

富国沪深 300 增强证券投资基金

二〇二五年中期报告

2025 年 06 月 30 日

基金管理人： 富国基金管理有限公司

基金托管人： 中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	6
2.1	基金基本情况	6
2.2	基金产品说明	6
2.3	基金管理人和基金托管人	6
2.4	信息披露方式	7
2.5	其他相关资料	7
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	8
3.1	主要会计数据和财务指标	8
3.2	基金净值表现	9
§ 4	管理人报告	14
4.1	基金管理人及基金经理情况	14
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	16
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	16
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	17
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	18
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
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	19
§ 5	托管人报告	20
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	20
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	20
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	20
§ 6	中期财务报告（未经审计）	21
6.1	资产负债表	21
6.2	利润表	22
6.3	净资产变动表	23
6.4	报表附注	25
§ 7	投资组合报告	53

7.1	期末基金资产组合情况.....	53
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	53
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.....	54
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	69
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	71
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.....	71
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..	72
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..	72
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.....	72
7.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	72
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	72
7.12	投资组合报告附注.....	72
§ 8	基金份额持有人信息	75
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	75
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	75
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的情况.....	75
§ 9	开放式基金份额变动	76
§ 10	重大事件揭示.....	77
10.1	基金份额持有人大会决议.....	77
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.....	77
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	77
10.4	基金投资策略的改变.....	77
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	77
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.....	77
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	77
10.8	其他重大事件.....	81
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息.....	82
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	82
11.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	82
§ 12	备查文件目录.....	83

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国沪深 300 增强证券投资基金		
基金简称	富国沪深 300 指数增强		
基金主代码	100038		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2009 年 12 月 16 日		
基金管理人	富国基金管理有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	4,929,543,475.75 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	富国沪深 300 指数增强 A/B	富国沪深 300 指数增强 C	富国沪深 300 指数增强 Y
下属分级基金的交易代码	前端	后端	013291
	100038	000154	
报告期末下属分级基金的份额总额	3,538,085,444.28 份	1,374,943,364.04 份	16,514,667.43 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，在力求对沪深 300 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金以“指数化投资为主、主动性投资为辅”，主要策略为复制目标指数，即投资组合将以成份股在目标指数中的基准权重为基础，利用富国定量投资模型在有限范围内进行超配或低配选择。在复制目标指数的基础上本基金一定程度地调整个股，力求投资收益能够跟踪并适度超越目标指数。本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。本基金的标的指数、对目标指数的跟踪调整、存托凭证、债券、金融衍生工具投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	95%×沪深 300 指数收益率+1.5%（指年收益率，评价时按期间折算）
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富国基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	郭明

	联系电话	021-20361818	010—66105799
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105686、4008880688	95588
传真		021-20361616	010—66105798
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		裴长江	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告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 中国工商银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街55号

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	富国基金管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

(1) 富国沪深 300 指数增强 A/B

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025年01月01日至2025年06月30日)
本期已实现收益	176,639,567.39
本期利润	128,061,785.86
加权平均基金份额本期利润	0.0305
本期加权平均净值利润率	1.97%
本期基金份额净值增长率	2.48%
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	2,158,652,191.14
期末可供分配基金份额利润	0.6101
期末基金资产净值	5,696,737,635.42
期末基金份额净值	1.610
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	128.67%

(2) 富国沪深 300 指数增强 C

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025年01月01日至2025年06月30日)
本期已实现收益	61,681,422.35
本期利润	47,106,382.53
加权平均基金份额本期利润	0.0322
本期加权平均净值利润率	2.09%
本期基金份额净值增长率	2.37%
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	822,120,736.36
期末可供分配基金份额利润	0.5979
期末基金资产净值	2,197,064,100.40
期末基金份额净值	1.598
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	-13.55%

(3) 富国沪深 300 指数增强 Y

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025年01月01日至2025年06月30日)
本期已实现收益	620,475.62
本期利润	1,145,279.53
加权平均基金份额本期利润	0.0874
本期加权平均净值利润率	5.61%
本期基金份额净值增长率	2.80%
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	10,168,610.06
期末可供分配基金份额利润	0.6157
期末基金资产净值	26,683,277.49
期末基金份额净值	1.616
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	3.13%

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

(1) 富国沪深300指数增强 A/B

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.07%	0.51%	2.50%	0.55%	0.57%	-0.04%
过去三个月	3.27%	1.07%	1.59%	1.04%	1.68%	0.03%
过去六个月	2.48%	0.96%	0.81%	0.97%	1.67%	-0.01%
过去一年	12.90%	1.25%	14.81%	1.32%	-1.91%	-0.07%
过去三年	-6.61%	0.99%	-7.40%	1.05%	0.79%	-0.06%
自基金合同生效起至今	128.67%	1.30%	40.42%	1.31%	88.25%	-0.01%

(2) 富国沪深300指数增强 C

阶段	份额净	份额净	业绩比	业绩比较	①—③	②—④
----	-----	-----	-----	------	-----	-----

	值增长率①	值增长率标准差②	较基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去一个月	3.10%	0.52%	2.50%	0.55%	0.60%	-0.03%
过去三个月	3.23%	1.06%	1.59%	1.04%	1.64%	0.02%
过去六个月	2.37%	0.96%	0.81%	0.97%	1.56%	-0.01%
过去一年	12.69%	1.24%	14.81%	1.32%	-2.12%	-0.08%
过去三年	-7.15%	0.99%	-7.40%	1.05%	0.25%	-0.06%
自基金分级生效日起至今	-13.55%	1.03%	-13.52%	1.07%	-0.03%	-0.04%

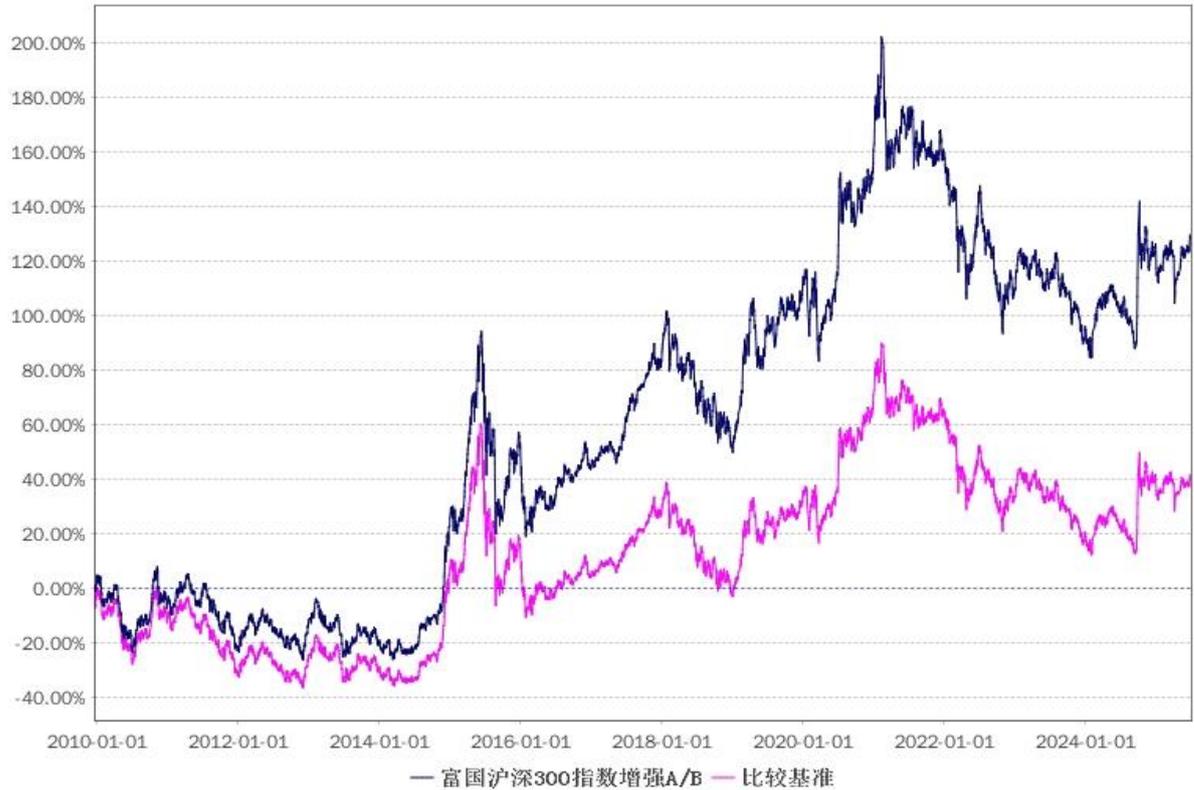
(3) 富国沪深 300 指数增强 Y

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.13%	0.51%	2.50%	0.55%	0.63%	-0.04%
过去三个月	3.46%	1.07%	1.59%	1.04%	1.87%	0.03%
过去六个月	2.80%	0.96%	0.81%	0.97%	1.99%	-0.01%
自基金分级生效日起至今	3.13%	0.93%	0.92%	0.94%	2.21%	-0.01%

