

富荣福耀混合型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:富荣基金管理有限公司

基金托管人:国泰海通证券股份有限公司

送出日期:2026 年 08 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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。

基金托管人国泰海通证券股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年8月26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01月01日起至2026年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
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	61
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	61
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	61
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	61
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
7.12 投资组合报告附注	61
§8 基金份额持有人信息	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62

8.2 盈利投资者数量占比.....	63
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	63
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	63
§9 开放式基金份额变动.....	64
§10 重大事件揭示.....	64
10.1 基金份额持有人大会决议.....	64
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.....	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	64
10.4 基金投资策略的改变.....	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	65
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	65
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.....	65
10.8 其他重大事件.....	66
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	66
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.....	66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	67
§12 备查文件目录.....	67
12.1 备查文件目录.....	67
12.2 存放地点.....	67
12.3 查阅方式.....	67

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富荣福耀混合型证券投资基金	
基金简称	富荣福耀混合	
基金主代码	012876	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年12月27日	
基金管理人	富荣基金管理有限公司	
基金托管人	国泰海通证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	539,129,270.26份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	富荣福耀混合A	富荣福耀混合C
下属分级基金的交易代码	012876	012877
报告期末下属分级基金的份额总额	82,270,361.57份	456,858,908.69份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对行业及公司深入的研究分析，精选优质上市公司，在严格控制风险和保持资产流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采用的投资策略有：大类资产配置、股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、参与融资业务投资策略等。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×70%+中债综合指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期风险收益水平高于债券型基金及货币市场基金，低于股票型基金。

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		富荣基金管理有限公司	国泰海通证券股份有限公司
信息披	姓名	邱张斌	帅芳

露负责人	联系电话	0755-84356633	021-38677947
	电子邮箱	service@furamc.com.cn	tgrxp@tg.gtht.com
客户服务电话		400-685-5600	021-38917599-5
传真		0755-83230787	021-50872603
注册地址		广州市南沙区横沥镇汇通二街2号3110房	中国（上海）自由贸易试验区 商城路618号
办公地址		深圳市福田区八卦四路52号 安吉尔大厦24层	上海市静安区新闻路669号博 华广场19楼
邮政编码		518038	200041
法定代表人		王亦伟	朱健

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.furamc.com.cn/
基金中期报告置备地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	富荣基金管理有限公司	深圳市福田区八卦四路52号安吉尔大厦24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01月01日-2026年06月30日)	
	富荣福耀混合A	富荣福耀混合C
本期已实现收益	-1,357,611.30	14,227,494.56

本期利润	-16,656,783.38	-77,992,795.86
加权平均基金份额本期利润	-0.5257	-0.2443
本期加权平均净值利润率	-44.54%	-20.78%
本期基金份额净值增长率	-7.19%	-7.37%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2026年06月30日)	
期末可供分配利润	1,100,899.41	-2,242,477.90
期末可供分配基金份额利润	0.0134	-0.0049
期末基金资产净值	83,371,260.98	454,616,430.79
期末基金份额净值	1.0134	0.9951
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2026年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	1.34%	-0.49%

注：①上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

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期末可供分配利润是采用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。

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

富荣福耀混合A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	-15.56%	1.77%	8.49%	0.88%	-24.05%	0.89%
过去六个月	-7.19%	1.83%	5.68%	0.79%	-12.87%	1.04%
过去一年	11.15%	1.49%	18.01%	0.71%	-6.86%	0.78%
过去三年	22.36%	1.59%	22.91%	0.77%	-0.55%	0.82%
自基金合同	1.34%	1.38%	4.51%	0.78%	-3.17%	0.60%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

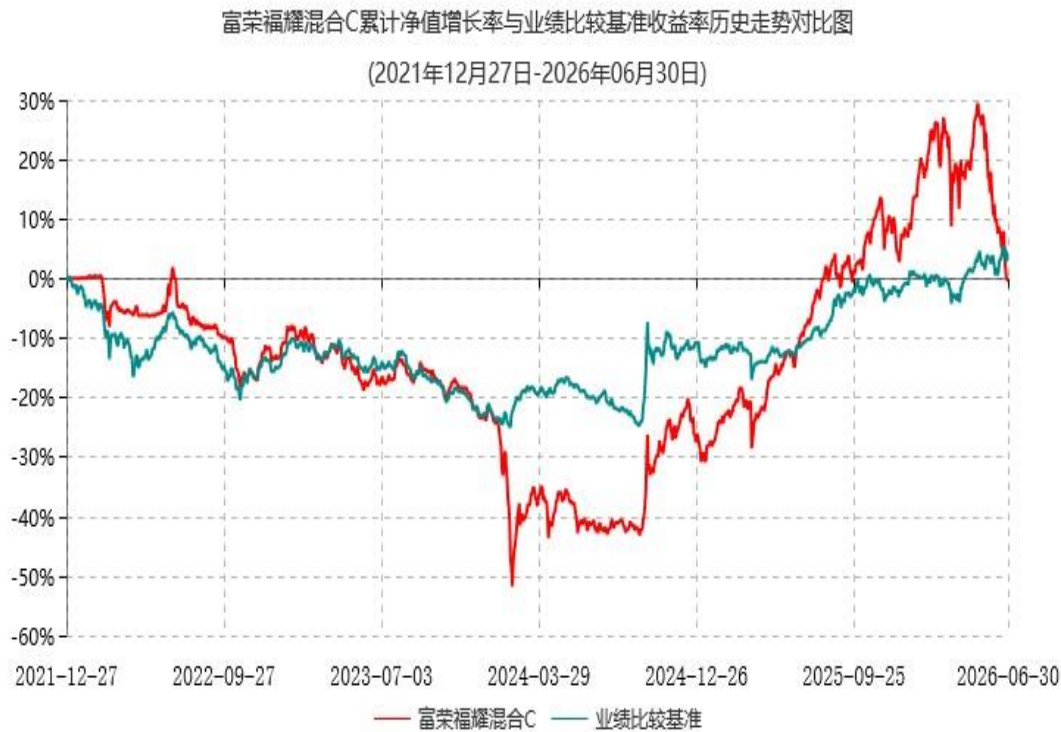
富荣福耀混合C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	-15.65%	1.77%	8.49%	0.88%	-24.14%	0.89%
过去六个月	-7.37%	1.83%	5.68%	0.79%	-13.05%	1.04%
过去一年	10.71%	1.49%	18.01%	0.71%	-7.30%	0.78%
过去三年	20.88%	1.59%	22.91%	0.77%	-2.03%	0.82%
自基金合同 生效起至今	-0.49%	1.38%	4.51%	0.78%	-5.00%	0.60%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×70%+中债综合指数收益率×30%

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





§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

富荣基金管理有限公司成立于2016年1月25日，是中国证监会批准成立的国内第101家公募基金管理公司。公司注册地为广州市南沙区，办公地位于深圳市福田区八卦岭八卦四路安吉尔大厦24楼，注册资本金人民币2亿元。富荣基金定位于“综合金融服务商”，围绕客户需求，贯彻投资人利益优先原则，秉持“规范创造价值，创新推动成长”的经营理念，努力打造企业核心竞争力，整合产业上下游资源，为各类投资者提供充分满足个性需求的产品，并以稳定、持续、优秀的投资业绩和全面、及时、优质的服务回报投资者的信任，与投资者共同分享中国经济发展的成果，致力成为受人尊重、有价值的综合金融服务企业领先者。

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		

李响	基金经理	2025-08-06	-	15.5	中国科学技术大学计算机科学与技术系硕士研究生，持有基金从业资格证书，中国国籍。曾任博时基金管理有限公司高级程序员、交银施罗德基金管理有限公司量化投资部研究员、南方基金管理有限公司信息技术部、九泰基金管理有限公司绝对收益部投资经理、基金经理、天元量化投资部基金经理、权益投资部副总监、基金经理。2025年2月加入富荣基金，现任富荣基金管理有限公司基金经理。
----	------	------------	---	------	---

注：1、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、证券从业的含义遵从《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

报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

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，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度，在研究分析、投资决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合。

公司利用统计分析的方法和工具，按照不同的时间窗口（包括当日内、3日内、5日内），对旗下所有投资组合的同向交易价差情况进行分析，报告期内未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

