

富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

二〇二二年中期报告

2022 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： 中国银行股份有限公司

送出日期： 2022 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 29 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 2022 年 1 月 1 日起至 2022 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、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	8
§4	管理人报告	10
4.1	基金管理人及基金经理	10
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	13
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5	托管人报告	16
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
§6	中期财务报告（未经审计）	17
6.1	资产负债表	17
6.2	利润表	18
6.3	净资产（基金净值）变动表	19
6.4	报表附注	21
§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.....	55
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	68
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	70
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.....	70
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.....	71
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.....	71
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.....	71
7.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	71
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	71
7.12	投资组合报告附注.....	71
§8	基金份额持有人信息.....	74
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	74
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	74
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	74
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	74
§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.....	78
10.8	其他重大事件.....	80
§11	影响投资者决策的其他重要信息.....	81
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.....	81
11.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	81
§12	备查文件目录.....	82

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	富国中证沪港深 500ETF
场内简称	AH500ETF
基金主代码	517100
交易代码	517100
基金运作方式	契约型，交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 02 月 09 日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额（单位：份）	508,102,125.00
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2021 年 3 月 2 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采用复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的资产配置策略、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、参与融资及转融通证券出借业务策略详见法律文件。
业绩比较基准	中证沪港深 500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股（均含存托凭证），具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金投资港股通标的股票的，将承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	许俊
	联系电话	021-20361818	95566
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		95105686、4008880688	95566
传真		021-20361616	010-66594942
注册地址		中国(上海)自由贸易试验	北京市西城区复兴门内大

	区世纪大道 1196 号世纪汇 办公楼二座 27-30 层	街 1 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 1 号
邮政编码	200120	100818
法定代表人	裴长江	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披 露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正 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 中国银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街 1 号

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、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(2022年01月01日至2022年06月30日)
本期已实现收益	-16,876,171.65
本期利润	-33,522,144.20
加权平均基金份额本期利润	-0.0625
本期加权平均净值利润率	-7.92%
本期基金份额净值增长率	-6.55%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年06月30日)
期末可供分配利润	-92,335,371.57
期末可供分配基金份额利润	-0.1817
期末基金资产净值	415,766,753.43
期末基金份额净值	0.8183
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年06月30日)
基金份额累计净值增长率	-18.17%

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

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	7.56%	1.13%	6.87%	1.13%	0.69%	0.00%
过去三个月	6.93%	1.44%	5.93%	1.36%	1.00%	0.08%
过去六个月	-6.55%	1.58%	-7.78%	1.55%	1.23%	0.03%
过去一年	-14.85%	1.34%	-17.88%	1.31%	3.03%	0.03%
自基金合同	-18.17%	1.28%	-22.32%	1.29%	4.15%	-0.01%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

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



注：1、截止日期为2022年6月30日。
 2、本基金于2021年2月9日成立，建仓期6个月，从2021年2月9日起至2021年8月8日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理

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：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国际信托股份有限公司。公司在北京、成都、广州设立有分公司，并全资设有两家子公司——富国资产管理（上海）有限公司和富国资产管理（香港）有限公司。公司拥有公募基金、特定客户资产管理、QDII、社保、企业年金、基本养老保险基金等基金公司全部业务牌照。

截至 2022 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、富国中证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、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 267 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）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		
张圣贤	本基金基金经理	2021-02-09	—	15.0	硕士，曾任上海申银万国证券研究所有限公司研究员；自 2015 年 3 月加入富国基金管理有限公司，历

				<p>任基金经理助理、量化投资部量化投资总监助理；现任富国基金量化投资部量化投资副总监兼定量基金经理。2015年6月至2021年9月任富国中证国有企业改革指数型证券投资基金（原富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金，于2021年1月1日更名）基金经理，2015年6月起任富国中证军工指数型证券投资基金（原富国中证军工指数分级证券投资基金，于2021年1月1日更名）、富国中证新能源汽车指数型证券投资基金（原富国中证新能源汽车指数分级证券投资基金，于2021年1月1日更名）基金经理；自2015年8月起任富国中证工业4.0指数型证券投资基金（原富国中证工业4.0指数分级证券投资基金，于2021年1月1日更名）、富国中证体育产业指数型证券投资基金（原富国中证体育产业指数分级证券投资基金，于2021年1月1日更名）基金经理，2016年2月起任富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）基金经理，2017年7月至2020年12月任富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）基金经理，2017年11月起任富国中证煤炭指数型证券投资基金（原富国中证煤炭指数分级证券投资基金，于2021年1月1日更名）基金经理，2020年4月起任富国中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2020年7月至2021年9月任富国上海金交易型开放式证券投资基金、富国上海金交易型开放式证券投资基金联接基金基金经理，2020年12月起任富国中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金、富国中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021年2月起任富国中证沪港深500交易型开放式指</p>
--	--	--	--	---

					数证券投资基金基金经理，2021年6月起任富国中证现代物流交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021年7月起任富国中证沪港深500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2021年8月起任富国中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2022年1月起任富国中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，2022年1月起任富国中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2022年6月起任富国中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国中证沪港深500交易型开放式指数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》、《富国中证沪港深500交易型开放式指数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

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等

相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制，银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合，对同一投资标的的采用相同投资策略的，必须通过交易系统采取同时、同价下达投资指令，确保公平对待其所管理的组合。事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1日、3日、5日）的季度公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统，对涉及公平性交易的投资行为进行分析评估，分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品，并重点分析同类组合（股票型、混合型、债券型）间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为，若发现异常交易行为，风险管理部视情况要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存，以备后查。本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，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。公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年伊始，随着美国加息预期升温，全球流动性面临收紧，市场风格出现切换，前期表现强势的成长赛道如新能源、锂电池、军工等板块均迎来大幅调整，稳增长板块表现较强。2 月下旬，随着俄乌冲突加剧，布伦特原油价格持续走高，投资者对经济滞胀担忧加大，全球股市均出现较大幅度的调整。3 月中旬，SEC 将 5 家中国公司列入《外国公司问责法》的暂定清单，投资者对中概股从纳斯达克退市的担忧加剧，中概股和港股互联网公司均迎来一轮大幅回调，A 股也出现外

资大幅流出的情况。随着国务院金融稳定发展委员会召开专题会议研究当前经济形势和资本市场问题，对市场关切的问题如宏观经济运行、房地产、中概股、平台经济等均做出积极务实的回应，投资者信心获得提振，A股应声上涨。4月以来，随着上海疫情持续扩散，汽车、半导体等产业链生产受到较大冲击，市场对于经济增长的担忧持续加大，A股整体再次出现大幅调整。4月底，经过短期大幅调整后，A股投资性价比显现，同时政治局会议再次强调稳增长目标，市场信心有所恢复，A股迎来快速反弹。进入5月，稳增长政策进一步发力：国务院部署稳经济一揽子措施，涉及财政、金融、消费、投资等共6方面33项措施，努力推动经济回归正常轨道、确保运行在合理区间；央行召开全系统货币信贷形势分析会，部署落实稳定信贷增长工作措施，下调五年期以上LPR报价15bp。5月、6月国内政策环境明显改善，市场信心得到有效改善，汽车、光伏、半导体等前期受疫情影响较大的板块迎来大幅反弹，稳增长板块表现相对较弱。