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

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

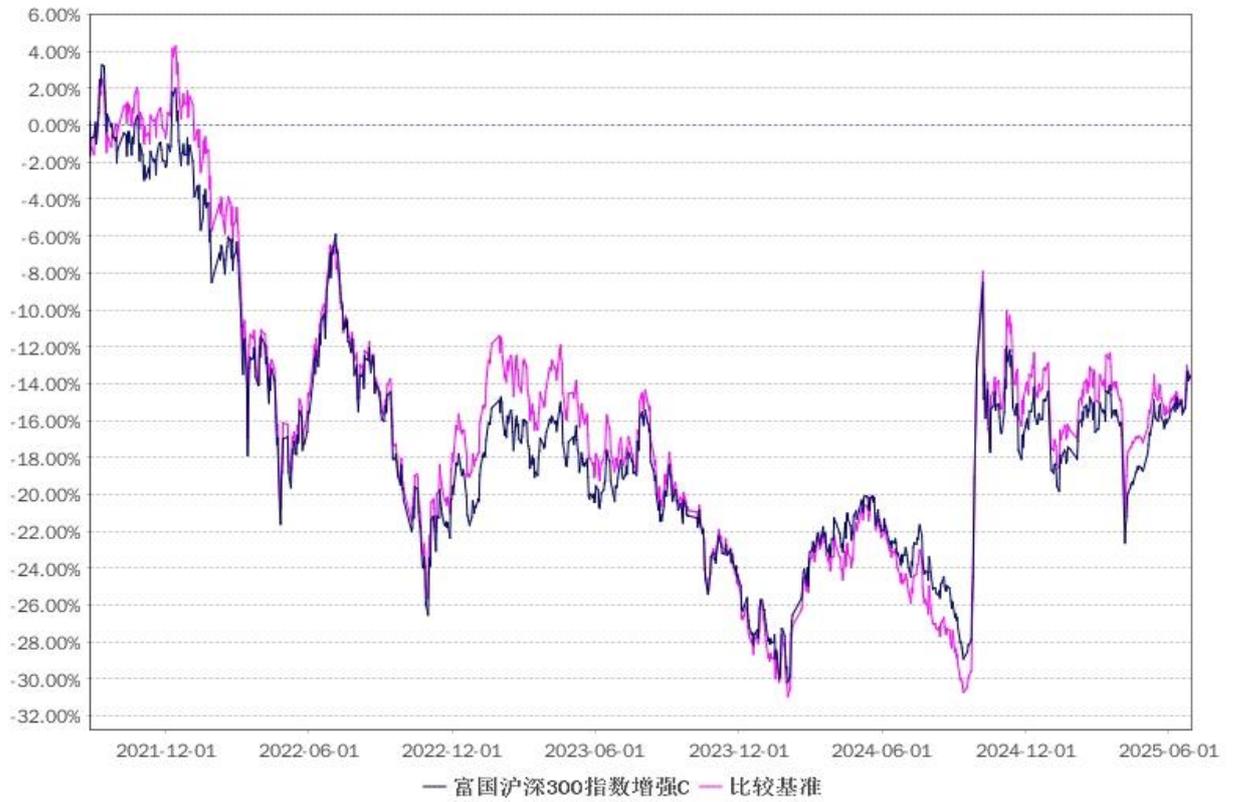
(1) 自基金合同生效以来富国沪深 300 指数增强 A/B 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2025 年 6 月 30 日。

2、本基金于 2009 年 12 月 16 日成立，建仓期 6 个月，从 2009 年 12 月 16 日起至 2010 年 6 月 15 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

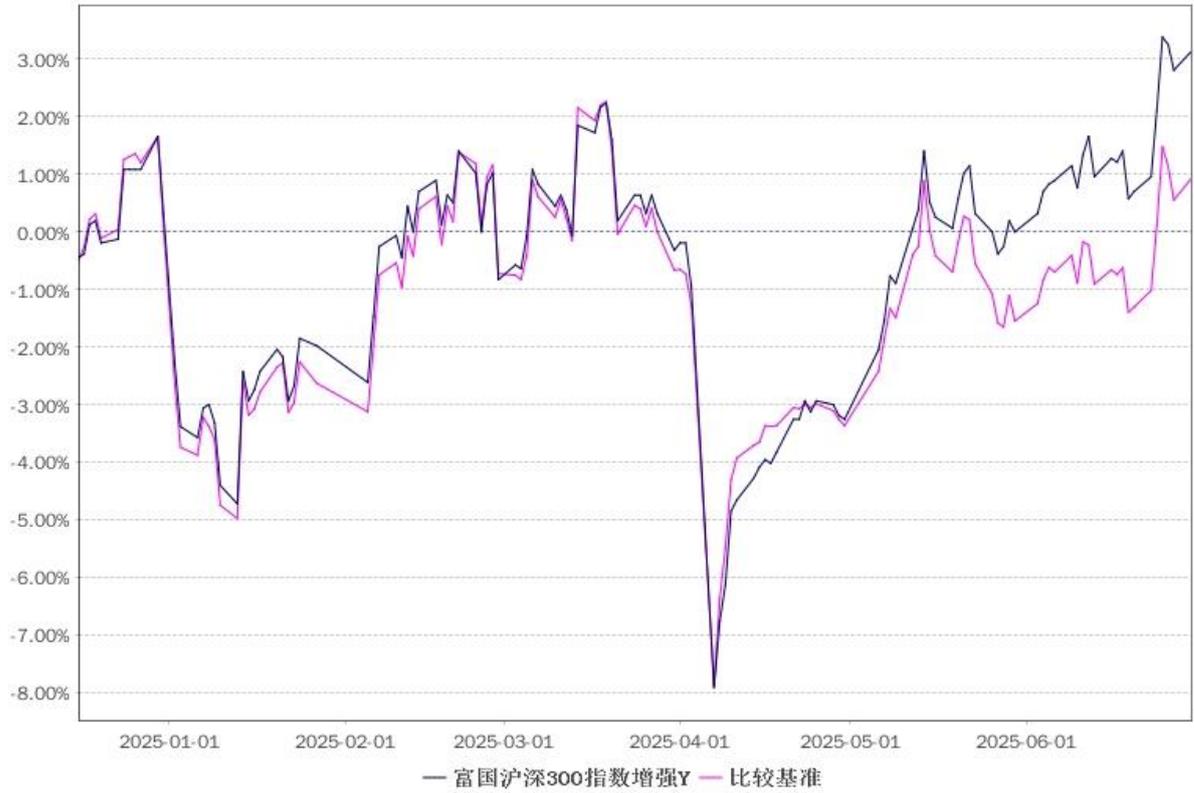
(2) 自基金合同生效以来富国沪深 300 指数增强 C 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2025 年 6 月 30 日。

2、本基金自 2021 年 8 月 24 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沪深 300 指数增强 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		
李笑薇	本基金现任基金经理	2009-12-23	—	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、上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据《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沪深 300 指数增强 A/B 为 1.61 元,富国沪深 300 指数增强 C 为 1.598 元,富国沪深 300 指数增强 Y 为 1.616 元;份额累计净值富国沪深 300 指数增强 A/B 为 2.196 元,富国沪深 300 指数增强 C 为 1.828 元,富国沪深 300 指数增强 Y 为 1.616 元;本报告期,本基金份额净值增长率情况:富国沪深 300 指数增强 A/B 为 2.48%,富国沪深 300 指数增强 C 为 2.37%,富国沪深 300 指数增强 Y 为 2.80%;同期业绩比较基准收益率情况:富国沪深 300 指数增强 A/B 为 0.81%,富国沪深 300 指数增强 C 为 0.81%,富国沪深 300 指数增强 Y 为 0.81%。

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将缓解,着眼未来,在减少资本开支的大背景下,上游周期和中游制造产能过剩情况均有望持续好转,企业盈利有望逐步改善。与此同时,在中美谈判持续推进和国内外 AI 模型持续发展的背景下,科技也有望进一步打开估值空间。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——富国基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对富国基金管理有限公司编制和披露的本基金 2025 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 中期财务报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：富国沪深 300 增强证券投资基金

报告截止日：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	490,699,203.68	656,765,914.38
结算备付金	21,454,048.71	30,831,161.84
存出保证金	1,392,526.28	2,149,093.94
交易性金融资产	7,508,385,257.23	9,486,685,877.65
其中：股票投资	7,508,074,566.02	9,486,685,877.65
基金投资	—	—
债券投资	310,691.21	—
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	4,338,659.66
应收股利	—	—
应收申购款	2,222,374.66	10,440,049.37
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	8,024,184,835.89	10,191,210,756.84
负债和净资产	本期末	上年度末
	2025 年 06 月 30 日	2024 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付清算款	—	2,994,698.86
应付赎回款	92,757,109.96	42,312,513.24
应付管理人报酬	6,486,264.78	8,822,868.14
应付托管费	1,167,527.70	1,588,116.23
应付销售服务费	361,315.06	429,499.01
应付投资顾问费	—	—
应交税费	0.67	—
应付利润	—	—

递延所得税负债	—	—
其他负债	2,927,604.41	4,809,870.15
负债合计	103,699,822.58	60,957,565.63
净资产：		
实收基金	4,929,543,475.75	6,458,819,658.84
其他综合收益	—	—
未分配利润	2,990,941,537.56	3,671,433,532.37
净资产合计	7,920,485,013.31	10,130,253,191.21
负债和净资产总计	8,024,184,835.89	10,191,210,756.84

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.607 元，基金份额总额 4,929,543,475.75 份。其中：富国沪深 300 指数增强 A/B 份额净值 1.610 元，份额总额 3,538,085,444.28 份；富国沪深 300 指数增强 C 份额净值 1.598 元，份额总额 1,374,943,364.04 份；富国沪深 300 指数增强 Y 份额净值 1.616 元，份额总额 16,514,667.43 份。

6.2 利润表

会计主体：富国沪深 300 增强证券投资基金

本报告期：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	230,476,090.50	516,686,311.56
1. 利息收入	1,032,811.56	1,920,735.42
其中：存款利息收入	1,032,811.56	1,920,735.42
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）	288,537,981.13	-65,401,147.20
其中：股票投资收益	175,065,288.26	-205,096,997.55
基金投资收益	—	—
债券投资收益	230,911.85	248.04
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	113,241,781.02	139,695,602.31
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）	-62,628,017.44	577,967,070.12
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	3,533,315.25	2,199,653.22
减：二、营业总支出	54,162,642.58	70,144,028.71
1. 管理人报酬	43,625,539.01	56,298,256.34
2. 托管费	7,852,597.02	10,133,686.06
3. 销售服务费	2,239,667.64	2,705,265.93
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	0.66	0.12
8. 其他费用	444,838.25	1,006,820.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	176,313,447.92	446,542,282.85
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	176,313,447.92	446,542,282.85
五、其他综合收益的税后净额	—	—
六、综合收益总额	176,313,447.92	446,542,282.85

6.3 净资产变动表

会计主体：富国沪深300增强证券投资基金

本报告期：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	6,458,819,658.84	3,671,433,532.37	10,130,253,191.21
二、本期期初净资产	6,458,819,658.84	3,671,433,532.37	10,130,253,191.21
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,529,276,183.09	680,491,994.81	2,209,768,177.90
（一）、综合收益总额	—	176,313,447.92	176,313,447.92
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	—	—	—
其中：1. 基金申购款	1,529,276,183.09	856,805,442.73	2,386,081,625.82
	1,120,960,804	619,455,159.9	1,740,415,964