报告期内，国内宏观经济基本延续复苏态势，但外部环境扰动因素较多，导致整体行情波动较大。科技成长为代表的新质生产力、特别是对AI产业未来发展的预期，在维系了其间的主线行情的同时，也带来了A股行业和个股的极致分化。具体来看，在此期间沪深300上涨7.55%，中证500上涨20.97%，中证1000上涨15.99%，中证2000上涨9.10%。

从风格维度来看，成长与价值风格的收益表现同样显著分化，成长风格行情大幅跑赢价值风格。报告期内，价值风格代表的红利低波全收益指数（H20269）下跌9.23%，反观成长风格代表的创业板指和科创综指最终获取35.58%和53.99%的收益。在大小盘风格维度上，报告期内小盘风格持续弱势，特别是二季度其出现加速下跌迹象，从长期历史趋势来看，当前小盘风格的调整的幅度已处于历史高点。

期间在基金运作上，本基金采用偏量化投资策略，持仓较为分散化。在策略选股环节中结合了多因子模型与风险模型约束的结果，通过系统化的风控模型，可以对冲单一风格、单一行业波动冲击，力求持续为持有人获取稳健的超额收益。在策略选择上，本基金未来也将持续聚焦那些具备新质生产力特征、具备高弹性、高成长潜力的偏小微盘市值标的。组合在行业配置上较为分散，其中机械设备、基础化工和计算机等行业的配置比重相对较高。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富荣福耀混合A基金份额净值为1.0134元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-7.19%，同期业绩比较基准收益率为5.68%；截至报告期末富荣福耀混合C基金份额净值为0.9951元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-7.37%，同期业绩比较基准收益率为5.68%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，宏观经济大概率仍将延续复苏态势，货币政策维持适度宽松基调不变，市场流动性整体充裕，未来市场整体表现仍旧可期。但也要注意，前期极致分化的格局难以长期维系，成长风格交易拥挤度处于阶段高位，叠加动量因子运行至历史极值区间，短期市场波动可能加剧。预计调整完成后，宽基指数或呈现向好、较均衡的趋势。

风格层面，成长与价值风格剪刀差有望阶段性收敛。红利类资产在经历持续跑输后，伴随长端利率下行空间收窄，其相对性价比与防御属性将阶段性吸引资金回补；而科创成长板块长期来看景气确定性较强，在消化前期上涨过快的压力后，依旧可能有较好表现。大小盘维度，当前小盘风格已处于历史底部区域，未来有望出现修复行情。同时本

报告期动量风格走势较快且较猛，使得其快速达到历史高位区间，后续可能存在阶段性回调、消化调整的压力。

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》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人与本基金托管人一同进行,基金份额净值由本基金管理人完成估值后,经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内,公司制定了证券投资基金的估值政策和程序,并由研究部、基金事务部、监察稽核部、固定收益部及基金经理等组成了估值小组,负责研究、指导基金估值业务。估值小组成员均为公司各部门人员,均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历,且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值小组的成员,不介入基金日常估值业务,但应参加估值小组会议,可以提议测算某一投资品种的估值调整影响,并有权表决有关议案但仅享有一票表决权,从而将其影响程度进行适当限制,保证基金估值的公平、合理,保持估值政策和程序的一贯性。

报告期内,本基金未签约与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对A类、C类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；本基金各类基金份额在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。同一类别每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

截止2026年6月30日，根据上述分配原则及基金实际运作情况，本报告期末有收益分配事项。

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

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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，国泰海通证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在富荣福耀混合型证券投资基金（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，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、利润分配等情况进行了复核，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

本托管人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，认为其真实、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：富荣福耀混合型证券投资基金

报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	58,154,273.54	20,401,492.44
结算备付金		0.03	27.93
存出保证金		4,145,092.79	6,877,245.44
交易性金融资产	6.4.7.2	484,133,853.66	176,221,983.62
其中：股票投资		484,133,853.66	176,221,983.62
基金投资		-	-
债券投资		-	-

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	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		661,159.76	138,606.21
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		547,094,379.78	203,639,355.64
负债和净资产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		8,469,881.90	8,062,012.39
应付管理人报酬		289,841.66	102,722.54
应付托管费		96,613.89	34,240.86
应付销售服务费		164,066.14	66,445.45
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.5	86,284.42	165,000.91
负债合计		9,106,688.01	8,430,422.15
净资产：			

实收基金	6.4.7.6	539,129,270.26	181,660,869.88
未分配利润	6.4.7.7	-1,141,578.49	13,548,063.61
净资产合计		537,987,691.77	195,208,933.49
负债和净资产总计		547,094,379.78	203,639,355.64

注：报告截止日2026年6月30日，富荣福耀混合型证券投资基金A类基金份额净值1.0134元，富荣福耀混合型证券投资基金C类基金份额净值0.9951元，基金份额总额539,129,270.26份，其中富荣福耀混合型证券投资基金A类基金份额82,270,361.57份，富荣福耀混合型证券投资基金C类基金份额456,858,908.69份。

6.2 利润表

会计主体：富荣福耀混合型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025 年06月30日
一、营业总收入		-92,214,944.44	26,581,016.85
1.利息收入		243,464.59	62,412.61
其中：存款利息收入	6.4.7.8	243,464.59	62,412.61
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）		14,758,395.42	16,867,962.41
其中：股票投资收益	6.4.7.9	13,068,972.96	16,008,654.72
基金投资收益	6.4.7.10	-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-

贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	1,689,422.46	859,307.69
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-107,519,462.50	9,649,359.80
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	302,658.05	1,282.03
减：二、营业总支出		2,434,634.80	775,852.65
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	1,212,870.85	343,359.63
2.托管费	6.4.10.2.2	404,290.27	114,453.21
3.销售服务费	6.4.10.2.3	735,650.82	228,779.66
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	6.4.7.17	-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用	6.4.7.18	81,822.86	89,260.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-94,649,579.24	25,805,164.20
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-94,649,579.24	25,805,164.20
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-94,649,579.24	25,805,164.20

6.3 净资产变动表

会计主体：富荣福耀混合型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	181,660,869.88	13,548,063.61	195,208,933.49
二、本期期初净资产	181,660,869.88	13,548,063.61	195,208,933.49
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	357,468,400.38	-14,689,642.10	342,778,758.28
（一）、综合收益总额	-	-94,649,579.24	-94,649,579.24
（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）	357,468,400.38	79,959,937.14	437,428,337.52
其中：1.基金申购款	533,840,610.80	106,630,143.05	640,470,753.85
2.基金赎回款	-176,372,210.42	-26,670,205.91	-203,042,416.33
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	539,129,270.26	-1,141,578.49	537,987,691.77
项 目	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	146,265,714.08	-40,603,014.25	105,662,699.83
二、本期期初净资产	146,265,714.08	-40,603,014.25	105,662,699.83
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	337,654.48	25,770,501.16	26,108,155.64
（一）、综合收益总额	-	25,805,164.20	25,805,164.20
（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	337,654.48	-34,663.04	302,991.44

列)			
其中：1.基金申购款	772,501.14	-118,441.92	654,059.22
2.基金赎回款	-434,846.66	83,778.88	-351,067.78
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	146,603,368.56	-14,832,513.09	131,770,855.47

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：

杨小舟	黄文飞	黄文飞
-----	-----	-----
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

富荣福耀混合型证券投资基金（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[2021]2091号文《关于准予富荣福耀混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由基金管理人富荣基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2021年12月27日正式生效，首次设立募集规模303,889,062.73份基金份额。本基金为契约型开放式基金。本基金管理人为富荣基金管理有限公司，登记机构为富荣基金管理有限公司，基金托管人为国泰海通证券股份有限公司。

根据《富荣福耀混合型证券投资基金基金合同》和《富荣福耀混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。A类基金份额类别为在投资人认购/申购时收取认购/申购费用但不从本类别基金资产中计提销售服务费、赎回时根据持有期限收取赎回费用；C类基金份额为从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购/申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额分别计算基金份额净值。

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（含主板、创业板及其他经中国证监会允许投资的股票）、存托凭证、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、

定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金将根据法律法规的规定参与融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为60%-95%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金以后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×70%+中债综合指数收益率×30%。

本财务报表已于2026年8月28日经本基金的基金管理人批准报出。

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》、《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2026年6月30日及2025年12月31日的财务状况以及2026年1月1日至2026年6月30日和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

