605.42	36,450,364.42	5,009,087.79

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

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

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

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末

	2026年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	28.37
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	9,342.63
其中：交易所市场	9,342.63
银行间市场	-
应付利息	-
合计	9,371.00

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	28,347,810.35	24,761,005.03
本期申购	1,500,112.77	1,310,287.15
本期赎回（以“-”号填列）	-3,790,307.54	-3,310,600.83
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	26,057,615.58	22,760,691.35

注：2026年6月30日止，本基金于深交所上市的基金份额为1,343,258.00份，托管在场外未上市交易的基金份额为24,714,357.58份。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	17,393,642.65	-5,465,604.58	11,928,038.07
本期期初	17,393,642.65	-5,465,604.58	11,928,038.07
本期利润	2,185,606.79	1,176,199.55	3,361,806.34
本期基金份额交易产生的变动数	-1,513,531.57	406,935.91	-1,106,595.66
其中：基金申购款	972,636.81	-268,813.64	703,823.17
基金赎回款	-2,486,168.38	675,749.55	-1,810,418.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18,065,717.87	-3,882,469.12	14,183,248.75

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
活期存款利息收入	1,137.31
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	70.11
其他	7.15
合计	1,214.57

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	2,044,588.78
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	2,044,588.78

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出股票成交总额	36,909,808.16
减：卖出股票成本总额	34,828,025.41
减：交易费用	37,193.97
买卖股票差价收入	2,044,588.78

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	12,511.24
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	4,933.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	17,444.24

6.4.7.15.2 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1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,022,783.40
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,995,179.00
减：应计利息总额	22,671.40
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	4,933.00

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	302,885.52
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	302,885.52

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	1,176,199.55
股票投资	1,183,390.55
债券投资	-7,191.00
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	1,176,199.55

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	2,612.19
合计	2,612.19

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	-
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费用	1,461.45
合计	1,461.45

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

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

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

无。

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
国海富兰克林基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
国海证券股份有限公司（“国海证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述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1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6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（%）
国海证券	-	-	5,004,293.00	6.46

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 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1月1日至2026年6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（%）
国海证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6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（%）
国海证券	1,001.00	6.46	1,001.00	12.55

注：1、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，以未包含印花税、经手费、证管费和过户费等费用的净额列示。

2、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，基金管理人管理的被动股票型基金的

股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

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1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	154,389.85	143,368.42
其中：应支付销售机构的客户维护费	70,116.08	60,968.58
应支付基金管理人的净管理费	84,273.77	82,399.84

注：支付基金管理人国海富兰克林基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.85%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.85%÷当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	27,245.27	25,300.32

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值×0.15%÷当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

1.基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。

2.本报告期和上年度可比期间(2025年1月1日至2025年6月30日)基金管理人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

1.本基金除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。

2.本报告期末和上年度末（2025年12月31日）除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	470,583.16	1,137.31	942,613.04	2,061.05

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2026年6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

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

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

本基金在日常投资管理中面临的与各种金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险等。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险管理委员会为核心的，由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、风险控制部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面，由监察稽核部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理，由风险控制部负责投资风险管理与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性和定量相结合的分析方法去评估各种风险发生的可能性及其发生可能给基金资产造成的损失。从定性分析的角度出发，主要是发掘各类风险的风险点，判断风险发生的频度和损失，对风险实行分级管理。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的分析报告，确定基金资产的风险状态及其是否符合基金的风险特征，及时对各种风险进行监控和评估，并通过风险处置流程，将风险控制在可承受的范围内。

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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人，定期存款存放在具有证券投资基金托管资格、基金销售业务资格、

合格境外机构投资者托管人资格或其他经管理人评估资质良好的商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	1,919,935.42	1,921,194.63
合计	1,919,935.42	1,921,194.63

注：1. 本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

2. 未评级债券为期限在一年以内的国债、政策银行债、央行票据及未有第三方机构评级的信用债。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人于开放期内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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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在基金运作过程中严格按照《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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品

种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家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的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%。

除附注“期末本基金持有的流通受限证券”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，其余均能以合理价格适时变现。在本基金开放日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于本期末，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%。