总体来看，2022年上半年上证综指下跌6.63%，沪深300下跌9.22%，创业板指下跌15.41%，中证500指数下跌12.3%。

在投资管理上，本基金采取完全复制的被动式指数基金管理策略，采用量化和人工管理相结合的方法，处理基金日常运作中的大额申购和赎回等事件。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2022年6月30日，本基金份额净值为0.8183元；份额累计净值为0.8183元；本报告期，本基金份额净值增长率为-6.55%，同期业绩比较基准收益率为-7.78%

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，经过5、6月的快速上涨后，市场或将进入基本面验证期。从宏观层面来看，国内稳增长依旧稳步推进，但受美联储持续大幅加息的影响，全球或面临经济衰退预期的冲击。从资金面来看，随着复工复产的推进，前期在金融市场空转的资金或将部分流出，市场资金利率将有所提升。随着中报季来临，市场进入基本面验证期，预计波动加大，行业配置方面或需更加均衡一些。

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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金（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，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2022 年 06 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	5,118,804.47	4,858,619.81
结算备付金	44,393.07	37,766.96
存出保证金	5,263.03	33,593.55
交易性金融资产	409,971,594.67	483,737,569.31
其中：股票投资	409,917,770.32	483,737,569.31
基金投资	—	—
债券投资	53,824.35	—
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	—	71,604.98
应收股利	1,144,899.15	32,677.18
应收申购款	—	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	117.62	2,001.82
资产总计	416,285,072.01	488,773,833.61
负债和净资产	本期末 2022 年 06 月 30 日	上年度末 2021 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	55.30	40.02
应付赎回款	—	—
应付管理人报酬	166,710.35	210,486.93
应付托管费	33,342.06	42,097.41
应付销售服务费	—	—
应付投资顾问费	—	—
应交税费	101.85	31.71

应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	318,109.02	230,612.76
负债合计	518,318.58	483,268.83
净资产：		
实收基金	508,102,125.00	557,602,125.00
其他综合收益	—	—
未分配利润	-92,335,371.57	-69,311,560.22
净资产合计	415,766,753.43	488,290,564.78
负债和净资产总计	416,285,072.01	488,773,833.61

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.8183 元，基金份额总额 508,102,125.00 份。

比较数据已根据本年《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）》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年度末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年度末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

6.2 利润表

会计主体：富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日)	上年度可比期间(2021 年 2 月 9 日(基金合同 生效日)至 2021 年 6 月 30 日)
一、营业总收入	-32,157,931.46	-31,270,052.91
1.利息收入	26,826.60	389,496.23
其中：存款利息收入	8,737.48	389,394.28
债券利息收入	—	101.95
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	—	—
证券出借利息收入	18,089.12	—
其他利息收入	—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）	-15,558,792.15	-6,006,722.57
其中：股票投资收益	-20,341,007.95	-11,680,122.04
基金投资收益	—	—

债券投资收益	63,078.34	113,979.94
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具收益	10,049.93	—
股利收益	4,709,087.53	5,559,419.53
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）	-16,645,972.55	-25,958,887.69
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	20,006.64	306,061.12
减：二、营业总支出	1,364,212.74	3,221,403.91
1. 管理人报酬	1,053,759.46	1,286,541.68
2. 托管费	210,751.85	257,308.34
3. 销售服务费	—	—
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	101.51	0.19
8. 其他费用	99,599.92	1,677,553.70
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-33,522,144.20	-34,491,456.82
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-33,522,144.20	-34,491,456.82
五、其他综合收益的税后净额	—	—
六、综合收益总额	-33,522,144.20	-34,491,456.82

注：比较数据已根据本年《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）》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 (2022 年 01 月 01 日至 2022 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（基金净值）	557,602,125.00	— 69,311,560.22	488,290,564.78

加：会计政策变更	—	—	—
二、本期期初净资产（基金净值）	557,602,125.00	69,311,560.22	488,290,564.78
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-49,500,000.00	23,023,811.35	-72,523,811.35
（一）、综合收益总额	—	33,522,144.20	-33,522,144.20
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-49,500,000.00	10,498,332.85	-39,001,667.15
其中：1.基金申购款	4,500,000.00	-1,201,047.94	3,298,952.06
2.基金赎回款	-54,000,000.00	11,699,380.79	-42,300,619.21
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	—	—
（四）、其他综合收益结转留存收益	—	—	—
四、本期期末净资产（基金净值）	508,102,125.00	92,335,371.57	415,766,753.43
项目	上年度可比期间(2021年2月9日(基金合同生效日)至2021年6月30日)		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、本期期初净资产（基金净值）	787,102,125.00	—	787,102,125.00
二、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	180,000,000.00	23,674,290.99	203,674,290.99
（一）、综合收益总额	—	34,491,456.82	-34,491,456.82
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	180,000,000.00	10,817,165.83	169,182,834.17
其中：1.基金申购款	—	—	—
2.基金赎回款	180,000,000.00	10,817,165.83	169,182,834.17
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	—	—
（四）、其他综合收益结转留存收益	—	—	—
四、本期期末净资产（基金净值）	607,102,125.00	23,674,290.99	583,427,834.01

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

富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金(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〔2020〕3527 号《关于准予富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》的核准,由基金管理人富国基金管理有限公司自 2021 年 1 月 25 日至 2021 年 2 月 3 日止期间向社会公开发行人募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2021)验字第 60467606_B08 号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2021 年 2 月 9 日正式生效。本基金为交易型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币 787,102,125.00 元,其中以现金认购方式收到首次募集有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 783,259,000.00 元,折合基金份额 783,259,000.00 份;其中网上现金认购份额为 783,259,000.00 份,网下现金认购份额为 0.00 份;以股票认购方式按认购期最后一日的均价计算的金额为人民币 3,843,125.00 元,折合 3,843,125.00 份基金份额;有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币 217,440.68 元,均为网上现金认购的有效认购资金在首次募集期间产生的利息,计入基金财产,不折算为投资者基金份额。与首次募集相关的资产总额为人民币 787,319,565.68 元,折合 787,102,125.00 份基金份额。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金的投资范围主要为标的指数成份股、备选成份股(均含存托凭证)和其他股票。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会允许发行的股票、港股通标的股票)、存托凭证、债券(国债、央行票据、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券(含

超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、金融衍生工具（股指期货、国债期货）、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。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。

基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。如法律法规对该比例要求有变更的，在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

本基金的业绩比较基准为中证沪港深 500 指数收益率。

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、应用指南、解释以及其他相关规定（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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、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。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基

础,通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险,以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况;

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括:通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值,以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息;

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时,该金融资产成为已发生信用减值的金融资产;

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时,本基金直接减记该金融资产的账面余额;

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或该收取金融资产现金流量的权利已转移,且符合金融资产转移的终止确认条件的,金融资产将终止确认;