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

（1）增值税及附加

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令826号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告2026年第10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定：资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人。自2026年1月1日至2027年12月31日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照3%的规定征收率计算缴纳增值税；公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入免征增值税；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。

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。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按7%、3%和2%的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

（2）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部 国家税务总局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《财政部 国家税务总局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。

（3）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号《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《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《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。

（4）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‰，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；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。

（5）境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
活期存款	58,154,273.54
等于：本金	58,132,961.64
加：应计利息	21,311.90
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	58,154,273.54

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		593,308,243.57	-	484,133,853.66	-109,174,389.91
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	593,308,243.57	-	484,133,853.66	-109,174,389.91

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末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

本基金于本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	282.86
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	81,822.86
其他应付	4,178.70
合计	86,284.42

6.4.7.6 实收基金

6.4.7.6.1 富荣福耀混合A

金额单位：人民币元

项目 (富荣福耀混合A)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,275,179.14	3,275,179.14
本期申购	84,341,913.40	84,341,913.40
本期赎回（以“-”号填列）	-5,346,730.97	-5,346,730.97
本期末	82,270,361.57	82,270,361.57

6.4.7.6.2 富荣福耀混合C

金额单位：人民币元

项目 (富荣福耀混合C)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	178,385,690.74	178,385,690.74
本期申购	449,498,697.40	449,498,697.40
本期赎回（以“-”号填列）	-171,025,479.45	-171,025,479.45
本期末	456,858,908.69	456,858,908.69

注：申购含红利再投及转换入份额及金额；赎回含转换出份额及金额。

6.4.7.7 未分配利润

6.4.7.7.1 富荣福耀混合A

单位：人民币元

项目 (富荣福耀混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	259,324.51	41,503.45	300,827.96
本期期初	259,324.51	41,503.45	300,827.96
本期利润	-1,357,611.30	-15,299,172.08	-16,656,783.38
本期基金份额交易产生的变动数	15,781,915.79	1,674,939.04	17,456,854.83
其中：基金申购款	16,798,886.01	1,405,654.22	18,204,540.23
基金赎回款	-1,016,970.22	269,284.82	-747,685.40
本期已分配利润	-	-	-

本期末	14,683,629.00	-13,582,729.59	1,100,899.41
-----	---------------	----------------	--------------

6.4.7.7.2 富荣福耀混合C

单位：人民币元

项目 (富荣福耀混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	11,047,945.56	2,199,290.09	13,247,235.65
本期期初	11,047,945.56	2,199,290.09	13,247,235.65
本期利润	14,227,494.56	-92,220,290.42	-77,992,795.86
本期基金份额交易产生的变动数	46,590,484.93	15,912,597.38	62,503,082.31
其中：基金申购款	76,407,868.35	12,017,734.47	88,425,602.82
基金赎回款	-29,817,383.42	3,894,862.91	-25,922,520.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	71,865,925.05	-74,108,402.95	-2,242,477.90

6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
活期存款利息收入	237,882.04
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	0.03
其他	5,582.52
合计	243,464.59

注：其他为券商保证金利息收入与应收申购款利息收入。

6.4.7.9 股票投资收益

6.4.7.9.1 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01月01日至2026年06月30日
卖出股票成交总额	1,649,025,000.06
减：卖出股票成本总额	1,633,246,478.63
减：交易费用	2,709,548.47
买卖股票差价收入	13,068,972.96

6.4.7.10 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,689,422.46
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	1,689,422.46

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
1.交易性金融资产	-107,519,462.50
——股票投资	-107,519,462.50

——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——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	-107,519,462.50

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
基金赎回费收入	302,126.42
转换费收入	531.63
合计	302,658.05

注：本基金的A类基金份额、C类基金份额的赎回费率按基金份额持有期限递减，就A类基金份额，对持续持有期少于30日的投资人收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期不少于30日但少于3个月的投资人收取的赎回费总额的75%计入基金财产；对持续持有期不少于3个月但少于6个月的投资人收取的赎回费总额的50%计入基金财产；就C类基金份额，收取的赎回费全额计入基金财产。

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
----	-------------------------------

审计费用	22,315.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
合计	81,822.86

6.4.7.19 分部报告

截至本报告期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

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，本基金无需作披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
富荣基金管理有限公司	基金管理人、注册登记人、基金销售机构
国泰海通证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日	
	成交金额	占当期	成交金额	占当期

		股票成交总额的比例		股票成交总额的比例
国泰海通证券股份有限公司	335,277,024.61	9.07%	304,678,656.67	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 基金交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的基金交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰海通证券股份有限公司	210,387.28	12.77%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰海通	195,934.24	100.00%	-	-

证券股份 有限公司				
--------------	--	--	--	--

注：（1）上述佣金按协议约定的佣金费率计算，佣金费率由协议签订方参考市场价格确定。

（2）该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（证监会公告[2024]3号），自2024年7月1日起，针对被动股票型基金，不再通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；针对其他类型基金，不再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01月01日至20 26年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至20 25年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,212,870.85	343,359.63
其中：应支付销售机构的客户维护费	231,070.96	247.73
应支付基金管理人的净管理费	981,799.89	343,111.90

注：基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的0.60%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026 年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	404,290.27	114,453.21

注：基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H=E\times0.20\%\div\text{当年天数}$
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2026年01月01日至2026年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富荣福耀混合A	富荣福耀混合C	合计
富荣基金管理有限公司	0.00	417,972.40	417,972.40
国泰海通证券股份有限公司	0.00	206.94	206.94
合计	0.00	418,179.34	418,179.34
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2025年01月01日至2025年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富荣福耀混合A	富荣福耀混合C	合计
富荣基金管理有限公司	0.00	228,575.96	228,575.96
国泰海通证券股份有限公司	0.00	5.43	5.43
合计	0.00	228,581.39	228,581.39

注：基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。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按前一日C类基金资产净值的0.40%年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$H=E\times0.40\%\div\text{当年天数}$
H为C类基金份额每日应计提的销售服务费
E为前一日C类基金份额的基金资产净值

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

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（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

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

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

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

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

本报告期内及上年度可比期间基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
国泰海通证券股份有限公司	58,154,273.54	237,882.04	5,000,402.66	37,445.53

注：本基金的银行存款由基金托管人国泰海通证券股份有限公司转存于交通银行股份有限公司上海交银大厦支行，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未发生在承销期内参与关联方承销的证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金于本期及上年度可比期间均无需说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金于本报告期内无利润分配。

6.4.12 期末（2026年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
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
688797	臻宝科技	2026-06-16	6个月	科创板打新限售	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
001399	惠科股份	2026-06-16	6个月	新股锁定	10.12	27.73	3,471	35,126.52	96,250.83	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6个月	科创板打新限售	19.68	141.49	468	9,210.24	66,217.32	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6个月	科创板打新限售	26.28	172.09	230	6,044.40	39,580.70	-
001257	盛龙股份	2026-03-24	6个月	新股锁定	7.82	20.74	1,258	9,837.56	26,090.92	-
688811	有研复材	2026-04-01	6个月	科创板打新限售	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
001365	天海电子	2026-05-11	6个月	新股锁定	27.19	31.31	444	12,072.36	13,901.64	-
001393	维通利	2026-05-08	6个月	新股锁定	30.38	38.99	312	9,478.56	12,164.88	-
001237	惠康科技	2026-05-15	6个月	新股锁定	53.26	58.74	179	9,533.54	10,514.46	-
301683	慧谷新材	2026-03-24	6个月	创业板打新限售	78.38	121.77	69	5,408.22	8,402.13	-
301513	尚水智能	2026-04-10	6个月	创业板打新限售	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6个月	新股锁定	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
001312	福恩股份	2026-04-14	6个月	新股锁定	18.38	16.78	117	2,150.46	1,963.26	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6个月	新股锁定	33.49	33.93	51	1,707.99	1,730.43	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
603137	恒尚节能	2026-06-16	-	12.94	2026-07-01	14.23	22,900	287,041.18	296,326.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，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，本基金无因从事证券交易所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

本基金本报告期末无参与转融通出借业务的证券。

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

本基金为混合型证券投资基金，其预期风险收益水平高于债券型基金及货币市场基金，低于股票型基金。本基金投资于基金合同和相关法律法规及监管机构允许范围内的投资品种。本基金在日常经营活动面临的与这些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。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。