于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于本期末，本基金确认的净赎回申请未超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026年6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	470,583.16	-	-	-	470,583.16
结算备付金	62,377.29	-	-	-	62,377.29
存出保证金	4,760.47	-	-	-	4,760.47
交易性金融资产	1,919,935.42	-	-	34,530,429.00	36,450,364.42
应收申购款	-	-	-	4,978.39	4,978.39
资产总计	2,457,656.34	-	-	34,535,407.39	36,993,063.73
负债					
应付赎回款	-	-	-	10,009.06	10,009.06
应付管理人报酬	-	-	-	25,222.37	25,222.37
应付托管费	-	-	-	4,450.98	4,450.98
应交税费	-	-	-	70.22	70.22
其他负债	-	-	-	9,371.00	9,371.00
负债总计	-	-	-	49,123.63	49,123.63
利率敏感度缺口	2,457,656.34	-	-	34,486,283.76	36,943,940.10
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	675,894.17	-	-	-	675,894.17
结算备付金	57,663.37	-	-	-	57,663.37
存出保证金	1,367.05	-	-	-	1,367.05
交易性金融资产	1,921,194.63	-	-	34,138,427.81	36,059,622.44
应收申购款	-	-	-	55,270.91	55,270.91
资产总计	2,656,119.22	-	-	34,193,698.72	36,849,817.94
负债					
应付赎回款	-	-	-	123,027.21	123,027.21
应付管理人报酬	-	-	-	26,382.61	26,382.61
应付托管费	-	-	-	4,655.74	4,655.74
其他负债	-	-	-	6,709.28	6,709.28
负债总计	-	-	-	160,774.84	160,774.84
利率敏感度缺口	2,656,119.22	-	-	34,032,923.88	36,689,043.10

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金持有的固定收益品种投资公允价值占基金资产净值的比例为5.20%(上年度末：5.24%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他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。本基金持有的证券所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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6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	34,530,429.00	93.47	34,138,427.81	93.05
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
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	34,530,429.00	93.47	34,138,427.81	93.05

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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6月30日）	上年度末 （2025年12月31日 ）
	1.业绩比较基准上升5%	1,826,047.45	1,746,740.15

	2.业绩比较基准下降5%	-1,826,047.45	-1,746,740.15

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6月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	34,530,429.00	33,703,359.21
第二层次	1,919,935.42	2,356,263.23
第三层次	-	-
合计	36,450,364.42	36,059,622.44

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证券投资，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

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	34,530,429.00	93.34
	其中：股票	34,530,429.00	93.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,919,935.42	5.19
	其中：债券	1,919,935.42	5.19
	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	532,960.45	1.44
8	其他各项资产	9,738.86	0.03
9	合计	36,993,063.73	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	102,870.60	0.28
B	采矿业	1,696,186.00	4.59
C	制造业	24,292,853.68	65.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	941,200.00	2.55
E	建筑业	182,650.60	0.49
F	批发和零售业	25,308.00	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	505,445.00	1.37
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,782,629.15	4.83
J	金融业	2,688,247.00	7.28
K	房地产业	230,797.69	0.62
L	租赁和商务服务业	123,533.00	0.33

M	科学研究和技术服务业	648,946.12	1.76
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	42,505.96	0.12
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	33,263,172.80	90.04

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,185,757.00	3.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	60,120.00	0.16
G	交通运输、仓储和邮政业	19,684.00	0.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,695.20	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,267,256.20	3.43

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金未通过港股通交易机制投资港股。

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	2,540	3,225,800.00	8.73
2	300750	宁德时代	5,960	2,342,339.60	6.34
3	603986	兆易创新	2,000	1,630,000.00	4.41
4	600519	贵州茅台	1,177	1,395,321.73	3.78
5	300502	新易盛	2,100	1,274,700.00	3.45
6	688256	寒武纪	647	1,032,320.85	2.79
7	601899	紫金矿业	40,700	1,023,198.00	2.77
8	601318	中国平安	20,100	959,574.00	2.60
9	600900	长江电力	31,600	836,452.00	2.26
10	600036	招商银行	22,300	791,650.00	2.14
11	688008	澜起科技	2,500	774,750.00	2.10
12	688012	中微公司	1,443	676,045.50	1.83
13	603259	药明康德	5,212	648,946.12	1.76
14	300476	胜宏科技	1,800	623,574.00	1.69
15	000333	美的集团	8,200	619,346.00	1.68
16	002475	立讯精密	8,719	613,817.60	1.66
17	600150	中国船舶	16,500	557,535.00	1.51
18	002463	沪电股份	3,400	519,520.00	1.41
19	688041	海光信息	1,400	518,420.00	1.40
20	000651	格力电器	13,700	513,750.00	1.39
21	002371	北方华创	575	508,622.00	1.38
22	688981	中芯国际	3,000	476,460.00	1.29
23	601398	工商银行	67,100	474,397.00	1.28
24	300059	东方财富	22,700	462,626.00	1.25
25	300274	阳光电源	2,720	432,534.40	1.17
26	000725	京东方A	39,700	344,596.00	0.93
27	000338	潍柴动力	12,400	337,900.00	0.91
28	002230	科大讯飞	8,100	330,804.00	0.90
29	603799	华友钴业	6,706	323,631.56	0.88
30	002415	海康威视	9,025	308,655.00	0.84
31	600276	恒瑞医药	5,684	295,795.36	0.80
32	002028	思源电气	1,700	294,100.00	0.80
33	002001	新 和 成	10,200	289,884.00	0.78
34	000807	云铝股份	12,800	283,392.00	0.77
35	601816	京沪高铁	62,400	282,672.00	0.77
36	600196	复星医药	12,400	278,628.00	0.75
37	601100	恒立液压	2,500	268,900.00	0.73
38	600426	华鲁恒升	10,600	253,552.00	0.69
39	002594	比亚迪	3,100	247,070.00	0.67