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的,终止确认该金融资产;保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,不终止确认该金融资产;本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,分别下列情况处理:放弃了对该金融资产控制的,终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债;未放弃对该金融资产控制的,按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产,并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债(含交易性金融负债和衍生金融负债),按照公允价值进行后续计量,所有公允价值变动均计入当期损益。对于摊余成本计量的金融负债,采用实际利率法,按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满,则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.3收入/(损失)的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款,按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入,并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失,列入利息收入减项,存款利息收入以净额列示;

(2)交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用,计入投资收益;

债券投资和资产支持证券投资持有期间,按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投

资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

(8) 其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

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

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量

类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日（2022年1月1日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币4,858,619.81元，自应收利息转入的重分类金额为人民币509.25元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币4,859,129.06元。

结算备付金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币37,766.96元，自应收利息转入的重分类金额为人民币53.65元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币37,820.61元。

存出保证金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币33,593.55元，自应收利息转入的重分类金额为人民币19.43元，重新计量预

期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 33,612.98 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,001.82 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 509.25 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 53.65 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 19.43 元，转出至其他资产的重分类金额为人民币 1,419.49 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

其他资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 1,419.49 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，其他资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,419.49 元。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无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‰；

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；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股

股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

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暂行条例（2011年修订）》、《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）及地方教育费附加。

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[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；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[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；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 境外投资

本基金运作过程中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 号文《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 号文《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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 (2022 年 06 月 30 日)
活期存款	5,118,804.47
等于：本金	5,118,264.79
加：应计利息	539.68
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	5,118,804.47

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 (2022 年 06 月 30 日)			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	494,077,920.04	—	409,917,770.32	84,160,149.72

贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—
债券	交易所市场	50,000.00	6.55	53,824.35
	银行间市场	—	—	—
	合计	50,000.00	6.55	53,824.35
资产支持证券	—	—	—	—
基金	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	494,127,920.04	6.55	409,971,594.67	84,156,331.92

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

单位：人民币元

项目	本期末（2022年06月30日）
应收利息	—
其他应收款	—
待摊费用	—
转融通证券出借利息	117.62
合计	117.62

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2022年06月30日）
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	40,156.09
其中：交易所市场	40,156.09
银行间市场	—
应付利息	—
预提信息披露费	170,000.00
预提审计费	81,323.61

IOPV 计算发布费	26,629.32
合计	318,109.02

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	557,602,125.00	557,602,125.00
本期申购	4,500,000.00	4,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-54,000,000.00	-54,000,000.00
本期末	508,102,125.00	508,102,125.00

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
	14,461,282.22	54,850,278.00	69,311,560.22
本期利润	-	-	-
	16,876,171.65	16,645,972.55	33,522,144.20
本期基金份额交易产生的变动数	1,916,475.67	8,581,857.18	10,498,332.85
其中：基金申购款	-152,561.39	-1,048,486.55	-1,201,047.94
基金赎回款	2,069,037.06	9,630,343.73	11,699,380.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-	-	-
	29,420,978.20	62,914,393.37	92,335,371.57

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年06月30日）
活期存款利息收入	5,900.13
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	2,462.03
其他	375.32
合计	8,737.48

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年06月30日）
----	-----------------------------

股票投资收益——买卖股票差价收入	-17,837,176.36
股票投资收益——赎回差价收入	-2,503,831.59
股票投资收益——申购差价收入	—
股票投资收益——证券出借差价收入	—
合计	-20,341,007.95

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年06月30日）
卖出股票成交总额	64,993,027.42
减：卖出股票成本总额	82,657,918.01
减：交易费用	172,285.77
买卖股票差价收入	-17,837,176.36

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年06月30日）
赎回基金份额对价总额	42,300,619.21
减：现金支付赎回款总额	27,148,422.21
减：赎回股票成本总额	17,656,028.59
减：交易费用	—
赎回差价收入	-2,503,831.59

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益——申购差价收入。

6.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期末无股票投资收益证券出借差价收入。

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（2022年01月01日至2022年06月30日）
债券投资收益——利息收入	51.75
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	63,026.59
合计	63,078.34

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（2022年01月01日至2022年06月30日）
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	322,473.82

减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	259,400.00
减：应计利息总额	46.40
减：交易费用	0.83
债券投资收益-差价收入	63,026.59

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。

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

单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年06月30日）
卖出权证成交总额	10,374.54
减：卖出权证成本总额	—
减：交易费用	22.44
减：买卖权证差价收入应缴纳增值税额	302.17
买卖权证差价收入	10,049.93

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（2022年01月01日至2022年06月30日）
股票投资产生的股利收益	4,709,087.53
其中：证券出借权益补偿收入	682.10
基金投资产生的股利收益	—
合计	4,709,087.53

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2022年01月01日至2022年06月30日）
1. 交易性金融资产	-16,645,972.55
股票投资	-16,649,790.35

债券投资	3,817.80
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	-16,645,972.55

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年06月30日）
基金赎回费收入	—
替代损益	20,006.64
合计	20,006.64

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（2022年01月01日至2022年06月30日）
审计费用	21,323.61
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	1,647.33
其他	16,628.98
合计	99,599.92

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大影响关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人、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
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
中国银行股份有限公司	基金托管人
富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的联接基金
申万宏源证券承销保荐有限责任公司（“申万宏源承销保荐”）	基金管理人的股东控制的子公司

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（2022年01月01日至2022年06月30日）		上年度可比期间（2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日）	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
海通证券	29,778,770.80	29.93	519,912,124.40	45.33
申万宏源	966,684.10	0.97	12,153,525.74	1.06

6.4.10.1.2 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2022年01月01日至2022年06月30日）		上年度可比期间（2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日）	
	成交金额	占当期权证成交总额的比例（%）	成交金额	占当期权证成交总额的比例（%）
海通证券	10,374.54	100.00	—	—

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2022年01月01日至2022年06月30日）	上年度可比期间（2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日）

	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
海通证券	—	—	151,251.80	24.77
申万宏源	—	—	343,664.51	56.29

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 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（2022年01月01日至2022年06月30日）			
	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 (%)
申万宏源	887.56	1.98	622.10	1.55
海通证券	1,627.15	3.63	1,605.28	4.00
关联方名称	上年度可比期间（2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日）			
	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 (%)
申万宏源	11,075.74	1.50	3,630.93	2.30
海通证券	281,318.83	38.14	40,747.30	25.78

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。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。

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（2022年01月01日至2022年06月30日）	上年度可比期间（2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日）
当期发生的基金应支付的管理费	1,053,759.46	1,286,541.68
其中：支付销售机构的客户维护费	—	—

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日）	上年度可比期间（2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日）
当期发生的基金应支付的托管费	210,751.85	257,308.34

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间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

注：本报告期内及上年度可比期间内本基金的基金管理人均未运用自有资金投资本基金。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末（2022年06月30日）		上年度末（2021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（%）
富国中证沪港深500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	97,648,300.00	19.22	101,448,300.00	18.19
海通证券股份有限公司	865,000.00	0.17	—	—
申万宏源证券有限公司	1,246,000.00	0.25	3,871,500.00	0.69

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（2022年01月01日至2022年06月30日）		上年度可比期间（2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日）	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	5,118,804.47	5,900.13	6,229,868.66	344,530.08