本基金的基金管理人建立了董事会领导，以风险控制委员会为核心的，由督察长、经理层、监察稽核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奉行全面风险管理体系的建设，董事会负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任；在董事会下设立风险控制委员会，负责对公司经营管理和基金投资业务进行合规性控制，并对公司内部稽核审计工作进行审核监督；督察长独立行使督察权利，负责公司及其基金运作的监察稽核工作，直接对董事会负责；经理层下设投资决策委员会、风险管理委员会、IT治理委员会、产品委员会、专户业务评审委员会、固有资

金投资决策委员会、估值委员会等，协助总经理对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和防控。

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建立了内部评级体系和交易对手库，对投资品种进行内部评级并分散化投资，对交易对手实行准入和分级管理，以控制相应的信用风险。

于2026年6月30日，本基金未持有债券和资产支持证券。（2025年12月31日：同）

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

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。

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模式带来的流动性风险，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，除在本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中列示的部分基金资产流通暂时受限制外，其余均能及时变现。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。除本报告“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”章节中列示的卖出回购金融资产款余额将在1个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

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未来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度缺口进行监控，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	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
-----	------	------	------	-----	----

2026年06月30日					
资产					
货币资金	58,154,273.54	-	-	-	58,154,273.54
结算备付金	0.03	-	-	-	0.03
存出保证金	4,145,092.79	-	-	-	4,145,092.79
交易性金融资产	-	-	-	484,133,853.66	484,133,853.66
应收申购款	-	-	-	661,159.76	661,159.76
资产总计	62,299,366.36	-	-	484,795,013.42	547,094,379.78
负债					
应付赎回款	-	-	-	8,469,881.90	8,469,881.90
应付管理人报酬	-	-	-	289,841.66	289,841.66
应付托管费	-	-	-	96,613.89	96,613.89
应付销售服务费	-	-	-	164,066.14	164,066.14
其他负债	-	-	-	86,284.42	86,284.42
负债总计	-	-	-	9,106,688.01	9,106,688.01
利率敏感度缺口	62,299,366.36	-	-	不适用	不适用
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	20,401,492.44	-	-	-	20,401,492.44
结算备付金	27.93	-	-	-	27.93
存出保证金	6,877,245.44	-	-	-	6,877,245.44
交易性金融资产	-	-	-	176,221,983.62	176,221,983.62
应收申购款	-	-	-	138,606.21	138,606.21
资产总计	27,278,765.81	-	-	176,360,589.83	203,639,355.64
负债					
应付赎回款	-	-	-	8,062,012.39	8,062,012.39
应付管理人报酬	-	-	-	102,722.54	102,722.54
应付托管费	-	-	-	34,240.86	34,240.86
应付销售服务费	-	-	-	66,445.45	66,445.45
其他负债	-	-	-	165,000.91	165,000.91
负债总计	-	-	-	8,430,422.15	8,430,422.15
利率敏感度缺口	27,278,765.81	-	-	不适用	不适用

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2026年6月30日，本基金未持有交易性债券投资和交易性资产支持证券投资（2025年12月31日：同），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（2025年12月31日：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。本基金持有的金融工具均以人民币计价，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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产 — 股票投资	484,133,853.66	89.99	176,221,983.62	90.27
交易性金融资产 — 基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产 — 债券投资	-	-	-	-
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	484,133,853.66	89.99	176,221,983.62	90.27

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。下表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
	基金业绩比较基准上升5%	23,621,491.66	10,912,980.13
	基金业绩比较基准下降5%	-23,621,491.66	-10,912,980.13

注：基金业绩比较基准＝沪深300指数收益率×70%+中债综合指数收益率×30%。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	483,431,681.66	176,221,983.62
第二层次	296,326.00	-
第三层次	405,846.00	-

合计	484,133,853.66	176,221,983.62
----	----------------	----------------

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于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	484,133,853.66	88.49
	其中：股票	484,133,853.66	88.49
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-

6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	58,154,273.57	10.63
8	其他各项资产	4,806,252.55	0.88
9	合计	547,094,379.78	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

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	6,612,200.00	1.23
B	采矿业	510,394.92	0.09
C	制造业	281,132,971.37	52.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	484,385.00	0.09
E	建筑业	6,897,860.00	1.28
F	批发和零售业	35,391,787.00	6.58
G	交通运输、仓储和邮政业	5,862,253.00	1.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	41,294,571.99	7.68
J	金融业	-	-
K	房地产业	17,358,435.44	3.23
L	租赁和商务服务业	490,543.00	0.09
M	科学研究和技术服务业	52,427,416.50	9.75
N	水利、环境和公共设施管理业	24,117,977.13	4.48
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	5,698,620.00	1.06
Q	卫生和社会工作	5,854,438.31	1.09
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	484,133,853.66	89.99

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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

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	300823	建科智能	405,500	5,912,190.00	1.10
2	688573	信宇人	332,444	5,890,907.68	1.09
3	300517	海波重科	622,600	5,864,892.00	1.09
4	688217	睿昂基因	281,424	5,814,219.84	1.08
5	688638	誉辰智能	186,242	5,805,163.14	1.08
6	688681	科汇股份	415,193	5,804,398.14	1.08
7	300169	天晟新材	1,162,900	5,802,871.00	1.08
8	300417	南华仪器	565,400	5,801,004.00	1.08
9	300635	中达安	475,600	5,788,052.00	1.08
10	603879	永悦科技	1,279,955	5,785,396.60	1.08
11	300074	华平股份	1,697,700	5,772,180.00	1.07
12	688118	普元信息	286,785	5,770,114.20	1.07
13	688296	和达科技	503,640	5,761,641.60	1.07
14	603860	中公高科	237,900	5,754,801.00	1.07
15	688021	奥福科技	297,059	5,751,062.24	1.07
16	300949	奥雅股份	285,050	5,749,458.50	1.07
17	603041	美思德	554,400	5,749,128.00	1.07
18	300564	筑博设计	477,600	5,735,976.00	1.07
19	002715	登云股份	432,800	5,734,600.00	1.07
20	688701	卓锦股份	760,818	5,728,959.54	1.06
21	600303	曙光股份	2,297,700	5,721,273.00	1.06
22	688793	倍轻松	354,703	5,714,265.33	1.06
23	688058	宝兰德	273,096	5,713,168.32	1.06

24	300549	优德精密	438,750	5,712,525.00	1.06
25	002513	蓝丰生化	1,194,400	5,709,232.00	1.06
26	688528	秦川物联	624,602	5,708,862.28	1.06
27	002591	恒大高新	931,800	5,702,616.00	1.06
28	001336	楚环科技	258,800	5,698,776.00	1.06
29	600455	博通股份	259,500	5,698,620.00	1.06
30	300851	交大思诺	256,100	5,698,225.00	1.06
31	688565	力源科技	602,882	5,697,234.90	1.06
32	300675	建科院	480,000	5,688,000.00	1.06
33	300614	百川畅银	587,400	5,686,032.00	1.06
34	002820	桂发祥	676,300	5,680,920.00	1.06
35	688393	安必平	319,450	5,679,821.00	1.06
36	300405	科隆股份	1,096,010	5,677,331.80	1.06
37	600778	友好集团	1,160,500	5,674,845.00	1.05
38	600692	亚通股份	1,042,100	5,658,603.00	1.05
39	002494	华斯股份	1,274,200	5,657,448.00	1.05
40	000637	茂化实华	1,616,200	5,656,700.00	1.05
41	000663	永安林业	1,108,800	5,654,880.00	1.05
42	301167	建研设计	456,200	5,652,318.00	1.05
43	003003	天元股份	567,600	5,647,620.00	1.05
44	600444	国机通用	435,100	5,647,598.00	1.05
45	002949	华阳国际	571,000	5,647,190.00	1.05
46	600883	博闻科技	805,800	5,640,600.00	1.05
47	600706	曲江文旅	837,700	5,637,721.00	1.05
48	603214	爱婴室	465,200	5,633,572.00	1.05
49	603506	南都物业	602,866	5,630,768.44	1.05
50	603709	中源家居	415,800	5,629,932.00	1.05
51	603022	新通联	704,600	5,629,754.00	1.05
52	688067	爱威科技	279,363	5,629,164.45	1.05
53	605122	四方新材	521,500	5,621,770.00	1.04
54	603900	莱绅通灵	998,500	5,621,555.00	1.04