	.81	7	.78
2. 基金赎回款	2,650,236,987.90	1,476,260,602.70	4,126,497,590.60
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	—	—	—
(四)、其他综合收益结转留存收益	—	—	—
四、本期期末净资产	4,929,543,475.75	2,990,941,537.56	7,920,485,013.31
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	6,833,236,853.91	2,579,835,801.11	9,413,072,655.02
二、本期期初净资产	6,833,236,853.91	2,579,835,801.11	9,413,072,655.02
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,206,801,680.76	827,837,079.18	2,034,638,759.94
(一)、综合收益总额	—	446,542,282.85	446,542,282.85
(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)	1,206,801,680.76	381,294,796.33	1,588,096,477.09
其中：1. 基金申购款	3,869,910,992.40	1,493,462,463.51	5,363,373,455.91
2. 基金赎回款	2,663,109,311.64	1,112,167,667.18	3,775,276,978.82
(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	8,040,038,534.67	3,407,672,880.29	11,447,711,414.96

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

陈戈

林志松

徐慧

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

富国沪深 300 增强证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2009]1106 号文《关于同意富国沪深 300 增强证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人富国基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2009 年 12 月 16 日正式生效，首次设立募集规模为 3,489,909,303.02 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。根据基金管理人于 2021 年 8 月 17 日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下部分基金增加 C 类基金份额并相应修订基金合同及托管协议的公告》，自 2021 年 8 月 24 日起，本基金增加 C 类份额。根据基金管理人于 2024 年 12 月 12 日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下部分基金增加 Y 类基金份额并修改基金合同及托管协议的公告》，自 2024 年 12 月 13 日起，本基金增加 Y 类份额。本基金的基金管理人和注册登记机构为富国基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、存托凭证、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产的 90%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的资产不低于股票及存托凭证资产的 80%；保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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

本基金业绩比较基准为： $95\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 1.5\%$ （指年收益率，评价时按期间折算）。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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	490,699,203.68
等于：本金	490,649,572.96
加：应计利息	49,630.72
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	490,699,203.68

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	7,175,999,80 0.22	—	7,508,074,56 6.02	332,074,765. 80	
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—	
债券	交易所市场	135,700.00	19.63	310,691.21	174,971.58
	银行间市场	—	—	—	—
	合计	135,700.00	19.63	310,691.21	174,971.58
资产支持证券	—	—	—	—	
基金	—	—	—	—	
其他	—	—	—	—	
合计	7,176,135,50 0.22	19.63	7,508,385,25 7.23	332,249,737. 38	

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	104,193.95
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	2,315,308.52
其中：交易所市场	2,315,308.52
银行间市场	—
应付利息	—
预提信息披露费	60,000.00
预提审计费	112,671.58
应付指数使用费	335,430.36
合计	2,927,604.41

6.4.7.7 实收基金

富国沪深300指数增强A/B:

金额单位：人民币元

项目	本期（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	4,833,758,482.14	4,833,758,482.14
本期申购	457,434,690.45	457,434,690.45
本期赎回（以“-”号填列）	-1,753,107,728.31	-1,753,107,728.31
本期末	3,538,085,444.28	3,538,085,444.28

富国沪深300指数增强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	1,620,307,760.20	1,620,307,760.20
本期申购	649,991,352.42	649,991,352.42
本期赎回（以“-”号填列）	-895,355,748.58	-895,355,748.58
本期末	1,374,943,364.04	1,374,943,364.04

富国沪深300指数增强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	4,753,416.50	4,753,416.50
本期申购	13,534,761.94	13,534,761.94

本期赎回（以“-”号填列）	-1,773,511.01	-1,773,511.01
本期末	16,514,667.43	16,514,667.43

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

富国沪深 300 指数增强 A/B:

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,603,254,882.10	- 2,843,024,514.69	2,760,230,367.41
本期期初	5,603,254,882.10	- 2,843,024,514.69	2,760,230,367.41
本期利润	176,639,567.39	- 48,577,781.53	128,061,785.86
本期基金份额交易产生的变动数	- 1,531,724,693.62	802,084,731.49	-729,639,962.13
其中：基金申购款	538,689,381.55	- 286,094,802.14	252,594,579.41
基金赎回款	- 2,070,414,075.17	1,088,179,533.63	-982,234,541.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,248,169,755.87	- 2,089,517,564.73	2,158,652,191.14

富国沪深 300 指数增强 C:

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,861,618,124.96	- 953,132,317.31	908,485,807.65
本期期初	1,861,618,124.96	- 953,132,317.31	908,485,807.65
本期利润	61,681,422.35	- 14,575,039.82	47,106,382.53
本期基金份额交易产生的	-	155,565,140	-133,471,453.82

变动数	289,036,594 .78	.96	
其中：基金申购款	758,417,373 .03	398,871,274 .98	359,546,098.05
基金赎回款	1,047,453,9 67.81	554,436,415 .94	-493,017,551.87
本期已分配利润	—	—	—
本期末	1,634,262,9 52.53	812,142,216 .17	822,120,736.36

富国沪深 300 指数增强 Y:

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,513,161.5 0	2,795,804.1 9	2,717,357.31
本期期初	5,513,161.5 0	2,795,804.1 9	2,717,357.31
本期利润	620,475.62	524,803.91	1,145,279.53
本期基金份额交易产生的 变动数	13,787,628. 15	7,481,654.9 3	6,305,973.22
其中：基金申购款	15,887,598. 10	8,573,115.5 9	7,314,482.51
基金赎回款	2,099,969.9 5	1,091,460.6 6	-1,008,509.29
本期已分配利润	—	—	—
本期末	19,921,265. 27	9,752,655.2 1	10,168,610.06

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	943,586.29
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	43,747.48
其他	45,477.79
合计	1,032,811.56

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	21,247,990,186.95
减：卖出股票成本总额	21,054,223,365.00
减：交易费用	18,701,533.69
买卖股票差价收入	175,065,288.26

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	36,830.26
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	194,081.59
合计	230,911.85

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	46,080,198.32
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	45,629,650.00
减：应计利息总额	256,411.96
减：交易费用	54.77
买卖债券差价收入	194,081.59

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	113,241,781.02
其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	—
合计	113,241,781.02

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2025年01月01日至2025年06月30日）
1. 交易性金融资产	-62,628,017.44
股票投资	-62,802,989.02
债券投资	174,971.58
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	-62,628,017.44

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	2,741,227.17
基金转换费收入	792,088.08

合计	3,533,315.25
----	--------------

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	39,671.58
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	622.46
债券账户维护费	9,000.00
指数使用费	335,430.36
其他	113.85
合计	444,838.25

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
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
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
富国鑫旺均衡养老目标三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	1,505,998,964.89	3.73	—	—
海通证券	1,778,526,550.67	4.40	1,954,644,471.23	7.16
申万宏源	1,874,422,407.42	4.64	245,834,859.80	0.90

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	204,666.63	3.73	87,407.57	3.78
海通证券	241,722.49	4.40	—	—
申万宏源	254,730.73	4.64	169,215.65	7.31
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	1,438,366.34	7.78	1,438,366.34	14.92
申万宏源	180,909.39	0.98	—	—

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	43,625,539.01	56,298,256.34
其中：应支付销售机构的客户维护费	9,768,122.13	8,813,830.10
应支付基金管理人的净管理费	33,857,416.88	47,484,426.24

注：本基金A类和C类基金份额的管理费按前一日该类基金份额基金资产净值的

1.0%年费率计提，本基金 Y 类基金份额的管理费按前一日 Y 类基金份额基金资产净值的 0.50%的年费率计提。

管理费的计算方法如下：

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

H 为该类基金份额每日应计提的基金管理费

E 为前一日的该类基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（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	7,852,597.02	10,133,686.06

注：本基金 A 类和 C 类基金份额的托管费按前一日该类基金份额基金资产净值的 0.18%的年费率计提，本基金 Y 类基金份额的托管费按前一日 Y 类基金份额基金资产净值的 0.09%的年费率计提。

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

H 为该类基金份额每日应计提的基金托管费

E 为前一日的该类基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期（2025年01月01日至2025年06月30日）			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	富国沪深300指数增强 A/B	富国沪深300指数增强 C	富国沪深300指数增强 Y	合计
富国基金管理有限公司	—	1,587,644.21	—	1,587,644.21
国泰海通证券股份有限公司	—	814.95	—	814.95
海通证券股份有限公司	—	560.39	—	560.39

司				
申万宏源证券有限公司	—	9.61	—	9.61
中国工商银行股份有限公司	—	156,690.21	—	156,690.21
合计	—	1,745,719.37	—	1,745,719.37

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			
	富国沪深300指数增强A/B	富国沪深300指数增强C	富国沪深300指数增强Y	合计
富国基金管理有限公司	—	1,984,535.72	—	1,984,535.72
海通证券股份有限公司	—	109.61	—	109.61
中国工商银行股份有限公司	—	2,327.88	—	2,327.88
合计	—	1,986,973.21	—	1,986,973.21

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0.2%年费率计提。销售服务费计算方法如下：

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

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

C类基金份额的销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适

用固定期限费率从事证券出借业务。

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自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）		
	富国沪深300指数增强A/B	富国沪深300指数增强C	富国沪深300指数增强Y	富国沪深300指数增强A/B	富国沪深300指数增强C	富国沪深300指数增强Y
基金合同生效日（2009年12月16日）持有的基金份额	20,002,200.00	—	—	20,002,200.00	—	—
期初持有的基金份额	—	—	—	—	—	—
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	—	—	—	—	—	—
期末持有的基金份额占基金总份额比例	—	—	—	—	—	—

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

富国沪深 300 指数增强 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)	—	—	5,617,013.64	0.35
富国鑫旺均衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)	4,448,216.00	0.32	4,372,192.79	0.27

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
中国工商银行股份有限公司	490,699,203.68	943,586.29	862,597,046.57	1,630,684.29

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（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	310,691.21	—
未评级	—	—
合计	310,691.21	—