40	600309	万华化学	3,600	246,276.00	0.67
41	601766	中国中车	44,280	230,256.00	0.62
42	000538	云南白药	4,700	222,639.00	0.60
43	300014	亿纬锂能	3,400	221,102.00	0.60
44	600660	福耀玻璃	4,200	211,848.00	0.57
45	603993	洛阳钼业	12,000	210,600.00	0.57
46	000792	盐湖股份	6,900	208,311.00	0.56
47	000425	徐工机械	23,800	192,542.00	0.52
48	600690	海尔智家	7,888	160,994.08	0.44
49	002466	天齐锂业	2,600	159,432.00	0.43
50	601088	中国神华	3,900	152,256.00	0.41
51	688111	金山办公	700	149,135.00	0.40
52	600048	保利发展	31,863	147,525.69	0.40
53	603019	中科曙光	1,300	139,399.00	0.38
54	300760	迈瑞医疗	1,000	135,830.00	0.37
55	000100	TCL科技	23,170	134,849.40	0.37
56	300124	汇川技术	2,000	132,660.00	0.36
57	600111	北方稀土	2,700	129,735.00	0.35
58	601857	中国石油	14,700	127,596.00	0.35
59	000063	中兴通讯	3,500	126,665.00	0.34
60	601888	中国中免	2,300	123,533.00	0.33
61	600089	特变电工	4,910	110,475.00	0.30
62	600031	三一重工	6,300	108,864.00	0.29
63	601985	中国核电	11,600	104,748.00	0.28
64	002714	牧原股份	2,940	102,870.60	0.28
65	002460	赣锋锂业	1,520	99,408.00	0.27
66	600406	国电南瑞	4,338	99,123.30	0.27
67	600019	宝钢股份	16,900	91,767.00	0.25
68	601668	中国建筑	20,940	90,879.60	0.25
69	600010	包钢股份	40,500	90,315.00	0.24
70	601919	中远海控	6,700	88,842.00	0.24
71	600941	中国移动	1,000	86,130.00	0.23
72	601728	中国电信	16,400	85,116.00	0.23
73	601012	隆基绿能	6,460	84,755.20	0.23
74	603501	豪威集团	885	83,942.25	0.23
75	600160	巨化股份	1,500	79,515.00	0.22
76	002352	顺丰控股	2,500	78,150.00	0.21
77	600489	中金黄金	4,300	77,615.00	0.21
78	601727	上海电气	9,500	66,500.00	0.18
79	002179	中航光电	1,400	64,680.00	0.18
80	601600	中国铝业	7,700	63,294.00	0.17
81	601225	陕西煤业	3,000	61,050.00	0.17
82	600893	航发动力	1,500	57,510.00	0.16

83	601006	大秦铁路	12,100	55,781.00	0.15
84	601127	赛力斯	900	55,125.00	0.15
85	600989	宝丰能源	2,600	52,858.00	0.14
86	002625	光启技术	1,700	51,544.00	0.14
87	688271	联影医疗	500	50,615.00	0.14
88	601390	中国中铁	11,300	47,121.00	0.13
89	002422	科伦药业	1,200	46,224.00	0.13
90	601669	中国电建	9,500	44,650.00	0.12
91	600585	海螺水泥	2,600	44,070.00	0.12
92	600547	山东黄金	1,900	43,871.00	0.12
93	300015	爱尔眼科	5,146	42,505.96	0.12
94	600760	中航沈飞	1,000	41,100.00	0.11
95	600438	通威股份	3,000	36,330.00	0.10
96	600895	张江高科	900	33,525.00	0.09
97	600436	片仔癀	300	32,784.00	0.09
98	001979	招商蛇口	4,100	26,363.00	0.07
99	000963	华东医药	900	25,308.00	0.07
100	000002	万科A	7,900	23,384.00	0.06