54	300640	德艺文创	998,500	5,621,555.00	1.04
55	600561	江西长运	1,135,200	5,619,240.00	1.04
56	600697	欧亚集团	577,900	5,617,188.00	1.04
57	600099	林海股份	703,700	5,615,526.00	1.04
58	002873	新天药业	766,900	5,613,708.00	1.04
59	300500	启迪设计	635,700	5,613,231.00	1.04
60	001366	播恩集团	517,800	5,612,952.00	1.04
61	002622	皓宸医疗	2,711,500	5,612,805.00	1.04
62	300645	正元智慧	476,800	5,611,936.00	1.04
63	002105	信隆健康	1,135,200	5,607,888.00	1.04
64	002529	海源复材	822,000	5,606,040.00	1.04
65	600128	苏豪弘业	737,300	5,596,107.00	1.04
66	301049	超越科技	313,300	5,595,538.00	1.04
67	603536	惠发食品	717,000	5,585,430.00	1.04
68	603908	牧高笛	330,880	5,585,254.40	1.04
69	002133	广宇集团	2,335,200	5,581,128.00	1.04
70	605567	春雪食品	696,000	5,561,040.00	1.03
71	301126	达嘉维康	650,200	5,559,210.00	1.03
72	300030	阳普医疗	955,200	5,549,712.00	1.03
73	000953	中哲精化	1,075,400	5,549,064.00	1.03
74	000952	广济药业	1,018,080	5,517,993.60	1.03
75	688051	佳华科技	239,949	5,514,028.02	1.02
76	688329	艾隆科技	272,057	5,498,271.97	1.02
77	300694	蠡湖股份	482,600	4,632,960.00	0.86
78	301505	苏州规划	231,900	3,733,590.00	0.69
79	001231	农心科技	176,600	3,221,184.00	0.60
80	301192	泰祥股份	153,600	2,903,040.00	0.54
81	603183	建研院	654,700	2,324,185.00	0.43
82	002817	黄山胶囊	220,000	1,289,200.00	0.24
83	603137	恒尚节能	22,900	296,326.00	0.06
84	688670	金迪克	16,270	275,613.80	0.05

85	300838	浙江力诺	19,600	261,660.00	0.05
86	603177	德创环保	31,400	259,678.00	0.05
87	300923	研奥股份	11,600	258,448.00	0.05
88	301355	南王科技	26,300	257,214.00	0.05
89	688078	龙软科技	12,031	253,252.55	0.05
90	688395	正弦电气	11,427	252,536.70	0.05
91	301390	经纬股份	7,800	251,628.00	0.05
92	002760	凤形股份	15,300	251,226.00	0.05
93	688659	元琛科技	24,015	250,716.60	0.05
94	300112	万讯自控	40,300	249,457.00	0.05
95	300176	鸿特科技	51,300	248,805.00	0.05
96	301098	金埔园林	30,300	248,460.00	0.05
97	300778	新城市	26,000	248,300.00	0.05
98	300605	恒锋信息	26,800	247,632.00	0.05
99	688092	爱科科技	11,658	247,615.92	0.05
100	301010	晶雪节能	15,200	247,608.00	0.05
101	688695	中创股份	13,241	247,606.70	0.05
102	603810	丰山集团	22,200	247,086.00	0.05
103	301272	英华特	7,500	247,050.00	0.05
104	300612	宣亚国际	22,600	247,018.00	0.05
105	300514	友讯达	26,400	246,840.00	0.05
106	688616	西力科技	24,432	246,763.20	0.05
107	300886	华业香料	12,400	246,760.00	0.05
108	301063	海锅股份	14,700	246,372.00	0.05
109	300126	锐奇股份	42,600	246,228.00	0.05
110	001278	一彬科技	16,000	246,080.00	0.05
111	002316	亚联发展	60,600	246,036.00	0.05
112	002188	中天服务	50,200	245,980.00	0.05
113	300621	维业股份	38,700	245,745.00	0.05
114	000633	合金投资	51,600	245,616.00	0.05
115	300535	达威股份	18,000	245,340.00	0.05

116	688288	鸿泉技术	13,805	245,314.85	0.05
117	000856	冀东装备	34,300	245,245.00	0.05
118	002828	贝肯能源	23,200	245,224.00	0.05
119	603208	江山欧派	22,900	245,030.00	0.05
120	688004	博汇科技	13,458	244,935.60	0.05
121	600149	廊坊发展	54,500	244,705.00	0.05
122	605177	东亚药业	14,300	244,673.00	0.05
123	301359	东南电子	15,400	244,552.00	0.05
124	603073	彩蝶实业	16,400	244,524.00	0.05
125	603968	醋化股份	26,400	244,464.00	0.05
126	301429	森泰股份	15,600	244,452.00	0.05
127	301113	雅艺科技	16,388	244,345.08	0.05
128	301037	保立佳	20,360	244,320.00	0.05
129	002679	福建金森	31,000	244,280.00	0.05
130	301131	聚赛龙	7,600	244,188.00	0.05
131	002205	国统股份	24,200	244,178.00	0.05
132	300220	金运激光	23,500	244,165.00	0.05
133	001260	坤泰股份	15,600	244,140.00	0.05
134	600241	时代万恒	37,600	244,024.00	0.05
135	301163	宏德股份	11,000	243,980.00	0.05
136	002247	聚力文化	115,600	243,916.00	0.05
137	600287	苏豪时尚	55,300	243,873.00	0.05
138	300899	上海凯鑫	8,800	243,672.00	0.05
139	301515	港通医疗	13,900	243,667.00	0.05
140	301065	本立科技	13,800	243,570.00	0.05
141	300947	德必集团	19,100	243,525.00	0.05
142	600802	福建水泥	59,100	243,492.00	0.05
143	000985	大庆华科	17,100	243,333.00	0.05
144	603029	天鹅股份	17,300	243,238.00	0.05
145	000702	正虹科技	49,000	243,040.00	0.05
146	300240	飞力达	48,700	243,013.00	0.05

147	003042	中农联合	20,000	243,000.00	0.05
148	301298	东利机械	21,000	242,970.00	0.05
149	600097	开创国际	31,200	242,736.00	0.05
150	002495	佳隆股份	118,400	242,720.00	0.05
151	301001	凯淳股份	11,200	242,704.00	0.05
152	300958	建工修复	22,800	242,592.00	0.05
153	301288	清研环境	14,100	242,520.00	0.05
154	600159	大龙地产	109,700	242,437.00	0.05
155	301539	宏鑫科技	18,500	242,350.00	0.05
156	301006	迈拓股份	19,300	242,215.00	0.05
157	002696	百洋股份	48,700	242,039.00	0.04
158	300929	华骐环保	22,960	241,998.40	0.04
159	002802	洪汇新材	23,000	241,960.00	0.04
160	002968	新大正	28,600	241,956.00	0.04
161	301519	舜禹股份	22,300	241,955.00	0.04
162	002809	红墙股份	32,500	241,800.00	0.04
163	000757	浩物股份	70,900	241,769.00	0.04
164	003011	海象新材	13,300	241,661.00	0.04
165	002524	光正眼科	73,001	241,633.31	0.04
166	000929	兰州黄河	27,600	241,500.00	0.04
167	600448	华纺股份	95,800	241,416.00	0.04
168	603282	亚光股份	16,900	241,163.00	0.04
169	603385	惠达卫浴	49,400	241,072.00	0.04
170	002999	天禾股份	45,300	240,996.00	0.04
171	600051	宁波联合	42,800	240,964.00	0.04
172	688613	奥精医疗	17,061	240,730.71	0.04
173	003008	开普检测	14,100	240,687.00	0.04
174	603151	邦基科技	21,900	240,681.00	0.04
175	002909	集泰股份	48,700	240,578.00	0.04
176	600202	哈空调	53,700	240,576.00	0.04
177	002486	嘉麟杰	112,400	240,536.00	0.04