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期（2022年01月01日至2022年06月30日）					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：）	总金额

				股/张)	
申万宏源证券承销保荐有限责任公司	688267	中触媒	IPO 网下申购	2,164	91,124.96
海通证券股份有限公司	688062	迈威生物	IPO 网下申购	10,881	380,552.09
海通证券股份有限公司	688220	翱捷科技	IPO 网下申购	2,570	424,982.14
申万宏源证券承销保荐有限责任公司	601108	财通证券	配股	9,180	62,424.00

金额单位：人民币元

上年度可比期间(2021年2月9日(基金合同生效日)至2021年6月30日)					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
海通证券股份有限公司	300981	中红医疗	IPO 网下申购	5,660	275,019.40
海通证券股份有限公司	688217	睿昂基因	IPO 网下申购	1,040	19,252.58
海通证券股份有限公司	688685	迈信林	IPO 网下申购	2,612	23,678.04
海通证券股份有限公司	688682	霍莱沃	IPO 网下申购	946	43,467.38
海通证券股份有限公司	688092	爱科科技	IPO 网下申购	1,137	21,836.71
海通证券股份有限公司	688626	翔宇医疗	IPO 网下申购	3,652	105,776.89
海通证券股份有限公司	688329	艾隆科技	IPO 网下申购	1,846	31,186.42

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

为更紧密地跟踪标的指数，降低跟踪误差，经与基金托管人协商一致，本基金在报告期内根据基金合同约定的投资策略投资于基金管理人股东发行的股票海通证券（600837.SH）、基金管理人股东的母公司发行的股票申万宏源（000166.SZ）和基金托管人及其关联方发行的股票中国银行（601988.SH）、中国银行（3988.HK）、中银证券（601696.SH）、中银香港（2388.HK）以及中银航空租赁（2588.HK）。

本报告期末，本基金持有海通证券 107,600 股，占基金资产净值比例 0.25%。

上年度末，本基金持有海通证券 121,900 股，占基金资产净值比例 0.31%。

本报告期末，本基金持有申万宏源 100,600 股，占基金资产净值比例 0.10%。

上年度末，本基金持有申万宏源 142,300 股，占基金资产净值比例 0.15%。

本报告期末，本基金持有中国银行（601988.SH）235,200 股，占基金资产净值比例 0.18%。上年度末，本基金持有中国银行（601988.SH）266,600 股，占基金资产净值比例 0.17%。

本报告期末，本基金持有中国银行（3988.HK）935,000 股，占基金资产净值比例 0.60%。上年度末，本基金持有中国银行（3988.HK）1,056,000 股，占基金资产净值比例 0.50%。

本报告期末，本基金持有中银证券 18,500 股，占基金资产净值比例 0.06%。上年度末，本基金持有中银证券 17,500 股，占基金资产净值比例 0.05%。

本报告期末，本基金持有中银香港 48,500 股，占基金资产净值比例 0.31%。上年度末，本基金持有中银香港 53,500 股，占基金资产净值比例 0.23%。

本报告期末，本基金持有中银航空租赁 2,500 股，占基金资产净值比例 0.03%。上年度末，本基金持有中银航空租赁 2,700 股，占基金资产净值比例 0.03%。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2022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
300834	星辉环材	2022-01-06	6个月	新股限售	55.57	30.03	314	17,448.98	9,429.42	—
301120	新特电气	2022-04-11	6个月	新股限售	13.73	15.49	1,032	14,169.36	15,985.68	—
301123	奕东电子	2022-01-14	6个月	新股限售	37.23	25.39	430	16,008.90	10,917.70	—
301150	中一科技	2022-04-14	6个月	新股限售	163.56	82.76	120	19,627.20	9,931.20	—
301150	中一科技	2022-06-10	5个月	新股限售 转增	—	82.76	60	—	4,965.60	—
301158	德石股份	2022-01-07	6个月	新股限售	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02	—
301162	国能日新	2022-04-19	6个月	新股限售	45.13	54.11	334	15,073.42	18,072.74	—
301181	标榜股份	2022-02-11	6个月	新股限售	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63	—
301196	唯科科技	2022-01-04	6个月	新股限售	64.08	37.52	187	11,982.96	7,016.24	—

301200	大族数控	2022-02-18	6 个月	新股限售	76.56	51.92	286	21,896.16	14,849.12	-
301201	诚达药业	2022-01-12	6 个月	新股限售	72.69	71.54	303	22,025.07	21,676.62	-
301206	三元生物	2022-01-26	6 个月	新股限售	109.30	45.69	197	21,532.10	9,000.93	-
301206	三元生物	2022-06-17	2 个月	新股限售_转增	-	45.69	98	-	4,477.62	-
301219	腾远钴业	2022-03-10	6 个月	新股限售	173.98	87.82	80	13,918.40	7,025.60	-
301219	腾远钴业	2022-05-24	4 个月	新股限售_转增	-	87.82	64	-	5,620.48	-
688150	莱特光电	2022-03-10	6 个月	新股限售	22.05	19.60	5,626	124,053.30	110,269.60	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113060	浙 22 转债	2022-06-14	1 个月	认购新发证券	100.00	100.01	360	36,000.00	36,002.68	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
01114	BRILLIANC E CHI	2021 年 03 月 31 日	筹划重大事项	6.24	-	-	72,000.00	421,019.68	449,280.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2022 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 2022 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：股）	期末估值总额
1	600010	包钢股份	2022 年 07 月 11 日	2.35	35,900	84,365.00
2	000651	格力电器	2022 年 07 月 13 日	33.72	10,000	337,200.00

3	600031	三一重工	2022年07月 06日	19.06	10,000	190,600.00
4	000625	长安汽车	2022年07月 26日	17.32	10,000	173,200.00
合计	-	-	-	-	65,900.00	785,365.00

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%，但标的指数成分券不受此限。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，故不在下表进行列示。

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（2022年06月30）	上年度末（2021年12月）
--------	-----------------	----------------

	日)	31日)
AAA	36,002.68	—
AAA 以下	17,821.67	—
未评级	—	—
合计	53,824.35	—

注：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银行存款、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（2022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							
银行存款	5,118,804.47	—	—	—	—	—	5,118,804.47
结算备付金	44,393.07	—	—	—	—	—	44,393.07
存出保证金	5,263.03	—	—	—	—	—	5,263.03
交易性金融资产	—	—	53,824.35	—	—	409,917,770.32	409,971,594.67
应收股利	—	—	—	—	—	1,144,899.15	1,144,899.15
其他资产	—	—	—	—	—	117.62	117.62
资产总计	5,168,460.57	—	53,824.35	—	—	411,062,787.09	416,285,072.01
负债							
应付清算款	—	—	—	—	—	55.30	55.30
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	166,710.35	166,710.35
应付托管费	—	—	—	—	—	33,342.06	33,342.06
应交税费	—	—	—	—	—	101.85	101.85
其他负债	—	—	—	—	—	318,109.02	318,109.02
负债总计	—	—	—	—	—	518,318.58	518,318.58
利率敏感度缺口	5,168,460.57	—	53,824.35	—	—	410,544,468.51	415,766,753.43
上年度末（2021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							
银行存款	4,858,619.81	—	—	—	—	—	4,858,619.81
结算备付金	37,766.96	—	—	—	—	—	37,766.96