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	301536	星宸科技	2,900	373,259.00	1.01
2	603766	隆鑫通用	16,700	199,231.00	0.54
3	001309	德明利	100	94,290.00	0.26
4	688266	泽璟制药	800	93,328.00	0.25
5	688127	蓝特光学	900	87,840.00	0.24
6	300390	天华新能	900	84,159.00	0.23
7	301308	江波龙	100	70,380.00	0.19
8	603233	大参林	4,000	60,120.00	0.16
9	301377	鼎泰高科	100	55,090.00	0.15
10	600487	亨通光电	400	43,736.00	0.12
11	002653	海思科	600	39,804.00	0.11
12	300073	当升科技	800	38,432.00	0.10
13	600029	南方航空	3,800	19,684.00	0.05
14	600741	华域汽车	400	6,208.00	0.02
15	600570	恒生电子	80	1,695.20	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	300502	新易盛	1,153,092.58	3.14

2	300308	中际旭创	834,892.00	2.28
3	601318	中国平安	800,692.00	2.18
4	300476	胜宏科技	766,776.00	2.09
5	002463	沪电股份	762,292.00	2.08
6	600150	中国船舶	664,194.00	1.81
7	002028	思源电气	630,236.00	1.72
8	600048	保利发展	601,549.00	1.64
9	601668	中国建筑	594,570.00	1.62
10	600900	长江电力	558,543.00	1.52
11	300014	亿纬锂能	553,463.00	1.51
12	601816	京沪高铁	550,988.00	1.50
13	000100	TCL科技	549,383.00	1.50
14	002466	天齐锂业	532,668.00	1.45
15	002625	光启技术	525,568.00	1.43
16	300059	东方财富	514,838.00	1.40
17	600036	招商银行	500,190.00	1.36
18	002001	新 和 成	492,034.00	1.34
19	603799	华友钴业	490,001.40	1.34
20	600346	恒力石化	484,947.00	1.32

注：买入金额按买入成交金额（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	601318	中国平安	1,064,094.00	2.90
2	300308	中际旭创	913,779.00	2.49
3	002463	沪电股份	831,947.00	2.27
4	000100	TCL科技	807,421.00	2.20
5	300274	阳光电源	771,680.00	2.10
6	603259	药明康德	719,095.00	1.96
7	002475	立讯精密	713,166.00	1.94
8	600150	中国船舶	706,517.00	1.93
9	002028	思源电气	690,767.00	1.88
10	300750	宁德时代	668,204.00	1.82
11	002466	天齐锂业	633,051.00	1.73
12	601899	紫金矿业	627,467.00	1.71
13	601668	中国建筑	601,699.00	1.64
14	600019	宝钢股份	586,938.00	1.60
15	000333	美的集团	585,263.00	1.60
16	600031	三一重工	584,558.00	1.59
17	600989	宝丰能源	540,349.00	1.47
18	600036	招商银行	515,403.00	1.40
19	603501	豪威集团	513,989.00	1.40

20	603986	兆易创新	505,263.00	1.38

注：卖出金额按卖出成交金额（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	34,036,636.05
卖出股票收入（成交）总额	36,909,808.16

注：“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	1,919,935.42	5.20
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,919,935.42	5.20

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	019792	25国债19	19,000	1,919,935.42	5.20

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

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

根据基金合同，本基金不投资贵金属。

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

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

本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则参与股指期货交易，以提高投资管理效率，降低跟踪误差风险。

本基金参与股指期货交易，将采用流动性好、交易活跃的合约，以高效调整股票仓位。此外，在预期大额申购赎回、大额分红等情形发生时，本基金可以通过参与股指期货交易进行有效的现金头寸管理，同时达到有效跟踪标的指数的目的。

本基金参与股指期货交易，将严格遵循有关法律法规要求，遵循本基金管理人制定的相关投资决策流程和风险控制制度，事前将交易方案提交本基金管理人的股指期货投资决策小组审核通过，在股指期货投资决策小组核定的范围内进行。

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

根据基金合同，本基金不投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

根据基金合同，本基金不投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金本期投资的前十名证券中，无报告期内发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的证券。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同约定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	4,760.47
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,978.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,738.86

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

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

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
1,285	20,278.30	3,753.00	0.01	26,053,862.58	99.99

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,393.19	0.005347

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金转型后首个运作日（2020年03月27日）基金份额总额	78,056,830.69
本报告期期初基金份额总额	28,347,810.35
本报告期基金总申购份额	1,500,112.77
减：本报告期基金总赎回份额	3,790,307.54
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	26,057,615.58

注：2020年3月27日为基金转型后首个运作日。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未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