178	300892	品渥食品	12,800	240,384.00	0.04
179	002144	宏达高科	24,400	240,340.00	0.04
180	688089	ST嘉必优	22,645	240,263.45	0.04
181	600235	民丰特纸	48,300	240,051.00	0.04
182	688466	金科环境	18,693	239,831.19	0.04
183	603168	莎普爱思	50,800	239,776.00	0.04
184	000605	渤海股份	44,800	239,680.00	0.04
185	603182	嘉华股份	21,000	239,400.00	0.04
186	002743	富煌钢构	62,000	239,320.00	0.04
187	300268	佳沃食品	23,400	239,148.00	0.04
188	002629	仁智股份	55,600	239,080.00	0.04
189	603028	赛福天	36,900	238,743.00	0.04
190	600137	浪莎股份	14,707	238,694.61	0.04
191	600689	上海三毛	24,600	238,620.00	0.04
192	600493	凤竹纺织	45,500	238,420.00	0.04
193	300642	透景生命	20,200	238,360.00	0.04
194	600371	万向德农	38,100	238,125.00	0.04
195	600774	汉商集团	38,000	237,880.00	0.04
196	301130	西点药业	9,900	237,402.00	0.04
197	300519	新光药业	20,000	237,000.00	0.04
198	603717	天域生物	40,100	232,179.00	0.04
199	300597	吉大通信	30,200	213,816.00	0.04
200	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.02
201	001399	惠科股份	3,471	96,250.83	0.02
202	688820	盛合晶微	468	66,217.32	0.01
203	002732	燕塘乳业	4,100	50,840.00	0.01
204	688813	泰金新能	230	39,580.70	0.01
205	001257	盛龙股份	1,258	26,090.92	0.00
206	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
207	001365	天海电子	444	13,901.64	0.00
208	001393	维通利	312	12,164.88	0.00

209	001237	惠康科技	179	10,514.46	0.00
210	301683	慧谷新材	69	8,402.13	0.00
211	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
212	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
213	001312	福恩股份	117	1,963.26	0.00
214	603293	埃泰克	51	1,730.43	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	002780	三夫户外	30,530,766.00	15.64
2	002817	黄山胶囊	29,324,717.32	15.02
3	600303	曙光股份	29,244,491.00	14.98
4	300517	海波重科	22,856,065.60	11.71
5	001366	播恩集团	21,903,937.36	11.22
6	000952	广济药业	20,504,904.20	10.50
7	300074	华平股份	20,486,966.00	10.49
8	002591	恒大高新	20,335,625.00	10.42
9	300923	研奥股份	19,152,960.00	9.81
10	688329	艾隆科技	18,966,389.99	9.72
11	003003	天元股份	18,678,957.00	9.57
12	002513	蓝丰生化	18,534,707.00	9.49
13	002910	庄园牧场	18,426,981.00	9.44
14	002687	乔治白	18,308,542.42	9.38
15	600099	林海股份	18,282,041.00	9.37
16	300556	丝路视觉	18,266,074.99	9.36
17	688638	誉辰智能	17,887,520.85	9.16
18	600561	江西长运	17,435,839.00	8.93

19	600128	苏豪弘业	17,411,658.00	8.92
20	600768	宁波富邦	17,072,214.00	8.75
21	300030	阳普医疗	17,054,132.00	8.74
22	688118	普元信息	16,894,928.02	8.65
23	001231	农心科技	16,139,990.45	8.27
24	688058	宝兰德	16,073,623.83	8.23
25	603022	新通联	15,896,250.00	8.14
26	002760	凤形股份	15,583,280.92	7.98
27	002486	嘉麟杰	15,293,205.00	7.83
28	300823	建科智能	14,881,931.60	7.62
29	300519	新光药业	14,783,165.00	7.57
30	600444	国机通用	14,777,183.00	7.57
31	603818	曲美家居	14,589,764.00	7.47
32	688426	康为世纪	14,567,384.62	7.46
33	688296	和达科技	14,478,635.01	7.42
34	600847	万里股份	14,363,267.95	7.36
35	688793	倍轻松	14,348,178.74	7.35
36	603709	中源家居	14,219,653.28	7.28
37	301336	趣睡科技	14,043,483.00	7.19
38	002524	光正眼科	13,930,353.84	7.14
39	300635	中达安	13,876,407.00	7.11
40	300417	南华仪器	13,874,708.62	7.11
41	300176	鸿特科技	13,766,700.00	7.05
42	002858	力盛体育	13,643,364.00	6.99
43	000702	正虹科技	13,459,742.00	6.90
44	603073	彩蝶实业	13,296,400.00	6.81
45	600778	友好集团	13,257,638.00	6.79
46	600051	宁波联合	13,207,028.00	6.77
47	600159	大龙地产	13,073,061.00	6.70
48	300564	筑博设计	12,833,574.00	6.57
49	301030	*ST仕净	12,608,428.00	6.46

50	603536	惠发食品	12,594,715.00	6.45
51	002495	佳隆股份	12,413,075.50	6.36
52	603214	爱婴室	12,357,895.00	6.33
53	300169	天晟新材	12,216,777.00	6.26
54	688573	信宇人	11,997,071.65	6.15
55	000663	永安林业	11,881,405.00	6.09
56	688051	佳华科技	11,747,711.11	6.02
57	000637	茂化实华	11,691,047.00	5.99
58	300549	优德精密	11,672,044.50	5.98
59	301024	霍普股份	11,470,308.50	5.88
60	603900	莱绅通灵	11,310,250.00	5.79
61	300851	交大思诺	11,276,286.00	5.78
62	003011	海象新材	11,197,463.48	5.74
63	300694	蠡湖股份	11,116,038.00	5.69
64	002968	新大正	11,040,719.00	5.66
65	688193	仁度生物	10,934,084.71	5.60
66	300614	百川畅银	10,853,874.00	5.56
67	600697	欧亚集团	10,777,772.00	5.52
68	600493	凤竹纺织	10,705,489.00	5.48
69	688021	奥福科技	10,673,572.23	5.47
70	301131	聚赛龙	10,584,167.16	5.42
71	300929	华骐环保	10,583,214.80	5.42
72	605567	春雪食品	10,484,010.00	5.37
73	603356	华菱精工	10,405,698.00	5.33
74	603041	美思德	10,355,905.00	5.31
75	603182	嘉华股份	10,346,066.47	5.30
76	002247	聚力文化	10,189,110.00	5.22
77	301049	超越科技	9,791,217.00	5.02
78	300500	启迪设计	9,504,840.00	4.87
79	301192	泰祥股份	9,466,390.83	4.85
80	688156	路德科技	9,390,068.75	4.81

81	300305	裕兴股份	9,365,558.00	4.80
82	002999	天禾股份	9,355,597.60	4.79
83	600671	天目药业	9,094,304.98	4.66
84	300535	达威股份	9,093,761.98	4.66
85	300717	华信新材	9,017,255.00	4.62
86	002319	乐通股份	8,960,332.00	4.59
87	301163	宏德股份	8,891,531.00	4.55
88	688004	博汇科技	8,863,267.18	4.54
89	603879	永悦科技	8,733,733.80	4.47
90	300405	科隆股份	8,712,416.90	4.46
91	600706	曲江文旅	8,580,729.00	4.40
92	300645	正元智慧	8,430,378.00	4.32
93	002715	登云股份	8,428,657.00	4.32
94	002133	广宇集团	8,381,108.00	4.29
95	002778	中晟高科	8,368,608.00	4.29
96	688393	安必平	8,343,662.75	4.27
97	300949	奥雅股份	8,336,650.60	4.27
98	002820	桂发祥	8,331,205.00	4.27
99	603506	南都物业	8,324,893.42	4.26
100	300670	大烨智能	8,299,178.26	4.25
101	688528	秦川物联	8,209,014.44	4.21
102	600137	浪莎股份	8,177,662.08	4.19
103	000692	惠天热电	8,164,605.00	4.18
104	002622	皓宸医疗	8,164,251.00	4.18
105	002105	信隆健康	8,163,784.00	4.18
106	603908	牧高笛	8,158,354.60	4.18
107	301126	达嘉维康	8,128,452.00	4.16
108	300675	建科院	8,081,435.00	4.14
109	605122	四方新材	8,074,648.00	4.14
110	603183	建研院	8,014,325.80	4.11
111	603860	中公高科	7,987,631.40	4.09