存出保证金	33,593.55	—	—	—	—	—	33,593.55
交易性金融资产	—	—	—	—	—	483,737,569.31	483,737,569.31
应收清算款	—	—	—	—	—	71,604.98	71,604.98
应收股利	—	—	—	—	—	32,677.18	32,677.18
其他资产	—	—	—	—	—	2,001.82	2,001.82
资产总计	4,929,980.32	—	—	—	—	483,843,853.29	488,773,833.61
负债							
应付清算款	—	—	—	—	—	40.02	40.02
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	210,486.93	210,486.93
应付托管费	—	—	—	—	—	42,097.41	42,097.41
应交税费	—	—	—	—	—	31.71	31.71
其他负债	—	—	—	—	—	230,612.76	230,612.76
负债总计	—	—	—	—	—	483,268.83	483,268.83
利率敏感度缺口	4,929,980.32	—	—	—	—	483,360,584.46	488,290,564.78

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

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。本基金可持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末（2022年06月30日）				
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	欧元 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产					
交易性金融资产	—	159,605,223.00	—	—	159,605,223.00
应收股利	—	1,144,217.05	—	—	1,144,217.05
资产合计	—	160,749,440.05	—	—	160,749,440.05
以外币计价的负债					
—	—	—	—	—	—
负债合计	—	—	—	—	—
资产负债表外汇风险敞口净额	—	160,749,440.05	—	—	160,749,440.05
项目	上年度末（2021年12月31日）				
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	欧元 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产					
交易性金融资产	—	185,224,489.50	—	—	185,224,489.50
应收股利	—	32,677.18	—	—	32,677.18
资产合计	—	185,257,166.68	—	—	185,257,166.68
以外币计价的负债					
—	—	—	—	—	—
负债合计	—	—	—	—	—
资产负债表外汇风险敞口净额	—	185,257,166.68	—	—	185,257,166.68

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	(1) 假设本基金的单一外币汇率变化 1%，其他变量不变；(2) 此项影响并未考虑管理层为减低汇率风险而可能采取的风险管理活动；(3) 计算外汇风险敏感性时，包含了远期外汇敞口。
----	---

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（2022年06月30日）	上年度末（2021年12月31日）
	港币相对人民币贬值 1%	-1,607,494.40	-1,852,571.67
	港币相对人民币升值 1%	1,607,494.40	1,852,571.67

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

本基金的投资范围主要为标的指数成份股、备选成份股（均含存托凭证）和其他股票。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会允许发行的股票、港股通标的股票）、存托凭证、债券（国债、央行票据、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、金融衍生工具（股指期货、国债期货）、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

如法律法规对该比例要求有变更的，在履行适当程序后，以变更后的比例为

准，本基金的投资范围会做相应调整。

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（2022年06月30日）		上年度末（2021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	409,917,770.32	98.59	483,737,569.31	99.07
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	53,824.35	0.01	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	409,971,594.67	98.61	483,737,569.31	99.07

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。下表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，业绩比较基准所对应的市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关；2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年06月30日）	上年度末（2021年12月31日）
	1. 业绩比较基准增加 1%	4,213,785.77	4,604,396.64
2. 业绩比较基准减少 1%	-4,213,785.77	-4,604,396.64	

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 (2022年06月30日)	上年度末 (2021年12月31日)
第一层次	409,670,767.79	482,602,348.76
第二层次	36,002.68	435,344.49
第三层次	264,824.20	699,876.06
合计	409,971,594.67	483,737,569.31

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	409,917,770.32	98.47
	其中：股票	409,917,770.32	98.47
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	53,824.35	0.01
	其中：债券	53,824.35	0.01
	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	5,163,197.54	1.24
8	其他各项资产	1,150,279.80	0.28
9	合计	416,285,072.01	100.00

注：本基金通过深港通交易机制投资的港股公允价值为 159,605,223.00 元，占资产净值比例为 38.39%；通过转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 785,365.00 元，占资产净值比例为 0.19%。

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 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	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	283,567.91	0.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,072.74	0.00

J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	301,640.65	0.07

7.2.1.2 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	2,843,135.00	0.68
B	采矿业	6,354,738.00	1.53
C	制造业	151,082,550.00	36.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,910,020.00	1.42
E	建筑业	4,393,121.00	1.06
F	批发和零售业	1,014,148.40	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	6,281,893.00	1.51
H	住宿和餐饮业	327,080.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,894,150.88	1.90
J	金融业	49,336,531.16	11.87
K	房地产业	4,390,293.00	1.06
L	租赁和商务服务业	3,298,546.86	0.79
M	科学研究和技术服务业	4,180,029.80	1.01
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	119,274.00	0.03
Q	卫生和社会工作	2,041,417.57	0.49
R	文化、体育和娱乐业	543,978.00	0.13
S	综合	—	—
	合计	250,010,906.67	60.13

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
金融	50,919,661.00	12.25

通信服务	28,983,206.00	6.97
非日常生活消费品	27,201,592.00	6.54
房地产	12,571,695.50	3.02
医疗保健	7,336,585.00	1.76
信息技术	7,185,567.00	1.73
日常消费品	6,932,143.00	1.67
工业	6,623,443.00	1.59
公用事业	5,735,550.50	1.38
能源	4,146,920.00	1.00
原材料	1,968,860.00	0.47
合计	159,605,223.00	38.39

注：1、以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

2、以上行业分类的统计中已包含深港通投资的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	00700	腾讯控股	75,200	22,791,616.00	5.48
2	600519	贵州茅台	7,000	14,315,000.00	3.44
3	00005	汇丰控股	228,000	10,070,760.00	2.42
4	01299	友邦保险	134,400	9,774,912.00	2.35
5	601318	中国平安	120,800	5,640,152.00	1.36
5	02318	中国平安	83,500	3,809,270.00	0.92
6	03690	美团-W	55,400	9,200,832.00	2.21
7	300750	宁德时代	15,700	8,383,800.00	2.02
8	600036	招商银行	138,176	5,831,027.20	1.40
8	03968	招商银行	52,000	2,334,800.00	0.56
9	00939	建设银行	1,342,000	6,052,420.00	1.46
9	601939	建设银行	74,800	453,288.00	0.11
10	002594	比亚迪	10,100	3,368,249.00	0.81
10	01211	比亚迪股份	10,000	2,685,300.00	0.65
11	01398	工商银行	969,000	3,866,310.00	0.93
11	601398	工商银行	391,100	1,865,547.00	0.45
12	00388	香港交易所	14,200	4,687,420.00	1.13
13	601012	隆基绿能	67,616	4,505,254.08	1.08
14	000858	五粮液	21,600	4,361,688.00	1.05
15	000333	美的集团	54,600	3,297,294.00	0.79
16	03988	中国银行	935,000	2,505,800.00	0.60
16	601988	中国银行	235,200	766,752.00	0.18