（一）基金管理人重大人事变动

本报告期内，本基金基金管理人无重大人事变动。

（二）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内未发生基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

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

本报告期内，基金管理人没有受到调查或处罚的情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员没有受到调查或处罚的情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及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

本报告期内，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及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(%)	
光大证券	2	26,299,029.06	37.07	5,260.15	37.07	-
国联民生	1	23,123,394.65	32.59	4,624.73	32.59	-
瑞银证券	1	9,489,872.00	13.38	1,898.01	13.38	-
国泰海通	2	5,320,749.70	7.50	1,064.16	7.50	-

中金公司	1	4,608,579.80	6.50	921.75	6.50	-
兴业证券	1	2,104,819.00	2.97	420.98	2.97	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	3	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：1、管理人对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其他相关因素后决定的。报告期内，本基金交易单元无变更。

2、上表列示交易单元数量为截至本报告期末本基金租用数量，成交金额及佣金为本报告期间数。

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(%)
光大证券	-	-	-	-	-	-
国联民生	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	2,103,812.00	100.00	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

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	富兰克林国海中证 A100 指数增强型证券投资基金（LOF）2025 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及规定网站	2026 年 1 月 22 日
2	国海富兰克林基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2026 年 1 月 22 日
3	富兰克林国海中证 A100 指数增强型证券投资基金（LOF）2025 年年度报告	中国证监会规定报刊及规定网站	2026 年 3 月 31 日
4	国海富兰克林基金管理有限公司旗下全部基金年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2026 年 3 月 31 日
5	国海富兰克林基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	中国证监会规定报刊及规定网站	2026 年 3 月 31 日
6	富兰克林国海中证 A100 指数增强型证券投资基金（LOF）2026 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及规定网站	2026 年 4 月 22 日
7	国海富兰克林基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2026 年 4 月 22 日
8	富兰克林国海中证 A100 指数增强型证券投资基金(LOF)溢价风险提示公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2026 年 4 月 23 日
9	国海富兰克林基金管理有限公司对外行使表决权（2025 年度）情况信息披	中国证监会规定报刊及规定网站	2026 年 4 月 30 日

	露		
10	国海富兰克林基金管理有限公司关于旗下公募基金产品开展直销中心认购、申购（含定投）、转换费率优惠的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2026 年 5 月 30 日
11	关于增加深圳腾元基金销售有限公司为国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金代销机构并开通转换业务、定期定额投资业务及相关费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2026 年 6 月 6 日
12	富兰克林国海中证 A100 指数增强型证券投资基金(LOF)更新招募说明书（2026 年 1 号）	中国证监会规定报刊及规定网站	2026 年 6 月 30 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（%）
个人	1	20260101-20260630	13,735,347.99	-	-	13,735,347.99	52.71
产品特有风险							
1.流动性风险 投资者大额赎回所持有的基金份额时，为了实现基金资产的迅速变现，在基金交易过程中可能存在无法实现交易价格最优；亦或导致基金仓位调整困难，基金资产不能迅速转变成现金，产生流动性风险。 一旦引发巨额赎回，当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难，或认为兑付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金资产净值发生较大波动时，可能出现比例赎回、延期支付赎回款等情形。 管理人有权根据本基金合同和招募说明书的约定，基于投资者保护原则，暂停或拒绝申购、暂停赎回。 2.估值风险 投资者大额赎回所持有的基金份额时，基金份额净值可能受到尾差和部分赎回费归入基金资产的影响，从而导致非市场因素的净值异常波动。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

基金资产可投资于科创板股票和北京证券交易所股票，会面临科创板和北京证券交易所机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于公司治理风险、流动性风险、退市风险、股价波动风险、中小企业经营风险、投资集中风险、系统性风险、政策风险等。基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板股

票、北京证券交易所股票或选择不将基金资产投资于科创板股票、北京证券交易所股票，基金资产并非必然投资于科创板股票、北京证券交易所股票。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会批准富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金设立的文件（因标的指数名称变更，自2024年10月28日起，基金名称变更为富兰克林国海中证A100指数增强型证券投资基金（LOF））；

2、《富兰克林国海中证A100指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同》；

3、《富兰克林国海中证A100指数增强型证券投资基金(LOF)招募说明书》；

4、《富兰克林国海中证A100指数增强型证券投资基金(LOF)托管协议》；

5、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所并登载于基金管理人网站:www.ftsfund.com。

12.3 查阅方式

1、投资者在基金开放日内至基金管理人或基金托管人住所免费查阅，并可按工本费购买复印件。

2、登陆基金管理人网站www.ftsfund.com查阅。

国海富兰克林基金管理有限公司

2026年8月31日