112	002873	新天药业	7,977,979.00	4.09
113	600455	博通股份	7,933,875.00	4.06
114	600883	博闻科技	7,884,873.00	4.04
115	000757	浩物股份	7,873,539.00	4.03
116	000953	中哲精化	7,840,836.00	4.02
117	301006	迈拓股份	7,777,930.00	3.98
118	301113	雅艺科技	7,601,941.58	3.89
119	603028	赛福天	7,510,992.00	3.85
120	001336	楚环科技	7,469,566.00	3.83
121	003030	祖名股份	7,365,409.00	3.77
122	000955	欣龙控股	7,278,619.00	3.73
123	000590	古汉医药	7,217,648.00	3.70
124	300612	宣亚国际	7,172,969.00	3.67
125	688517	金冠电气	7,166,135.51	3.67
126	300605	恒锋信息	7,081,070.00	3.63
127	300707	威唐工业	7,005,266.00	3.59
128	603717	天域生物	6,984,622.60	3.58
129	300845	捷安高科	6,983,466.00	3.58
130	300665	飞鹿股份	6,963,516.84	3.57
131	600689	上海三毛	6,937,697.00	3.55
132	300883	龙利得	6,927,482.00	3.55
133	688217	睿昂基因	6,867,814.01	3.52
134	603880	南卫股份	6,817,501.44	3.49
135	300163	先锋新材	6,814,304.00	3.49
136	688701	卓锦股份	6,732,549.65	3.45
137	002848	高斯贝尔	6,590,641.00	3.38
138	000610	*ST西旅	6,543,599.00	3.35
139	002316	亚联发展	6,529,327.00	3.34
140	603335	迪生力	6,461,797.00	3.31
141	688565	力源科技	6,429,666.22	3.29
142	688681	科汇股份	6,397,938.31	3.28

143	688121	*ST卓然	6,380,152.77	3.27
144	300640	德艺文创	6,375,682.00	3.27
145	002529	海源复材	6,349,960.00	3.25
146	002188	中天服务	6,338,058.00	3.25
147	002084	海鸥住工	6,295,961.00	3.23
148	002949	华阳国际	6,291,526.00	3.22
149	002828	贝肯能源	6,263,409.00	3.21
150	301231	荣信文化	6,219,413.00	3.19
151	688067	爱威科技	6,145,663.39	3.15
152	301167	建研设计	6,145,102.11	3.15
153	002719	ST麦趣	6,077,313.60	3.11
154	300295	*ST三六	6,056,187.00	3.10
155	600692	亚通股份	6,017,425.00	3.08
156	002494	华斯股份	5,984,869.00	3.07
157	688671	碧兴物联	5,970,923.74	3.06
158	001259	利仁科技	5,860,131.00	3.00
159	688659	元琛科技	5,788,980.12	2.97
160	600543	*ST莫高	5,725,981.00	2.93
161	301390	经纬股份	5,705,261.00	2.92
162	688189	ST南新	5,677,123.03	2.91
163	688395	正弦电气	5,628,682.66	2.88
164	002694	*ST顾地	5,612,953.00	2.88
165	003008	开普检测	5,430,820.10	2.78
166	002856	*ST美芝	5,275,341.96	2.70
167	300649	杭州园林	5,271,923.00	2.70
168	605177	东亚药业	5,242,217.00	2.69
169	688092	爱科科技	5,073,801.08	2.60
170	300103	达刚控股	5,001,829.00	2.56
171	688056	莱伯泰科	4,968,952.73	2.55
172	600719	大连热电	4,933,570.00	2.53
173	688038	中科通达	4,910,168.12	2.52

174	300422	博世科	4,908,053.00	2.51
175	002193	ST如意	4,886,370.00	2.50
176	300371	汇中股份	4,821,395.00	2.47
177	000056	*ST皇庭	4,759,731.00	2.44
178	300838	浙江力诺	4,665,381.00	2.39
179	688420	美腾科技	4,585,096.79	2.35
180	301372	科净源	4,506,683.24	2.31
181	002963	豪尔赛	4,459,502.00	2.28
182	300385	ST雪浪	4,318,384.76	2.21
183	002883	*ST中设	4,303,416.00	2.20
184	001211	双枪科技	4,296,176.00	2.20
185	300106	西部牧业	4,251,705.00	2.18
186	603729	ST龙韵	4,207,026.60	2.16
187	301130	西点药业	4,155,405.00	2.13
188	301139	*ST元道	4,135,030.16	2.12
189	002799	环球印务	4,126,967.00	2.11
190	301037	保立佳	3,950,078.00	2.02

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	002780	三夫户外	32,690,413.51	16.75
2	002817	黄山胶囊	28,104,311.24	14.40
3	600303	曙光股份	22,831,876.80	11.70
4	300556	丝路视觉	20,327,274.00	10.41
5	002687	乔治白	20,231,340.40	10.36
6	001366	播恩集团	19,024,586.00	9.75
7	300923	研奥股份	18,166,601.80	9.31

8	002910	庄园牧场	17,739,983.00	9.09
9	600768	宁波富邦	16,803,230.00	8.61
10	002591	恒大高新	16,350,103.00	8.38
11	300517	海波重科	16,308,679.00	8.35
12	688329	艾隆科技	15,905,187.06	8.15
13	600847	万里股份	15,856,218.60	8.12
14	603818	曲美家居	15,803,756.00	8.10
15	002524	光正眼科	15,779,417.00	8.08
16	002760	凤形股份	15,761,558.26	8.07
17	002858	力盛体育	15,610,056.00	8.00
18	603073	彩蝶实业	15,425,202.00	7.90
19	688426	康为世纪	15,277,798.19	7.83
20	002486	嘉麟杰	14,852,359.00	7.61
21	000702	正虹科技	14,691,414.00	7.53
22	301336	趣睡科技	14,509,151.04	7.43
23	300519	新光药业	14,491,047.00	7.42
24	600051	宁波联合	14,337,615.00	7.34
25	603356	华菱精工	14,146,078.00	7.25
26	000952	广济药业	13,893,199.00	7.12
27	301024	霍普股份	13,662,443.68	7.00
28	300074	华平股份	13,154,216.00	6.74
29	600159	大龙地产	13,076,273.00	6.70
30	301030	*ST仕净	13,067,806.20	6.69
31	003011	海象新材	13,044,620.72	6.68
32	300176	鸿特科技	12,966,861.00	6.64
33	688193	仁度生物	12,893,210.55	6.60
34	001231	农心科技	12,712,767.00	6.51
35	688156	路德科技	12,396,431.37	6.35
36	688638	誉辰智能	12,392,678.10	6.35
37	301131	聚赛龙	12,392,486.11	6.35
38	300929	华骐环保	12,125,054.70	6.21

39	300030	阳普医疗	11,750,543.00	6.02
40	002495	佳隆股份	11,701,185.00	5.99
41	002999	天禾股份	11,691,687.75	5.99
42	003003	天元股份	11,566,590.02	5.93
43	301163	宏德股份	11,193,878.00	5.73
44	300717	华信新材	11,068,930.00	5.67
45	002513	蓝丰生化	10,981,201.00	5.63
46	300535	达威股份	10,576,712.46	5.42
47	600099	林海股份	10,490,181.00	5.37
48	600137	浪莎股份	10,476,311.00	5.37
49	600128	苏豪弘业	10,422,651.00	5.34
50	002968	新大正	9,990,107.50	5.12
51	688793	倍轻松	9,957,358.74	5.10
52	603182	嘉华股份	9,939,545.00	5.09
53	002247	聚力文化	9,934,706.01	5.09
54	002319	乐通股份	9,840,548.00	5.04
55	600561	江西长运	9,815,043.99	5.03
56	688118	普元信息	9,741,155.81	4.99
57	688004	博汇科技	9,679,971.46	4.96
58	301006	迈拓股份	9,677,336.00	4.96
59	603022	新通联	9,635,609.00	4.94
60	300305	裕兴股份	9,624,339.00	4.93
61	600671	天目药业	9,543,945.24	4.89
62	603028	赛福天	9,187,031.00	4.71
63	600493	凤竹纺织	9,121,106.00	4.67
64	300845	捷安高科	9,105,302.42	4.66
65	003030	祖名股份	9,029,039.00	4.63
66	000692	惠天热电	8,873,095.00	4.55
67	688058	宝兰德	8,803,195.27	4.51
68	603880	南卫股份	8,782,408.20	4.50
69	300635	中达安	8,545,978.00	4.38