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	490,699,203.68	—	—	—	—	—	490,699,203.68
结算备付金	21,454,048.71	—	—	—	—	—	21,454,048.71
存出保证金	1,392,526.28	—	—	—	—	—	1,392,526.28
交易性金融资产	—	—	310,691.21	—	—	7,508,074,566.02	7,508,385,257.23
应收清算款	—	—	—	—	—	31,425.33	31,425.33
应收申购款	—	—	—	—	—	2,222,374.66	2,222,374.66
资产总计	513,545,778.67	—	310,691.21	—	—	7,510,328,366.01	8,024,184,835.89
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	92,757,109.96	92,757,109.96
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	6,486,264.78	6,486,264.78
应付托管费	—	—	—	—	—	1,167,527.70	1,167,527.70
应付销售服务费	—	—	—	—	—	361,315.06	361,315.06
应交税费	—	—	—	—	—	0.67	0.67
其他负债	—	—	—	—	—	2,927,604.41	2,927,604.41
负债总计	—	—	—	—	—	103,699,822.58	103,699,822.58
利率敏感度缺口	513,545,778.67	—	310,691.21	—	—	7,406,628,543.43	7,920,485,013.31
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	656,765,914.38	—	—	—	—	—	656,765,914.38
结算备付金	30,831,161.84	—	—	—	—	—	30,831,161.84
存出保证金	2,149,093.94	—	—	—	—	—	2,149,093.94
交易性金融资产	—	—	—	—	—	9,486,685,877.65	9,486,685,877.65
应收清算款	—	—	—	—	—	4,338,659.66	4,338,659.66
应收申购款	—	—	—	—	—	10,440,049.37	10,440,049.37
资产总计	689,746,170.16	—	—	—	—	9,501,464,586.68	10,191,210,756.84
负债							
应付清算款	—	—	—	—	—	2,994,698.86	2,994,698.86
应付赎回款	—	—	—	—	—	42,312,513.24	42,312,513.24
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	8,822,868.14	8,822,868.14
应付托管费	—	—	—	—	—	1,588,116.23	1,588,116.23
应付销售服务费	—	—	—	—	—	429,499.01	429,499.01
其他负债	—	—	—	—	—	4,809,870.15	4,809,870.15
负债总计	—	—	—	—	—	60,957,565.63	60,957,565.63
利率敏感度缺口	689,746,170.16	—	—	—	—	9,440,507,021.05	10,130,253,191.21

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、存托凭证、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产的90%，投资于沪深300指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的资产不低于股票及存托凭证资产的80%；保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末 (2025年06月30日)		上年度末 (2024年12月31日)	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	7,508,074,566.02	94.79	9,486,685,877.65	93.65
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	310,691.21	0.00	—	—
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	7,508,385,257.23	94.80	9,486,685,877.65	93.65
----	------------------	-------	------------------	-------

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		对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位:人民币元)	
	相关风险变量的变动	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%	77,715,612.26	93,580,327.57
	2. 业绩比较基准减少1%	-77,715,612.26	-93,580,327.57

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	7,507,973,606.08	9,458,687,260.65
第二层次	—	27,553,255.86
第三层次	411,651.15	445,361.14
合计	7,508,385,257.23	9,486,685,877.65

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	7,508,074,566.02	93.57
	其中：股票	7,508,074,566.02	93.57
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	310,691.21	0.00
	其中：债券	310,691.21	0.00
	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	512,153,252.39	6.38
8	其他各项资产	3,646,326.27	0.05
9	合计	8,024,184,835.89	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	38,585,018.00	0.49
B	采矿业	367,419,420.14	4.64
C	制造业	2,274,480,240.09	28.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	225,870,754.08	2.85
E	建筑业	183,178,897.06	2.31
F	批发和零售业	11,002,136.00	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	379,357,605.93	4.79
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	291,049,444.97	3.67
J	金融业	2,200,303,132.46	27.78
K	房地产业	4,987,334.70	0.06

L	租赁和商务服务业	27,388,313.70	0.35
M	科学研究和技术服务业	45,757,431.85	0.58
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	15,137,216.64	0.19
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	6,064,516,945.62	76.57

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	378,102.00	0.00
B	采矿业	53,296,705.56	0.67
C	制造业	851,660,161.42	10.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	47,277,525.00	0.60
E	建筑业	4,615,526.00	0.06
F	批发和零售业	22,518,824.00	0.28
G	交通运输、仓储和邮政业	51,375,211.00	0.65
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	166,848,791.42	2.11
J	金融业	140,460,455.90	1.77
K	房地产业	1,605,264.00	0.02
L	租赁和商务服务业	38,206,576.50	0.48
M	科学研究和技术服务业	23,475,901.96	0.30
N	水利、环境和公共设施管理业	15,805,731.14	0.20
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	4,605,048.00	0.06
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	21,427,796.50	0.27
S	综合	—	—
	合计	1,443,557,620.40	18.23

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	601318	中国平安	2,186,599	121,312,512.52	1.53
2	600519	贵州茅台	77,876	109,767,779.52	1.39
3	600919	江苏银行	9,001,273	107,475,199.62	1.36

4	300750	宁德时代	424,467	107,059,066.74	1.35
5	002736	国信证券	8,795,553	101,324,770.56	1.28
6	600900	长江电力	3,202,975	96,537,666.50	1.22
7	600036	招商银行	2,043,014	93,876,493.30	1.19
8	600926	杭州银行	5,456,280	91,774,629.60	1.16
9	601857	中国石油	9,807,900	83,857,545.00	1.06
10	601288	农业银行	13,798,068	81,132,639.84	1.02
11	600016	民生银行	16,696,019	79,306,090.25	1.00
12	601166	兴业银行	3,392,500	79,180,950.00	1.00
13	601688	华泰证券	4,418,701	78,697,064.81	0.99
14	002230	科大讯飞	1,577,713	75,540,898.44	0.95
15	601169	北京银行	10,830,776	73,974,200.08	0.93
16	000776	广发证券	4,336,046	72,888,933.26	0.92
17	002352	顺丰控股	1,476,275	71,983,169.00	0.91
18	601818	光大银行	17,141,800	71,138,470.00	0.90
19	600276	恒瑞医药	1,366,880	70,941,072.00	0.90
20	600000	浦发银行	5,032,060	69,844,992.80	0.88
21	000725	京东方A	17,011,321	67,875,170.79	0.86
22	601899	紫金矿业	3,343,762	65,203,359.00	0.82
23	601998	中信银行	7,659,000	65,101,500.00	0.82
24	000063	中兴通讯	1,992,440	64,734,375.60	0.82
25	601009	南京银行	5,503,509	63,950,774.58	0.81
26	600482	中国动力	2,688,258	62,018,112.06	0.78
27	601658	邮储银行	11,286,176	61,735,382.72	0.78
28	603993	洛阳钼业	7,123,700	59,981,554.00	0.76
29	000001	平安银行	4,941,927	59,649,058.89	0.75
30	601838	成都银行	2,913,320	58,557,732.00	0.74
31	601668	中国建筑	9,913,000	57,198,010.00	0.72
32	601989	中国重工	12,322,226	57,175,128.64	0.72
33	600015	华夏银行	7,107,058	56,216,828.78	0.71
34	002001	新和成	2,626,896	55,874,077.92	0.71
35	601916	浙商银行	16,418,160	55,657,562.40	0.70
36	600741	华域汽车	3,145,816	55,523,652.40	0.70
37	601939	建设银行	5,774,907	54,515,122.08	0.69
38	002142	宁波银行	1,955,902	53,513,478.72	0.68
39	600660	福耀玻璃	921,443	52,531,465.43	0.66
40	601919	中远海控	3,448,909	51,871,591.36	0.65
41	000100	TCL科技	11,863,667	51,369,678.11	0.65
42	300442	润泽科技	1,034,998	51,263,450.94	0.65
43	600377	宁沪高速	3,284,200	50,379,628.00	0.64
44	600039	四川路桥	5,038,298	49,879,150.20	0.63

45	601328	交通银行	5,970,493	47,763,944.00	0.60
46	000333	美的集团	654,424	47,249,412.80	0.60
47	601006	大秦铁路	7,152,719	47,207,945.40	0.60
48	300383	光环新网	3,267,400	46,723,820.00	0.59
49	601319	中国人保	5,363,843	46,719,072.53	0.59
50	600875	东方电气	2,764,800	46,282,752.00	0.58
51	603259	药明康德	657,907	45,757,431.85	0.58
52	601728	中国电信	5,858,900	45,406,475.00	0.57
53	600941	中国移动	402,119	45,258,493.45	0.57
54	601988	中国银行	8,008,420	45,007,320.40	0.57
55	688008	澜起科技	532,701	43,681,482.00	0.55
56	601336	新华保险	728,700	42,628,950.00	0.54
57	600030	中信证券	1,535,334	42,405,925.08	0.54
58	605499	东鹏饮料	128,184	40,256,185.20	0.51
59	601138	工业富联	1,863,195	39,835,109.10	0.50
60	000651	格力电器	883,600	39,691,312.00	0.50
61	600958	东方证券	4,026,806	38,979,482.08	0.49
62	601088	中国神华	956,700	38,784,618.00	0.49
63	601766	中国中车	5,442,293	38,313,742.72	0.48
64	002714	牧原股份	894,200	37,565,342.00	0.47
65	600061	国投资本	4,911,800	36,936,736.00	0.47
66	000988	华工科技	777,600	36,554,976.00	0.46
67	601600	中国铝业	4,952,550	34,865,952.00	0.44
68	600018	上港集团	6,085,715	34,749,432.65	0.44
69	600999	招商证券	1,975,402	34,747,321.18	0.44
70	600219	南山铝业	8,871,352	33,977,278.16	0.43
71	000792	盐湖股份	1,987,747	33,950,718.76	0.43
72	600115	中国东航	8,377,700	33,762,131.00	0.43
73	000630	铜陵有色	10,080,500	33,668,870.00	0.43
74	600011	华能国际	4,551,200	32,495,568.00	0.41
75	603288	海天味业	833,050	32,413,975.50	0.41
76	000977	浪潮信息	628,100	31,957,728.00	0.40
77	300502	新易盛	248,369	31,547,830.38	0.40
78	002648	卫星化学	1,762,940	30,551,750.20	0.39
79	000338	潍柴动力	1,976,808	30,403,307.04	0.38
80	300033	同花顺	108,300	29,566,983.00	0.37
81	600111	北方稀土	1,184,000	29,481,600.00	0.37
82	600938	中国海油	1,116,200	29,143,982.00	0.37
83	601111	中国国航	3,681,729	29,048,841.81	0.37
84	601717	中创智领	1,737,987	28,885,343.94	0.36
85	600031	三一重工	1,593,834	28,609,320.30	0.36