17	00941	中国移动	69,500	2,912,050.00	0.70
17	600941	中国移动	5,200	314,600.00	0.08
18	601166	兴业银行	162,100	3,225,790.00	0.78
19	300059	东方财富	117,852	2,993,440.80	0.72
20	02269	药明生物	48,500	2,977,900.00	0.72
21	600900	长江电力	127,000	2,936,240.00	0.71
22	600030	中信证券	108,835	2,357,366.10	0.57
22	06030	中信证券	30,000	450,000.00	0.11
23	603259	药明康德	22,920	2,383,450.80	0.57
23	02359	药明康德	4,400	393,228.00	0.09
24	601888	中国中免	10,902	2,539,402.86	0.61
25	601328	交通银行	306,400	1,525,872.00	0.37
25	03328	交通银行	197,000	914,080.00	0.22
26	01810	小米集团— W	195,800	2,283,028.00	0.55
27	600887	伊利股份	57,200	2,227,940.00	0.54
28	01024	快手—W	28,000	2,092,720.00	0.50
29	601899	紫金矿业	160,600	1,498,398.00	0.36
29	02899	紫金矿业	66,000	542,520.00	0.13
30	00981	中芯国际	67,000	1,041,850.00	0.25
30	688981	中芯国际	21,600	975,672.00	0.23
31	000568	泸州老窖	8,100	1,996,974.00	0.48
32	601088	中国神华	36,900	1,228,770.00	0.30
32	01088	中国神华	38,500	740,740.00	0.18
33	600690	海尔智家	42,200	1,158,812.00	0.28
33	06690	海尔智家	32,200	799,848.00	0.19
34	601288	农业银行	356,100	1,075,422.00	0.26
34	01288	农业银行	344,000	870,320.00	0.21
35	000002	万科A	75,900	1,555,950.00	0.37
35	02202	万科企业	21,400	360,804.00	0.09
36	002415	海康威视	52,500	1,900,500.00	0.46
37	002475	立讯精密	55,300	1,868,587.00	0.45
38	02331	李宁	30,000	1,865,100.00	0.45
39	600276	恒瑞医药	49,660	1,841,889.40	0.44
40	600809	山西汾酒	5,620	1,825,376.00	0.44
41	02015	理想汽车— W	13,900	1,817,564.00	0.44
42	600438	通威股份	30,000	1,795,800.00	0.43
43	00883	中国海洋石 油	201,000	1,780,860.00	0.43
44	000651	格力电器	52,700	1,777,044.00	0.43

45	300760	迈瑞医疗	5,572	1,745,150.40	0.42
46	600309	万华化学	17,400	1,687,626.00	0.41
47	000725	京东方 A	418,300	1,648,102.00	0.40
48	002714	牧原股份	29,600	1,635,992.00	0.39
49	00016	新鸿基地产	20,500	1,625,240.00	0.39
50	000001	平安银行	108,200	1,620,836.00	0.39
51	002142	宁波银行	44,190	1,582,443.90	0.38
52	02628	中国人寿	85,000	992,800.00	0.24
52	601628	中国人寿	18,500	574,980.00	0.14
53	09633	农夫山泉	39,600	1,525,788.00	0.37
54	00669	创科实业	21,500	1,505,000.00	0.36
55	002129	TCL 中环	25,300	1,489,917.00	0.36
56	00386	中国石油化工股份	286,000	863,720.00	0.21
56	600028	中国石化	149,100	608,328.00	0.15
57	000792	盐湖股份	48,600	1,456,056.00	0.35
58	002812	恩捷股份	5,800	1,452,610.00	0.35
59	09868	小鹏汽车—W	13,300	1,437,730.00	0.35
60	002466	天齐锂业	11,400	1,422,720.00	0.34
61	603288	海天味业	15,638	1,413,049.68	0.34
62	601601	中国太保	38,300	901,199.00	0.22
62	02601	中国太保	31,200	511,680.00	0.12
63	600048	保利发展	80,200	1,400,292.00	0.34
64	600585	海螺水泥	26,900	949,032.00	0.23
64	00914	海螺水泥	15,500	450,740.00	0.11
65	00001	长和	30,500	1,383,785.00	0.33
66	603799	华友钴业	14,280	1,365,453.60	0.33
67	01658	邮储银行	133,000	708,890.00	0.17
67	601658	邮储银行	121,300	653,807.00	0.16
68	300124	汇川技术	20,550	1,353,628.50	0.33
69	300015	爱尔眼科	30,141	1,349,412.57	0.32
70	00857	中国石油股份	238,000	761,600.00	0.18
70	601857	中国石油	108,300	573,990.00	0.14
71	002460	赣锋锂业	8,900	1,323,430.00	0.32
72	01109	华润置地	42,000	1,314,600.00	0.32
73	00002	中电控股	23,500	1,308,245.00	0.31
74	02020	安踏体育	15,600	1,286,064.00	0.31
75	02388	中银香港	48,500	1,285,735.00	0.31
76	600031	三一重工	66,300	1,263,678.00	0.30

77	601668	中国建筑	234,000	1,244,880.00	0.30
78	00027	银河娱乐	31,000	1,240,620.00	0.30
79	02319	蒙牛乳业	37,000	1,238,760.00	0.30
80	300014	亿纬锂能	12,700	1,238,250.00	0.30
81	002352	顺丰控股	21,800	1,216,658.00	0.29
82	600436	片仔癀	3,400	1,212,882.00	0.29
83	01113	长实集团	25,500	1,210,230.00	0.29
84	002304	洋河股份	6,600	1,208,790.00	0.29
85	300498	温氏股份	56,700	1,207,143.00	0.29
86	002271	东方雨虹	22,500	1,158,075.00	0.28
87	600089	特变电工	42,200	1,155,858.00	0.28
88	06160	百济神州	13,700	1,154,088.00	0.28
89	300274	阳光电源	11,600	1,139,700.00	0.27
90	601816	京沪高铁	219,000	1,099,380.00	0.26
91	600837	海通证券	107,600	1,055,556.00	0.25
92	00175	吉利汽车	69,000	1,052,940.00	0.25
93	00688	中国海外发展	49,500	1,049,895.00	0.25
94	600000	浦发银行	130,900	1,048,509.00	0.25
95	00011	恒生银行	8,800	1,042,272.00	0.25
96	603986	兆易创新	7,300	1,038,133.00	0.25
97	600016	民生银行	276,900	1,030,068.00	0.25
98	600406	国电南瑞	37,332	1,007,964.00	0.24
99	02688	新奥能源	9,100	1,003,093.00	0.24
100	601633	长城汽车	13,800	511,152.00	0.12
100	02333	长城汽车	35,500	489,900.00	0.12
101	300122	智飞生物	8,900	987,989.00	0.24
102	603501	韦尔股份	5,700	986,271.00	0.24
103	601919	中远海控	70,740	983,286.00	0.24
104	02382	舜宇光学科技	8,800	962,544.00	0.23
105	000625	长安汽车	55,328	958,280.96	0.23
106	600919	江苏银行	131,800	938,416.00	0.23
107	002709	天赐材料	15,100	937,106.00	0.23
108	601688	华泰证券	65,600	931,520.00	0.22
109	600104	上汽集团	52,000	926,120.00	0.22
110	601225	陕西煤业	43,200	914,976.00	0.22
111	002049	紫光国微	4,800	910,656.00	0.22
112	000063	中兴通讯	35,600	908,868.00	0.22
113	00003	香港中华煤气	125,250	905,557.50	0.22