70	002778	中晟高科	8,357,283.00	4.28
71	688659	元琛科技	8,208,634.45	4.21
72	300823	建科智能	8,122,919.60	4.16
73	002828	贝肯能源	7,917,305.00	4.06
74	300106	西部牧业	7,797,880.00	3.99
75	300665	飞鹿股份	7,755,090.28	3.97
76	688038	中科通达	7,720,964.02	3.96
77	603709	中源家居	7,701,546.00	3.95
78	688395	正弦电气	7,696,085.47	3.94
79	301390	经纬股份	7,682,516.00	3.94
80	600444	国机通用	7,564,945.00	3.88
81	301113	雅艺科技	7,497,180.90	3.84
82	300670	大烨智能	7,481,453.00	3.83
83	300163	先锋新材	7,384,741.00	3.78
84	688517	金冠电气	7,384,434.91	3.78
85	688671	碧兴物联	7,336,704.48	3.76
86	688296	和达科技	7,332,262.84	3.76
87	688092	爱科科技	7,321,006.67	3.75
88	300417	南华仪器	7,308,756.90	3.74
89	603335	迪生力	7,083,045.00	3.63
90	603717	天域生物	6,962,740.00	3.57
91	300883	龙利得	6,925,168.00	3.55
92	002848	高斯贝尔	6,912,834.00	3.54
93	001259	利仁科技	6,834,247.00	3.50
94	000590	古汉医药	6,790,892.00	3.48
95	300707	威唐工业	6,723,634.00	3.44
96	000955	欣龙控股	6,707,813.00	3.44
97	688056	莱伯泰科	6,674,865.57	3.42
98	300694	蠡湖股份	6,580,901.00	3.37
99	002188	中天服务	6,570,204.00	3.37
100	300612	宣亚国际	6,560,185.00	3.36

101	301231	荣信文化	6,558,225.00	3.36
102	002084	海鸥住工	6,532,381.00	3.35
103	300564	筑博设计	6,528,090.00	3.34
104	300649	杭州园林	6,523,966.00	3.34
105	002963	豪尔赛	6,487,711.00	3.32
106	001211	双枪科技	6,487,086.00	3.32
107	002316	亚联发展	6,419,798.00	3.29
108	688021	奥福科技	6,416,774.40	3.29
109	300605	恒锋信息	6,415,626.62	3.29
110	000610	*ST西旅	6,366,192.00	3.26
111	600689	上海三毛	6,306,094.00	3.23
112	000757	浩物股份	6,232,130.00	3.19
113	301192	泰祥股份	6,231,986.50	3.19
114	301037	保立佳	6,228,823.60	3.19
115	300295	*ST三六	6,095,521.76	3.12
116	688573	信宇人	6,043,818.17	3.10
117	300422	博世科	6,029,872.00	3.09
118	300614	百川畅银	5,712,976.00	2.93
119	600778	友好集团	5,602,841.00	2.87
120	600543	*ST莫高	5,454,934.00	2.79
121	002719	ST麦趣	5,412,426.00	2.77
122	688051	佳华科技	5,349,496.65	2.74
123	603536	惠发食品	5,320,582.00	2.73
124	002694	*ST顾地	5,303,373.00	2.72
125	300912	凯龙高科	5,286,674.00	2.71
126	003008	开普检测	5,207,291.10	2.67
127	688189	ST南新	5,199,511.07	2.66
128	605567	春雪食品	5,177,326.00	2.65
129	002193	ST如意	5,176,834.00	2.65
130	300886	华业香料	5,134,973.30	2.63
131	600697	欧亚集团	5,113,900.00	2.62

132	300851	交大思诺	5,039,187.00	2.58
133	605177	东亚药业	5,034,472.00	2.58
134	000637	茂化实华	5,005,717.00	2.56
135	300103	达刚控股	4,958,457.00	2.54
136	600719	大连热电	4,907,321.00	2.51
137	301372	科净源	4,884,538.00	2.50
138	688121	*ST卓然	4,844,435.55	2.48
139	300385	ST雪浪	4,822,387.00	2.47
140	002856	*ST美芝	4,806,582.00	2.46
141	688420	美腾科技	4,791,628.84	2.45
142	300371	汇中股份	4,705,962.00	2.41
143	603214	爱婴室	4,680,211.00	2.40
144	300838	浙江力诺	4,570,609.00	2.34
145	000056	*ST皇庭	4,490,396.89	2.30
146	603968	醋化股份	4,479,904.00	2.29
147	300169	天晟新材	4,403,344.00	2.26
148	000663	永安林业	4,380,575.00	2.24
149	603900	莱绅通灵	4,362,198.00	2.23
150	300549	优德精密	4,236,068.00	2.17
151	688450	光格科技	4,228,094.23	2.17
152	603041	美思德	4,223,933.00	2.16
153	600539	狮头股份	4,180,332.00	2.14
154	603729	ST龙韵	4,107,437.00	2.10
155	301139	*ST元道	4,100,781.00	2.10
156	301130	西点药业	4,014,641.00	2.06
157	600082	ST海泰	3,988,877.00	2.04
158	688178	万德斯	3,918,689.75	2.01

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,048,677,811.17
卖出股票收入（成交）总额	1,649,025,000.06

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（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

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

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 本基金投资的前十名证券的发行主体中，天晟新材在报告编制日前一年内曾被中国证监会立案调查。中达安在报告编制日前一年内曾受到宝安区住房和建设局的处罚。信宇人在报告编制日前一年内曾受到上海证券交易所的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有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 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

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	4,145,092.79
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	661,159.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,806,252.55

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

58 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
富荣福耀混合A	778	105,745.97	52,348,886.93	63.6303%	29,921,474.64	36.3697%
富荣福耀混合C	34,115	13,391.73	312,514,696.21	68.4051%	144,344,212.48	31.5949%
合计	34,803	15,490.88	364,863,583.14	67.6765%	174,265,687.12	32.3235%

注：①分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

②户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025年07月01日-2026年06月30日）
盈利投资者数量占比	9.33%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 （份）	占基金总份额比 例
基金管理人所有从业人员持有本基金	富荣福耀混合A	102,767.24	0.12%
	富荣福耀混合C	64,048.81	0.01%
	合计	166,816.05	0.03%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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	富荣福耀混合A	0~10
	富荣福耀混合C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	富荣福耀混合A	0
	富荣福耀混合C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	富荣福耀混合A	富荣福耀混合C
基金合同生效日(2021年12月27日) 基金份额总额	74,393.39	303,814,669.34
本报告期期初基金份额总额	3,275,179.14	178,385,690.74
本报告期基金总申购份额	84,341,913.40	449,498,697.40
减：本报告期基金总赎回份额	5,346,730.97	171,025,479.45
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	82,270,361.57	456,858,908.69

注：申购含转换入份额、红利再投资份额；赎回含转换出份额。

§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

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，未出现变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）未发生变更。

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，本基金管理人无受到监管部门调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受到监管部门调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人无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无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	
国泰海通	2	335,277,024.61	9.07%	210,387.28	12.77%	-
华宝证券	2	3,361,758,842.78	90.93%	1,437,591.29	87.23%	-

注：（1）证券公司的选择标准为财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易等服务能力较强。（2）证券公司的选择程序为根据标准进行考察、准入后，经公司批准后与被选择的证券公司签订协议。（3）报告期内证券交易单元未发生变化。

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

本基金本报告期末租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

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	富荣基金管理有限公司旗下基金2025年第4季度报告提示性公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-01-22
2	富荣基金管理有限公司旗下全部基金2025年年度报告提示性公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
3	富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华泰证券股份有限公司为销售机构、开通基金定期定额投资业务和基金转换业务并参加费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-10
4	富荣基金管理有限公司旗下全部基金2026年第1季度报告提示性公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-22
5	富荣基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-05-30
6	富荣基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善身份信息资料的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-06-25

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机	1	20260101 - 20260630	146,044,483.34	-	-	146,044,483.34	27.09%

构						
产品特有风险						
报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；若连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。						

注：申购含转换入份额、红利再投资份额；赎回含转换出份额。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，无影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 12.1.1 中国证监会批准富荣福耀混合型证券投资基金设立的文件；
- 12.1.2 《富荣福耀混合型证券投资基金基金合同》；
- 12.1.3 《富荣福耀混合型证券投资基金托管协议》；
- 12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 12.1.5 报告期内富荣福耀混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富荣基金管理有限公司，客服热线：4006855600。

富荣基金管理有限公司
二〇二六年八月三十一日