86	002475	立讯精密	820,472	28,462,173.68	0.36
87	603881	数据港	1,063,904	27,182,747.20	0.34
88	000538	云南白药	486,688	27,152,323.52	0.34
89	601225	陕西煤业	1,397,430	26,886,553.20	0.34
90	600585	海螺水泥	1,224,147	26,282,436.09	0.33
91	002459	晶澳科技	2,623,396	26,181,492.08	0.33
92	600057	厦门象屿	3,708,000	26,067,240.00	0.33
93	600905	三峡能源	5,931,600	25,268,616.00	0.32
94	600050	中国联通	4,714,301	25,174,367.34	0.32
95	603187	海容冷链	2,052,719	24,139,975.44	0.30
96	002371	北方华创	53,484	23,651,159.64	0.30
97	601601	中国太保	623,685	23,394,424.35	0.30
98	600029	南方航空	3,921,288	23,135,599.20	0.29
99	601901	方正证券	2,920,800	23,103,528.00	0.29
100	688041	海光信息	161,206	22,776,795.74	0.29
101	000625	长安汽车	1,769,600	22,580,096.00	0.29
102	300657	弘信电子	808,300	22,543,487.00	0.28
103	601991	大唐发电	7,050,600	22,350,402.00	0.28
104	000301	东方盛虹	2,628,800	21,897,904.00	0.28
105	300059	东方财富	928,686	21,480,507.18	0.27
106	000408	藏格矿业	496,662	21,192,567.54	0.27
107	002966	苏州银行	2,404,900	21,115,022.00	0.27
108	600160	巨化股份	726,001	20,821,708.68	0.26
109	600901	江苏金租	3,417,855	20,712,201.30	0.26
110	600887	伊利股份	742,649	20,705,054.12	0.26
111	002223	鱼跃医疗	576,740	20,531,944.00	0.26
112	600362	江西铜业	850,500	19,927,215.00	0.25
113	601117	中国化学	2,549,700	19,556,199.00	0.25
114	600760	中航沈飞	325,944	19,106,837.28	0.24
115	002896	中大力德	326,690	18,918,617.90	0.24
116	688009	中国通号	3,650,089	18,761,457.46	0.24
117	601995	中金公司	522,200	18,464,992.00	0.23
118	002027	分众传媒	2,520,089	18,396,649.70	0.23
119	002241	歌尔股份	773,700	18,042,684.00	0.23
120	601881	中国银河	1,051,300	18,029,795.00	0.23
121	000807	云铝股份	1,119,699	17,892,790.02	0.23
122	300953	震裕科技	172,900	17,523,415.00	0.22
123	601633	长城汽车	814,177	17,488,521.96	0.22
124	600908	无锡银行	2,756,700	17,394,777.00	0.22
125	600028	中国石化	3,063,500	17,278,140.00	0.22
126	003816	中国广核	4,739,300	17,251,052.00	0.22

127	600690	海尔智家	693,000	17,172,540.00	0.22
128	601816	京沪高铁	2,972,600	17,092,450.00	0.22
129	688766	普冉股份	269,634	17,040,868.80	0.22
130	601077	渝农商行	2,377,345	16,974,243.30	0.21
131	600104	上汽集团	1,051,800	16,881,390.00	0.21
132	688220	翱捷科技	214,732	16,813,515.60	0.21
133	300738	奥飞数据	798,271	16,707,812.03	0.21
134	600066	宇通客车	671,900	16,703,434.00	0.21
135	603601	再升科技	4,051,260	16,448,115.60	0.21
136	002916	深南电路	151,894	16,375,692.14	0.21
137	000089	深圳机场	2,342,500	16,163,250.00	0.20
138	601877	正泰电器	712,200	16,145,574.00	0.20
139	300115	长盈精密	754,300	16,142,020.00	0.20
140	300274	阳光电源	236,916	16,055,797.32	0.20
141	002252	上海莱士	2,281,396	15,673,190.52	0.20
142	300458	全志科技	394,310	15,650,163.90	0.20
143	002415	海康威视	548,867	15,220,081.91	0.19
144	601577	长沙银行	1,525,000	15,158,500.00	0.19
145	300015	爱尔眼科	1,212,918	15,137,216.64	0.19
146	688599	天合光能	1,031,807	14,992,155.71	0.19
147	600918	中泰证券	2,312,139	14,867,053.77	0.19
148	601229	上海银行	1,400,999	14,864,599.39	0.19
149	002865	钧达股份	375,340	14,638,260.00	0.18
150	601985	中国核电	1,522,700	14,191,564.00	0.18
151	600372	中航机载	1,167,987	14,085,923.22	0.18
152	601186	中国铁建	1,756,100	14,066,361.00	0.18
153	601618	中国中冶	4,690,600	13,977,988.00	0.18
154	002600	领益智造	1,623,000	13,941,570.00	0.18
155	601390	中国中铁	2,468,708	13,849,451.88	0.17
156	600535	天士力	877,434	13,731,842.10	0.17
157	688256	寒武纪	22,656	13,627,584.00	0.17
158	002236	大华股份	838,900	13,321,732.00	0.17
159	600547	山东黄金	413,000	13,187,090.00	0.17
160	600795	国电电力	2,709,502	13,113,989.68	0.17
161	600019	宝钢股份	1,976,861	13,027,513.99	0.16
162	301261	恒工精密	177,653	12,949,127.17	0.16
163	001203	大中矿业	1,349,100	12,748,995.00	0.16
164	600085	同仁堂	353,400	12,743,604.00	0.16
165	603309	维力医疗	996,410	12,674,335.20	0.16
166	300580	贝斯特	512,700	12,597,039.00	0.16
167	688111	金山办公	43,716	12,242,665.80	0.15

168	002461	珠江啤酒	1,068,129	12,059,176.41	0.15
169	300857	协创数据	139,100	11,970,946.00	0.15
170	000983	山西焦煤	1,843,700	11,799,680.00	0.15
171	688235	百济神州	50,469	11,791,577.16	0.15
172	000708	中信特钢	994,100	11,690,616.00	0.15
173	600426	华鲁恒升	539,100	11,682,297.00	0.15
174	603444	吉比特	38,400	11,594,880.00	0.15
175	603909	建发合诚	1,189,720	11,587,872.80	0.15
176	601311	骆驼股份	1,280,710	11,564,811.30	0.15
177	002807	江阴银行	2,397,200	11,386,700.00	0.14
178	601865	福莱特	748,500	11,384,685.00	0.14
179	603071	物产环能	886,200	11,281,326.00	0.14
180	300433	蓝思科技	503,706	11,232,643.80	0.14
181	000963	华东医药	272,600	11,002,136.00	0.14
182	603808	歌力思	1,320,200	10,957,660.00	0.14
183	002594	比亚迪	32,008	10,623,775.28	0.13
184	600025	华能水电	1,107,400	10,575,670.00	0.13
185	600150	中国船舶	325,000	10,575,500.00	0.13
186	301368	丰立智能	169,900	10,504,917.00	0.13
187	603323	苏农银行	1,815,600	10,185,516.00	0.13
188	301328	维峰电子	237,600	10,014,840.00	0.13
189	600428	中远海特	1,581,800	9,886,250.00	0.12
190	601021	春秋航空	176,100	9,799,965.00	0.12
191	601555	东吴证券	1,118,800	9,789,500.00	0.12
192	002493	荣盛石化	1,174,576	9,725,489.28	0.12
193	601066	中信建投	391,900	9,425,195.00	0.12
194	002206	海利得	1,824,500	9,323,195.00	0.12
195	601128	常熟银行	1,255,380	9,252,150.60	0.12
196	601928	凤凰传媒	827,300	9,240,941.00	0.12
197	002014	永新股份	758,140	9,188,656.80	0.12
198	603728	鸣志电器	159,500	9,166,465.00	0.12
199	000858	五粮液	76,782	9,129,379.80	0.12
200	600415	小商品城	434,800	8,991,664.00	0.11
201	300432	富临精工	681,900	8,912,433.00	0.11
202	600188	兖矿能源	725,600	8,830,552.00	0.11
203	603986	兆易创新	69,200	8,755,876.00	0.11
204	002839	张家港行	1,939,820	8,729,190.00	0.11
205	601012	隆基绿能	568,040	8,531,960.80	0.11
206	600346	恒力石化	593,494	8,463,224.44	0.11
207	600350	山东高速	787,700	8,396,882.00	0.11
208	600602	云赛智联	411,800	8,306,006.00	0.10

209	000726	鲁 泰 A	1,306,700	8,284,478.00	0.10
210	002155	湖南黄金	460,730	8,224,030.50	0.10
211	300760	迈瑞医疗	36,454	8,193,036.50	0.10
212	601168	西部矿业	484,500	8,057,235.00	0.10
213	601669	中国电建	1,633,300	7,954,171.00	0.10
214	600027	华电国际	1,449,300	7,927,671.00	0.10
215	688082	盛美上海	68,635	7,820,271.90	0.10
216	002595	豪迈科技	132,000	7,817,040.00	0.10
217	600989	宝丰能源	479,877	7,745,214.78	0.10
218	601825	沪农商行	790,100	7,663,970.00	0.10
219	300718	长盛轴承	109,700	7,623,053.00	0.10
220	002128	电投能源	382,400	7,563,872.00	0.10
221	301338	凯格精机	158,200	7,547,722.00	0.10
222	600023	浙能电力	1,403,213	7,437,028.90	0.09
223	605117	德业股份	139,540	7,348,176.40	0.09
224	688023	安恒信息	128,607	7,297,161.18	0.09
225	688029	南微医学	107,614	7,269,325.70	0.09
226	000426	兴业银锡	457,433	7,227,441.40	0.09
227	600584	长电科技	208,702	7,031,170.38	0.09
228	600580	卧龙电驱	351,360	6,946,387.20	0.09
229	600418	江淮汽车	170,100	6,819,309.00	0.09
230	688327	云从科技	492,935	6,797,573.65	0.09
231	601236	红塔证券	798,600	6,764,142.00	0.09
232	300476	胜宏科技	50,200	6,745,876.00	0.09
233	601800	中国交建	753,382	6,697,565.98	0.08
234	002965	祥鑫科技	169,900	6,663,478.00	0.08
235	603893	瑞芯微	43,800	6,651,468.00	0.08
236	601698	中国卫通	317,500	6,499,225.00	0.08
237	600004	白云机场	709,000	6,451,900.00	0.08
238	002539	云图控股	687,400	6,447,812.00	0.08
239	600475	华光环能	611,192	6,368,620.64	0.08
240	301171	易点天下	237,900	6,359,067.00	0.08
241	002050	三花智控	240,869	6,354,124.22	0.08
242	300993	玉马科技	418,100	6,338,396.00	0.08
243	300017	网宿科技	590,812	6,333,504.64	0.08
244	600380	健康元	571,600	6,304,748.00	0.08
245	001339	智微智能	128,300	6,200,739.00	0.08
246	603393	新天然气	213,800	6,189,510.00	0.08
247	300418	昆仑万维	183,800	6,181,194.00	0.08
248	601799	星宇股份	49,200	6,150,000.00	0.08
249	002028	思源电气	83,500	6,087,985.00	0.08