114	00291	华润啤酒	18,000	900,540.00	0.22
115	002241	歌尔股份	26,800	900,480.00	0.22
116	00960	龙湖集团	28,000	887,040.00	0.21
117	002371	北方华创	3,100	859,072.00	0.21
118	600111	北方稀土	24,400	857,904.00	0.21
119	300142	沃森生物	17,700	856,503.00	0.21
120	002230	科大讯飞	20,700	853,254.00	0.21
121	000661	长春高新	3,600	840,312.00	0.20
122	02313	申洲国际	10,200	829,158.00	0.20
123	002459	晶澳科技	10,480	826,872.00	0.20
124	300450	先导智能	12,260	774,586.80	0.19
125	688599	天合光能	11,800	769,950.00	0.19
126	601211	国泰君安	50,200	763,040.00	0.18
127	002027	分众传媒	112,800	759,144.00	0.18
128	000338	潍柴动力	60,700	756,929.00	0.18
129	00066	港铁公司	21,500	753,790.00	0.18
130	06618	京东健康	14,250	750,120.00	0.18
131	000100	TCL 科技	156,500	749,635.00	0.18
132	601169	北京银行	165,100	749,554.00	0.18
133	600660	福耀玻璃	17,800	744,218.00	0.18
134	00006	电能实业	17,500	738,500.00	0.18
135	01093	石药集团	110,000	732,600.00	0.18
136	601229	上海银行	110,900	726,395.00	0.17
137	601985	中国核电	105,000	720,300.00	0.17
138	06098	碧桂园服务	24,000	717,360.00	0.17
139	600050	中国联通	207,300	717,258.00	0.17
140	600745	闻泰科技	8,300	706,413.00	0.17
141	601766	中国中车	135,800	706,160.00	0.17
142	601390	中国中铁	114,600	703,644.00	0.17
143	01997	九龙仓置业	22,000	703,560.00	0.17
144	600522	中天科技	30,400	702,240.00	0.17
145	03800	协鑫科技	213,000	690,120.00	0.17
146	600893	航发动力	15,000	682,650.00	0.16
147	00267	中信股份	100,000	680,000.00	0.16
148	601669	中国电建	85,200	670,524.00	0.16
149	00968	信义光能	64,000	663,040.00	0.16
150	00881	中升控股	14,000	662,620.00	0.16
151	300347	泰格医药	5,700	652,365.00	0.16
152	603659	璞泰来	7,520	634,688.00	0.15
153	01821	ESR	35,000	634,550.00	0.15
154	601615	明阳智能	18,700	632,060.00	0.15

155	000776	广发证券	33,000	617,100.00	0.15
156	600009	上海机场	10,700	606,690.00	0.15
157	600905	三峡能源	95,700	601,953.00	0.14
158	300896	爱美客	1,000	600,010.00	0.14
159	601009	南京银行	57,500	599,150.00	0.14
160	600019	宝钢股份	99,300	597,786.00	0.14
161	600010	包钢股份	254,200	597,370.00	0.14
162	600958	东方证券	58,436	596,631.56	0.14
163	600196	复星医药	13,500	595,215.00	0.14
164	600999	招商证券	41,300	595,133.00	0.14
165	01928	金沙中国有限公司	36,400	582,764.00	0.14
166	002410	广联达	10,600	577,064.00	0.14
167	000733	振华科技	4,200	571,074.00	0.14
168	600570	恒生电子	13,060	568,632.40	0.14
169	000895	双汇发展	19,200	562,560.00	0.14
170	02328	中国财险	80,000	558,400.00	0.13
171	601818	光大银行	184,400	555,044.00	0.13
172	002179	中航光电	8,760	554,683.20	0.13
173	002311	海大集团	9,200	552,092.00	0.13
174	002050	三花智控	20,000	549,600.00	0.13
175	01177	中国生物制药	125,000	531,250.00	0.13
176	00868	信义玻璃	33,000	530,970.00	0.13
177	00992	联想集团	84,000	526,680.00	0.13
178	600346	恒力石化	23,600	524,864.00	0.13
179	600760	中航沈飞	8,680	524,706.00	0.13
180	00288	万洲国际	101,000	523,180.00	0.13
181	002493	荣盛石化	33,900	521,721.00	0.13
182	002821	凯莱英	1,800	520,200.00	0.13
183	300661	圣邦股份	2,850	518,757.00	0.12
184	300782	卓胜微	3,840	518,400.00	0.12
185	300759	康龙化成	5,350	509,427.00	0.12
186	002074	国轩高科	11,100	506,160.00	0.12
187	00268	金蝶国际	32,000	503,680.00	0.12
188	600926	杭州银行	33,100	495,838.00	0.12
189	300496	中科创达	3,800	495,824.00	0.12
190	01801	信达生物	16,500	492,525.00	0.12
191	688012	中微公司	4,200	490,350.00	0.12
192	600460	士兰微	9,400	488,800.00	0.12
193	600426	华鲁恒升	16,670	486,764.00	0.12

194	002340	格林美	53,300	485,030.00	0.12
195	000799	酒鬼酒	2,600	483,106.00	0.12
196	00322	康师傅控股	42,000	482,580.00	0.12
197	300316	晶盛机电	7,100	479,889.00	0.12
198	000538	云南白药	7,940	479,496.60	0.12
199	001979	招商蛇口	35,400	475,422.00	0.11
200	000596	古井贡酒	1,900	474,354.00	0.11
201	000768	中航西飞	15,600	472,524.00	0.11
202	601989	中国重工	127,300	472,283.00	0.11
203	002001	新和成	20,628	470,524.68	0.11
204	600176	中国巨石	26,890	468,154.90	0.11
205	002920	德赛西威	3,100	458,800.00	0.11
206	002202	金风科技	30,700	454,360.00	0.11
207	00012	恒基地产	18,000	452,520.00	0.11
208	603993	洛阳钼业	78,900	452,097.00	0.11
209	00788	中国铁塔	520,000	447,200.00	0.11
210	02007	碧桂园	106,000	440,960.00	0.11
211	00004	九龙仓集团	18,000	440,280.00	0.11
212	000963	华东医药	9,700	438,052.00	0.11
213	601006	大秦铁路	66,300	436,917.00	0.11
214	600763	通策医疗	2,500	436,100.00	0.10
215	601138	工业富联	44,300	435,912.00	0.10
216	00083	信和置业	44,000	435,600.00	0.10
217	06969	思摩尔国际	21,000	434,700.00	0.10
218	300012	华测检测	18,700	434,027.00	0.10
219	00017	新世界发展	18,000	433,260.00	0.10
220	600584	长电科技	16,000	432,000.00	0.10
221	000166	申万宏源	100,600	431,574.00	0.10
222	601877	正泰电器	12,000	429,360.00	0.10
223	300207	欣旺达	13,500	426,600.00	0.10
224	01929	周大福	33,600	424,032.00	0.10
225	601377	兴业证券	59,900	422,295.00	0.10
226	601066	中信建投	14,600	422,086.00	0.10
227	600600	青岛啤酒	4,000	415,680.00	0.10
228	601600	中国铝业	87,500	415,625.00	0.10
229	600588	用友网络	19,100	414,661.00	0.10
230	688111	金山办公	2,100	413,952.00	0.10
231	600029	南方航空	56,600	413,746.00	0.10
232	600383	金地集团	30,100	404,544.00	0.10
233	601186	中国铁建	51,200	404,480.00	0.10
234	600188	兖矿能源	10,200	402,696.00	0.10