250	002637	赞宇科技	603,000	6,017,940.00	0.08
251	688169	石头科技	38,371	6,006,980.05	0.08
252	000975	山金国际	317,000	6,003,980.00	0.08
253	600348	华阳股份	876,751	5,839,161.66	0.07
254	000719	中原传媒	463,650	5,753,896.50	0.07
255	600332	白云山	212,100	5,590,956.00	0.07
256	300737	科顺股份	1,151,700	5,551,194.00	0.07
257	600183	生益科技	182,700	5,508,405.00	0.07
258	605090	九丰能源	212,600	5,487,206.00	0.07
259	300638	广和通	189,700	5,431,111.00	0.07
260	603662	柯力传感	82,400	5,267,832.00	0.07
261	300832	新产业	92,800	5,263,616.00	0.07
262	601369	陕鼓动力	598,900	5,252,353.00	0.07
263	300590	移为通信	399,360	5,195,673.60	0.07
264	300058	蓝色光标	776,700	5,095,152.00	0.06
265	600406	国电南瑞	225,300	5,048,973.00	0.06
266	000768	中航西飞	182,700	4,995,018.00	0.06
267	600109	国金证券	566,800	4,970,836.00	0.06
268	300014	亿纬锂能	107,152	4,908,633.12	0.06
269	002460	赣锋锂业	145,000	4,896,650.00	0.06
270	000729	燕京啤酒	374,100	4,837,113.00	0.06
271	688551	科威尔	162,757	4,783,428.23	0.06
272	003021	兆威机电	43,500	4,704,525.00	0.06
273	601377	兴业证券	758,696	4,696,328.24	0.06
274	000876	新希望	497,800	4,669,364.00	0.06
275	688396	华润微	98,932	4,665,633.12	0.06
276	002659	凯文教育	913,700	4,605,048.00	0.06
277	688046	药康生物	292,692	4,402,087.68	0.06
278	600489	中金黄金	296,800	4,342,184.00	0.05
279	688568	中科星图	117,924	4,246,443.24	0.05
280	002913	奥士康	144,200	4,240,922.00	0.05
281	688017	绿的谐波	33,822	4,224,029.58	0.05
282	600893	航发动力	109,552	4,222,134.08	0.05
283	002466	天齐锂业	131,100	4,200,444.00	0.05
284	600710	苏美达	437,000	4,199,570.00	0.05
285	688208	道通科技	136,052	4,163,191.20	0.05
286	002601	龙佰集团	255,964	4,149,176.44	0.05
287	601827	三峰环境	491,900	4,131,960.00	0.05
288	002790	瑞尔特	560,500	4,074,835.00	0.05
289	603848	好太太	263,700	4,060,980.00	0.05
290	688114	华大智造	61,423	3,982,053.09	0.05

291	000598	兴蓉环境	547,600	3,948,196.00	0.05
292	300681	英搏尔	142,100	3,930,486.00	0.05
293	688677	海泰新光	100,634	3,925,732.34	0.05
294	001872	招商港口	197,100	3,914,406.00	0.05
295	600480	凌云股份	317,090	3,858,985.30	0.05
296	600233	圆通速递	297,700	3,837,353.00	0.05
297	603916	苏博特	419,400	3,799,764.00	0.05
298	300369	绿盟科技	488,400	3,794,868.00	0.05
299	600733	北汽蓝谷	512,300	3,775,651.00	0.05
300	302132	中航成飞	42,900	3,772,626.00	0.05
301	002340	格林美	593,900	3,771,265.00	0.05
302	605589	圣泉集团	135,800	3,768,450.00	0.05
303	688126	沪硅产业	198,799	3,721,517.28	0.05
304	300788	中信出版	116,000	3,721,280.00	0.05
305	603889	新澳股份	637,700	3,698,660.00	0.05
306	002444	巨星科技	143,200	3,653,032.00	0.05
307	605305	中际联合	131,100	3,641,958.00	0.05
308	301165	锐捷网络	59,240	3,640,890.40	0.05
309	600196	复星医药	143,838	3,608,895.42	0.05
310	688308	欧科亿	194,581	3,590,019.45	0.05
311	300547	川环科技	118,500	3,581,070.00	0.05
312	301220	亚香股份	78,900	3,542,610.00	0.04
313	603515	欧普照明	193,600	3,482,864.00	0.04
314	300308	中际旭创	23,604	3,442,879.44	0.04
315	600961	株冶集团	304,600	3,405,428.00	0.04
316	603195	公牛集团	69,114	3,334,750.50	0.04
317	002543	万和电气	297,900	3,309,669.00	0.04
318	601686	友发集团	576,200	3,272,816.00	0.04
319	600176	中国巨石	287,015	3,271,971.00	0.04
320	600009	上海机场	102,263	3,248,895.51	0.04
321	601878	浙商证券	297,488	3,245,594.08	0.04
322	301195	北路智控	90,462	3,238,539.60	0.04
323	688037	芯源微	29,615	3,174,728.00	0.04
324	002416	爱施德	260,800	3,134,816.00	0.04
325	600515	海南机场	872,055	3,087,074.70	0.04
326	601777	千里科技	362,400	3,076,776.00	0.04
327	300662	科锐国际	103,200	3,066,072.00	0.04
328	000425	徐工机械	394,541	3,065,583.57	0.04
329	603303	得邦照明	253,400	3,058,538.00	0.04
330	600256	广汇能源	502,500	3,025,050.00	0.04
331	600167	联美控股	536,200	3,013,444.00	0.04

332	300699	光威复材	95,000	3,008,650.00	0.04
333	601360	三六零	293,660	2,995,332.00	0.04
334	600866	星湖科技	426,900	2,949,879.00	0.04
335	002353	杰瑞股份	83,500	2,922,500.00	0.04
336	300938	信测标准	134,360	2,822,903.60	0.04
337	688122	西部超导	53,869	2,794,723.72	0.04
338	600089	特变电工	233,200	2,782,076.00	0.04
339	603650	彤程新材	86,100	2,768,115.00	0.03
340	688236	春立医疗	146,848	2,729,904.32	0.03
341	000685	中山公用	309,700	2,719,166.00	0.03
342	688469	芯联集成	566,700	2,703,159.00	0.03
343	603565	中谷物流	282,800	2,700,740.00	0.03
344	000893	亚钾国际	89,600	2,700,544.00	0.03
345	001965	招商公路	223,309	2,679,708.00	0.03
346	000568	泸州老窖	23,460	2,660,364.00	0.03
347	300803	指南针	32,370	2,610,964.20	0.03
348	688223	晶科能源	500,335	2,596,738.65	0.03
349	000423	东阿阿胶	49,300	2,578,390.00	0.03
350	600486	扬农化工	44,050	2,554,900.00	0.03
351	600352	浙江龙盛	248,300	2,522,728.00	0.03
352	002212	天融信	325,900	2,509,430.00	0.03
353	603799	华友钴业	67,300	2,491,446.00	0.03
354	600323	瀚蓝环境	100,500	2,447,175.00	0.03
355	001308	康冠科技	107,600	2,433,912.00	0.03
356	688480	赛恩斯	74,850	2,406,427.50	0.03
357	603277	银都股份	146,790	2,348,640.00	0.03
358	600299	安迪苏	237,562	2,292,473.30	0.03
359	301029	怡合达	99,000	2,263,140.00	0.03
360	603087	甘李药业	40,900	2,240,502.00	0.03
361	605507	国邦医药	112,125	2,216,711.25	0.03
362	601528	瑞丰银行	382,400	2,214,096.00	0.03
363	688162	巨一科技	78,299	2,132,864.76	0.03
364	002948	青岛银行	427,060	2,126,758.80	0.03
365	601898	中煤能源	193,801	2,120,182.94	0.03
366	301332	德尔玛	206,100	2,110,464.00	0.03
367	688031	星环科技	44,530	2,076,433.90	0.03
368	300809	华辰装备	55,100	2,070,658.00	0.03
369	600438	通威股份	123,200	2,063,600.00	0.03
370	002938	鹏鼎控股	63,940	2,047,998.20	0.03
371	000895	双汇发展	83,638	2,041,603.58	0.03
372	600755	厦门国贸	330,400	1,998,920.00	0.03

373	300100	双林股份	42,000	1,977,360.00	0.02
374	603236	移远通信	23,000	1,973,400.00	0.02
375	600012	皖通高速	115,500	1,961,190.00	0.02
376	001288	运机集团	93,640	1,950,521.20	0.02
377	001322	箭牌家居	229,300	1,937,585.00	0.02
378	688668	鼎通科技	30,852	1,927,015.92	0.02
379	603667	五洲新春	57,500	1,926,825.00	0.02
380	600048	保利发展	234,600	1,900,260.00	0.02
381	688332	中科蓝讯	18,416	1,898,321.28	0.02
382	300416	苏试试验	132,400	1,897,292.00	0.02
383	688578	艾力斯	20,334	1,891,875.36	0.02
384	002478	常宝股份	358,200	1,880,550.00	0.02
385	600998	九州通	363,300	1,867,362.00	0.02
386	688059	华锐精密	39,361	1,840,520.36	0.02
387	300751	迈为股份	26,200	1,822,472.00	0.02
388	688786	悦安新材	77,328	1,801,742.40	0.02
389	603699	纽威股份	57,800	1,801,626.00	0.02
390	688472	阿特斯	195,769	1,791,286.35	0.02
391	688225	亚信安全	87,549	1,785,124.11	0.02
392	688025	杰普特	24,902	1,780,493.00	0.02
393	688018	乐鑫科技	12,115	1,770,001.50	0.02
394	688819	天能股份	63,695	1,768,173.20	0.02
395	000938	紫光股份	73,300	1,758,467.00	0.02
396	601628	中国人寿	42,453	1,748,639.07	0.02
397	002311	海大集团	29,600	1,734,264.00	0.02
398	600502	安徽建工	367,900	1,729,130.00	0.02
399	688389	普门科技	130,513	1,686,227.96	0.02
400	600436	片仔癀	8,426	1,685,284.26	0.02
401	002056	横店东磁	118,766	1,680,538.90	0.02
402	603529	爱玛科技	48,000	1,651,200.00	0.02
403	000600	建投能源	235,800	1,629,378.00	0.02
404	600517	国网英大	316,200	1,612,620.00	0.02
405	002233	塔牌集团	214,500	1,587,300.00	0.02
406	000657	中钨高新	133,600	1,584,496.00	0.02
407	002837	英维克	52,920	1,572,253.20	0.02
408	601456	国联民生	149,000	1,542,150.00	0.02
409	002706	良信股份	172,200	1,534,302.00	0.02
410	300679	电连技术	33,500	1,520,230.00	0.02
411	300628	亿联网络	43,500	1,512,060.00	0.02
412	600236	桂冠电力	239,700	1,502,919.00	0.02
413	603338	浙江鼎力	31,500	1,493,100.00	0.02

414	002821	凯莱英	16,900	1,491,425.00	0.02
415	600166	福田汽车	549,300	1,488,603.00	0.02
416	002484	江海股份	72,400	1,483,476.00	0.02
417	300496	中科创达	25,800	1,476,276.00	0.02
418	300969	恒帅股份	21,800	1,460,164.00	0.02
419	601208	东材科技	151,200	1,433,376.00	0.02
420	001283	豪鹏科技	26,200	1,426,590.00	0.02
421	300979	华利集团	26,951	1,416,814.07	0.02
422	688676	金盘科技	42,222	1,412,325.90	0.02
423	300001	特锐德	58,300	1,397,451.00	0.02
424	002273	水晶光电	69,600	1,389,912.00	0.02
425	002407	多氟多	111,900	1,364,061.00	0.02
426	600153	建发股份	131,300	1,361,581.00	0.02
427	603612	索通发展	73,600	1,352,768.00	0.02
428	601963	重庆银行	124,400	1,350,984.00	0.02
429	600499	科达制造	137,400	1,346,520.00	0.02
430	600820	隧道股份	216,800	1,322,480.00	0.02
431	301413	安培龙	17,100	1,307,295.00	0.02
432	688358	祥生医疗	44,057	1,306,290.05	0.02
433	603501	豪威集团	10,105	1,289,903.25	0.02
434	603755	日辰股份	49,100	1,282,492.00	0.02
435	002073	软控股份	142,800	1,269,492.00	0.02
436	002588	史丹利	139,600	1,229,876.00	0.02
437	301363	美好医疗	69,100	1,218,924.00	0.02
438	002384	东山精密	31,800	1,201,086.00	0.02
439	301061	匠心家居	15,400	1,194,116.00	0.02
440	301160	翔楼新材	14,900	1,193,192.00	0.02
441	300041	回天新材	126,400	1,190,688.00	0.02
442	300856	科思股份	77,900	1,180,185.00	0.01
443	002439	启明星辰	72,800	1,164,072.00	0.01
444	000034	神州数码	30,900	1,163,076.00	0.01
445	603868	飞科电器	32,400	1,162,188.00	0.01
446	301236	软通动力	21,200	1,158,368.00	0.01
447	600383	金地集团	304,800	1,155,192.00	0.01
448	002487	大金重工	34,900	1,148,210.00	0.01
449	600460	士兰微	45,800	1,136,756.00	0.01
450	688484	南芯科技	28,556	1,129,389.80	0.01
451	000928	中钢国际	178,600	1,121,608.00	0.01
452	688728	格科微	71,091	1,094,801.40	0.01
453	688378	奥来德	63,648	1,072,468.80	0.01
454	300620	光库科技	22,700	1,069,397.00	0.01

455	002739	万达电影	92,100	1,052,703.00	0.01
456	002463	沪电股份	24,500	1,043,210.00	0.01
457	601127	赛力斯	7,727	1,037,890.64	0.01
458	002242	九阳股份	108,200	1,027,900.00	0.01
459	603966	法兰泰克	110,300	1,023,584.00	0.01
460	300498	温氏股份	59,700	1,019,676.00	0.01
461	002139	拓邦股份	73,100	1,009,511.00	0.01
462	300973	立高食品	20,600	1,004,662.00	0.01
463	605555	德昌股份	60,190	997,348.30	0.01
464	688408	中信博	21,323	995,357.64	0.01
465	688188	柏楚电子	7,108	935,839.28	0.01
466	603081	大丰实业	86,100	931,602.00	0.01
467	603919	金徽酒	51,300	928,530.00	0.01
468	002876	三利谱	36,500	919,435.00	0.01
469	688303	大全能源	43,113	919,169.16	0.01
470	603039	泛微网络	16,300	907,910.00	0.01
471	601019	山东出版	94,100	891,127.00	0.01
472	300755	华致酒行	45,100	870,430.00	0.01
473	300627	华测导航	24,780	867,300.00	0.01
474	605089	味知香	34,500	856,980.00	0.01
475	002949	华阳国际	63,500	855,980.00	0.01
476	688249	晶合集成	41,528	841,772.56	0.01
477	000636	风华高科	60,700	834,018.00	0.01
478	603180	金牌家居	42,300	823,581.00	0.01
479	003022	联泓新科	51,900	821,577.00	0.01
480	688161	威高骨科	30,166	808,147.14	0.01
481	688369	致远互联	29,681	783,281.59	0.01
482	688073	毕得医药	13,459	780,891.18	0.01
483	300357	我武生物	37,800	780,192.00	0.01
484	688271	联影医疗	6,092	778,192.08	0.01
485	603466	风语筑	76,100	767,849.00	0.01
486	603885	吉祥航空	55,200	743,544.00	0.01
487	002315	焦点科技	16,200	740,178.00	0.01
488	605128	上海沿浦	24,095	729,114.70	0.01
489	688702	盛科通信	11,884	725,874.72	0.01
490	603009	北特科技	17,200	717,240.00	0.01
491	603203	快克智能	28,400	706,308.00	0.01
492	300573	兴齐眼药	13,500	699,165.00	0.01
493	603057	紫燕食品	31,600	690,776.00	0.01
494	300910	瑞丰新材	11,800	681,450.00	0.01
495	002925	盈趣科技	37,800	679,644.00	0.01

496	002080	中材科技	33,900	661,050.00	0.01
497	300413	芒果超媒	29,900	652,418.00	0.01
498	301091	深城交	22,280	651,467.20	0.01
499	603871	嘉友国际	59,800	642,850.00	0.01
500	688281	华秦科技	10,585	640,498.35	0.01
501	601100	恒立液压	8,800	633,600.00	0.01
502	605183	确成股份	36,100	631,750.00	0.01
503	003031	中瓷电子	11,800	627,878.00	0.01
504	688333	铂力特	10,480	624,188.80	0.01
505	300795	米奥会展	41,590	617,611.50	0.01
506	600886	国投电力	41,600	613,184.00	0.01
507	002683	广东宏大	18,000	610,920.00	0.01
508	300408	三环集团	18,200	607,880.00	0.01
509	002032	苏泊尔	11,400	597,246.00	0.01
510	688232	新点软件	19,450	584,278.00	0.01
511	603915	国茂股份	39,800	578,692.00	0.01
512	603877	太平鸟	39,900	578,550.00	0.01
513	688286	敏芯股份	8,135	575,063.15	0.01
514	002643	万润股份	49,900	574,349.00	0.01
515	603508	思维列控	21,600	571,968.00	0.01
516	603859	能科科技	17,400	562,368.00	0.01
517	601872	招商轮船	89,600	560,896.00	0.01
518	600063	皖维高新	122,100	559,218.00	0.01
519	000960	锡业股份	36,300	555,390.00	0.01
520	002327	富安娜	73,600	546,112.00	0.01
521	688733	壹石通	28,772	544,941.68	0.01
522	301327	华宝新能	10,360	532,089.60	0.01
523	688150	莱特光电	21,260	525,547.20	0.01
524	300443	金雷股份	22,800	515,280.00	0.01
525	601598	中国外运	104,300	514,199.00	0.01
526	300124	汇川技术	7,706	497,576.42	0.01
527	603298	杭叉集团	23,600	494,420.00	0.01
528	600809	山西汾酒	2,800	493,892.00	0.01
529	002202	金风科技	46,300	474,575.00	0.01
530	300811	铂科新材	10,200	473,382.00	0.01
531	688507	索辰科技	6,376	467,552.08	0.01
532	002518	科士达	20,600	465,354.00	0.01
533	601677	明泰铝业	37,300	463,266.00	0.01
534	603018	华设集团	56,100	460,581.00	0.01
535	688698	伟创电气	9,751	460,247.20	0.01
536	600674	川投能源	28,600	458,744.00	0.01

537	002138	顺络电子	16,300	458,356.00	0.01
538	002011	盾安环境	39,500	458,200.00	0.01
539	688016	心脉医疗	5,135	454,036.70	0.01
540	000885	城发环境	33,900	451,548.00	0.01
541	601155	新城控股	32,900	450,072.00	0.01
542	688522	纳睿雷达	8,782	449,814.04	0.01
543	000951	中国重汽	25,500	448,290.00	0.01
544	300685	艾德生物	20,800	447,824.00	0.01
545	002831	裕同科技	18,900	442,638.00	0.01
546	601133	柏诚股份	34,800	442,308.00	0.01
547	600863	内蒙华电	106,400	437,304.00	0.01
548	600391	航发科技	14,700	429,240.00	0.01
549	600141	兴发集团	20,700	424,971.00	0.01
550	300474	景嘉微	5,600	408,800.00	0.01
551	688157	松井股份	10,225	407,773.00	0.01
552	600595	中孚实业	91,300	399,894.00	0.01
553	605358	立昂微	16,600	386,780.00	0.00
554	000915	华特达因	10,900	385,315.00	0.00
555	605296	神农集团	12,300	378,102.00	0.00
556	603308	应流股份	16,200	373,896.00	0.00
557	688403	汇成股份	34,686	360,387.54	0.00
558	603296	华勤技术	4,300	346,924.00	0.00
559	603661	恒林股份	12,100	346,060.00	0.00
560	688095	福昕软件	4,990	338,870.90	0.00
561	688376	美埃科技	8,794	327,752.38	0.00
562	000962	东方钽业	19,800	324,918.00	0.00
563	000661	长春高新	3,200	317,376.00	0.00
564	603730	岱美股份	55,200	314,088.00	0.00
565	002705	新宝股份	21,200	311,640.00	0.00
566	002649	博彦科技	21,300	309,489.00	0.00
567	601108	财通证券	39,000	308,490.00	0.00
568	603600	永艺股份	28,400	302,176.00	0.00
569	600582	天地科技	49,800	298,302.00	0.00
570	688501	青达环保	10,390	289,361.50	0.00
571	601233	桐昆股份	27,200	288,320.00	0.00
572	600062	华润双鹤	14,800	276,168.00	0.00
573	603160	汇顶科技	3,500	248,605.00	0.00
574	300373	扬杰科技	4,400	228,360.00	0.00
575	600481	双良节能	46,700	225,094.00	0.00
576	600298	安琪酵母	5,800	203,986.00	0.00
577	688525	佰维存储	2,134	143,831.60	0.00

578	002690	美亚光电	6,400	107,968.00	0.00
579	000800	一汽解放	15,144	103,887.84	0.00
580	688775	影石创新	573	71,143.68	0.00
581	603049	中策橡胶	724	31,023.40	0.00
582	688545	兴福电子	994	26,788.30	0.00
583	301458	钧崴电子	701	23,911.11	0.00
584	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.00
585	688583	思看科技	227	18,087.36	0.00
586	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
587	301602	超研股份	658	16,318.40	0.00
588	301501	恒鑫生活	350	15,827.00	0.00
589	603202	天有为	166	15,049.56	0.00
590	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
591	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
592	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
593	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
594	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
595	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
596	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
597	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
598	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
599	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
600	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
601	002674	兴业科技	600	5,994.00	0.00
602	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
603	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
604	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
605	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
606	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
607	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
608	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
609	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
610	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
611	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
612	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
613	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	000651	格力电器	161,922,816.61	1.60
2	300308	中际旭创	148,278,978.56	1.46
3	002230	科大讯飞	145,174,430.70	1.43
4	601919	中远海控	141,476,035.88	1.40
5	000063	中兴通讯	140,443,938.51	1.39
6	000333	美的集团	135,988,691.00	1.34
7	002001	新和成	135,918,026.58	1.34
8	601009	南京银行	126,881,216.10	1.25
9	000977	浪潮信息	126,245,802.16	1.25
10	601899	紫金矿业	125,433,760.00	1.24
11	600926	杭州银行	122,097,059.50	1.21
12	600015	华夏银行	121,931,128.58	1.20
13	601688	华泰证券	120,315,162.00	1.19
14	000776	广发证券	117,713,302.50	1.16
15	000001	平安银行	116,149,943.67	1.15
16	601318	中国平安	112,848,388.00	1.11
17	600585	海螺水泥	112,265,671.28	1.11
18	600741	华域汽车	111,088,301.52	1.10
19	600482	中国动力	108,579,668.80	1.07
20	603993	洛阳钼业	106,859,566.50	1.05

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	269,616,795.82	2.66
2	000333	美的集团	234,194,817.86	2.31
3	600519	贵州茅台	217,117,007.50	2.14
4	000651	格力电器	213,102,958.42	2.10
5	002594	比亚迪	196,732,503.63	1.94
6	600018	上港集团	184,718,001.99	1.82
7	000776	广发证券	167,665,253.52	1.66
8	601688	华泰证券	163,189,052.00	1.61
9	300308	中际旭创	162,393,788.80	1.60
10	601919	中远海控	161,000,080.50	1.59
11	603501	豪威集团	154,005,989.90	1.52
12	600887	伊利股份	151,267,498.14	1.49
13	605499	东鹏饮料	149,863,717.55	1.48

14	600015	华夏银行	148,819,671.00	1.47
15	002001	新和成	148,085,055.10	1.46
16	601816	京沪高铁	147,526,529.00	1.46
17	601211	国泰海通	145,061,895.40	1.43
18	601318	中国平安	144,723,935.25	1.43
19	688235	百济神州	138,394,936.62	1.37
20	000725	京东方A	136,050,126.73	1.34

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	19,138,415,042.39
卖出股票收入（成交）总额	21,247,990,186.95

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	310,691.21	0.00
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	310,691.21	0.00

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	123256	恒帅转债	1,357	310,691.21	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

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，国信证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会深圳监管局的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，杭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浙江监管局、国家外汇管理局浙江省分

局的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业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	1,392,526.28
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	2,222,374.66
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	3,646,326.27

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未持有流通受限的股票。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中未持有流通受限股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额 比例 (%)	持有份额	占总份额 比例 (%)
富国沪深 300 指数增强 A/B	773, 116	4, 576. 40	702, 842, 25 2. 66	19. 87	2, 835, 243, 191. 62	80. 13
富国沪深 300 指数增强 C	244, 228	5, 629. 75	1, 115, 667, 675. 01	81. 14	259, 275, 68 9. 03	18. 86
富国沪深 300 指数增强 Y	5, 354	3, 084. 55	—	—	16, 514, 667 . 43	100. 00
合计	1, 022, 698	4, 820. 14	1, 818, 509, 927. 67	36. 89	3, 111, 033, 548. 08	63. 11

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	富国沪深 300 指数增强 A/B	3, 936, 918. 59	0. 1113
	富国沪深 300 指数增强 C	99, 690. 88	0. 0073
	富国沪深 300 指数增强 Y	81, 211. 23	0. 4918
	合计	4, 117, 820. 70	0. 0835

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	富国沪深 300 指数增强 A/B	富国沪深 300 指数增强 C	富国沪深 300 指数增强 Y
基金合同生效日 (2009 年 12 月 16 日) 基金份额总额	3,489,909,303.02	—	—
报告期期初基金份额总额	4,833,758,482.14	1,620,307,760.20	4,753,416.50
本报告期基金总申购份额	457,434,690.45	649,991,352.42	13,534,761.94
减：本报告期基金总赎回份额	1,753,107,728.31	895,355,748.58	1,773,511.01
本报告期基金拆分变动份额	—	—	—
本报告期期末基金份额总额	3,538,085,444.28	1,374,943,364.04	16,514,667.43

§ 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。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
长江证券	3	1,710,165,273.10	4.23	232,412.05	4.23	—

诚通证券	2	—	—	—	—	—
德邦证券	1	—	—	—	—	—
东吴证券	1	—	—	—	—	—
方正证券	2	6,550,325,185 .02	16.22	890,210.76	16.22	—
广发证券	2	—	—	—	—	—
国都证券	2	—	—	—	—	—
国海证券	1	—	—	—	—	—
国盛证券	2	—	—	—	—	—
国泰海通	3	1,505,998,964 .89	3.73	204,666.63	3.73	—
国泰君安	2	3,868,335,870 .70	9.58	525,704.84	9.58	—
国元证券	1	—	—	—	—	—
海通证券	1	1,778,526,550 .67	4.40	241,722.49	4.40	—
华宝证券	1	—	—	—	—	—
华创证券	1	1,819,094,729 .41	4.50	247,211.95	4.50	—
华泰证券	2	492,517,563.0 0	1.22	66,935.36	1.22	—
民生证券	2	—	—	—	—	—
瑞银证券	2	—	—	—	—	—
上海证券	2	—	—	—	—	—
申万宏源	2	1,874,422,407 .42	4.64	254,730.73	4.64	—
西部证券	2	—	—	—	—	—
银河证券	2	2,191,438,625 .42	5.43	297,819.88	5.43	—
招商证券	1	5,371,219,474 .33	13.30	729,999.86	13.30	—
中金公司	2	2,957,204,949 .15	7.32	401,890.19	7.32	—
中泰证券	3	—	—	—	—	—
中信建投	2	10,265,175,55 8.85	25.42	1,395,049.98	25.42	—
中信证券	1	—	—	—	—	—

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。本报告期本基金退租券商交易单元：川财证券（27548、393263）。本报告期

本基金新增券商交易单元：东吴证券（723506），华泰证券（018901、62114），银河证券（016758、59446），中金公司（005253、48489）。

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（%）
长江证券	12,794,880.00	14.17	—	—	—	—
诚通证券	—	—	—	—	—	—
德邦证券	—	—	—	—	—	—
东吴证券	—	—	—	—	—	—
方正证券	1,367,306.48	1.51	—	—	—	—
广发证券	—	—	—	—	—	—
国都证券	—	—	—	—	—	—
国海证券	—	—	—	—	—	—
国盛证券	—	—	—	—	—	—
国泰海通	—	—	—	—	—	—
国泰君安	22,979,410.00	25.45	—	—	—	—
国元证券	—	—	—	—	—	—
海通证券	—	—	—	—	—	—
华宝证券	—	—	—	—	—	—
华创证券	—	—	—	—	—	—
华泰证券	—	—	—	—	—	—
民生证券	—	—	—	—	—	—
瑞银证券	—	—	—	—	—	—
上海证券	—	—	—	—	—	—
申万宏源	—	—	—	—	—	—

西部证券	—	—	—	—	—	—
银河证券	—	—	—	—	—	—
招商证券	5,492,300.00	6.08	—	—	—	—
中金公司	15,981,940.00	17.70	—	—	—	—
中泰证券	—	—	—	—	—	—
中信建投	31,661,770.00	35.07	—	—	—	—
中信证券	—	—	—	—	—	—

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	富国基金管理有限公司关于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

注：本基金本报告期无单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

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