235	600741	华域汽车	17,500	402,500.00	0.10
236	600085	同仁堂	7,600	401,888.00	0.10
237	688005	容百科技	3,100	401,264.00	0.10
238	601838	成都银行	24,200	401,236.00	0.10
239	06186	中国飞鹤	52,000	400,920.00	0.10
240	00151	中国旺旺	68,000	396,440.00	0.10
241	600132	重庆啤酒	2,700	395,820.00	0.10
242	002180	纳思达	7,800	394,836.00	0.09
243	300751	迈为股份	800	392,720.00	0.09
244	000786	北新建材	11,300	391,206.00	0.09
245	300408	三环集团	12,900	388,290.00	0.09
246	01876	百威亚太	19,300	387,930.00	0.09
247	601111	中国国航	33,300	386,613.00	0.09
248	000876	新希望	25,200	385,560.00	0.09
249	601117	中国化学	40,800	383,928.00	0.09
250	603806	福斯特	5,828	381,850.56	0.09
251	600885	宏发股份	9,100	380,835.00	0.09
252	603019	中科曙光	13,100	380,162.00	0.09
253	600150	中国船舶	19,900	377,702.00	0.09
254	601238	广汽集团	24,700	376,428.00	0.09
255	600547	山东黄金	20,100	373,056.00	0.09
256	03323	中国建材	52,000	372,840.00	0.09
257	01193	华润燃气	11,900	371,994.00	0.09
258	003816	中国广核	131,600	368,480.00	0.09
259	601800	中国交建	39,200	363,776.00	0.09
260	300763	锦浪科技	1,700	362,100.00	0.09
261	600989	宝丰能源	24,600	360,390.00	0.09
262	600884	杉杉股份	12,100	359,612.00	0.09
263	600015	华夏银行	68,700	357,927.00	0.09
264	688396	华润微	6,000	354,420.00	0.09
265	002384	东山精密	15,400	353,122.00	0.08
266	603369	今世缘	6,900	351,900.00	0.08
267	601100	恒立液压	5,700	351,804.00	0.08
268	300999	金龙鱼	6,500	351,130.00	0.08
269	002648	卫星化学	13,532	349,802.20	0.08
270	600886	国投电力	33,300	349,650.00	0.08
271	01038	长江基建集团	8,500	349,605.00	0.08
272	601689	拓普集团	5,100	348,993.00	0.08
273	00998	中信银行	116,000	348,000.00	0.08
274	000723	美锦能源	28,500	347,700.00	0.08

275	600011	华能国际	49,200	346,368.00	0.08
276	603185	上机数控	2,220	346,297.80	0.08
277	00101	恒隆地产	27,000	343,710.00	0.08
278	601868	中国能建	144,700	342,939.00	0.08
279	000157	中联重科	55,400	341,264.00	0.08
280	01548	金斯瑞生物科技	14,000	340,620.00	0.08
281	300601	康泰生物	7,440	336,139.20	0.08
282	600115	中国东航	61,000	334,890.00	0.08
283	000301	东方盛虹	19,800	334,818.00	0.08
284	601788	光大证券	21,200	334,112.00	0.08
285	603833	欧派家居	2,200	331,496.00	0.08
286	03888	金山软件	12,600	329,742.00	0.08
287	000425	徐工机械	61,000	328,790.00	0.08
288	002236	大华股份	20,000	328,400.00	0.08
289	600754	锦江酒店	5,200	327,080.00	0.08
290	02618	京东物流	22,200	325,008.00	0.08
291	603392	万泰生物	2,091	324,732.30	0.08
292	002601	龙佰集团	16,100	322,805.00	0.08
293	300595	欧普康视	5,600	320,264.00	0.08
294	01378	中国宏桥	42,000	318,780.00	0.08
295	09992	泡泡玛特	9,800	317,618.00	0.08
296	603486	科沃斯	2,600	316,914.00	0.08
297	605358	立昂微	4,700	316,686.00	0.08
298	603816	顾家家居	5,590	316,561.70	0.08
299	002555	三七互娱	14,900	316,327.00	0.08
300	600233	圆通速递	15,400	314,006.00	0.08
301	000938	紫光股份	16,100	312,340.00	0.08
302	601555	东吴证券	44,690	309,701.70	0.07
303	688008	澜起科技	5,100	308,958.00	0.07
304	603290	斯达半导	800	308,720.00	0.07
305	601901	方正证券	46,000	308,660.00	0.07
306	002008	大族激光	9,300	308,109.00	0.07
307	002736	国信证券	32,100	307,197.00	0.07
308	00586	海螺创业	21,000	307,020.00	0.07
309	00836	华润电力	22,000	304,700.00	0.07
310	300628	亿联网络	4,000	304,600.00	0.07
311	01308	海丰国际	16,000	303,840.00	0.07
312	000977	浪潮信息	11,400	301,872.00	0.07
313	688180	君实生物	4,000	301,360.00	0.07
314	300454	深信服	2,900	300,962.00	0.07

315	601336	新华保险	9,300	299,367.00	0.07
316	06862	海底捞	19,000	297,350.00	0.07
317	000069	华侨城 A	45,800	297,242.00	0.07
318	601233	桐昆股份	18,700	296,956.00	0.07
319	600219	南山铝业	80,000	295,200.00	0.07
320	603260	合盛硅业	2,500	294,900.00	0.07
321	002385	大北农	37,100	289,751.00	0.07
322	300363	博腾股份	3,700	288,563.00	0.07
323	00241	阿里健康	62,000	286,440.00	0.07
324	601108	财通证券	36,380	286,310.60	0.07
325	002841	视源股份	3,800	286,216.00	0.07
326	00135	昆仑能源	52,000	286,000.00	0.07
327	603345	安井食品	1,700	285,379.00	0.07
328	601995	中金公司	6,400	284,736.00	0.07
329	600845	宝信软件	5,210	284,466.00	0.07
330	01044	恒安国际	9,000	283,590.00	0.07
331	688099	晶晨股份	2,800	282,800.00	0.07
332	601799	星宇股份	1,652	282,492.00	0.07
333	688536	思瑞浦	500	280,795.00	0.07
334	300529	健帆生物	5,500	279,895.00	0.07
335	601618	中国中冶	79,700	278,950.00	0.07
336	002007	华兰生物	12,200	278,160.00	0.07
337	002120	韵达股份	16,300	278,078.00	0.07
338	300413	芒果超媒	8,300	276,888.00	0.07
339	688126	沪硅产业	11,900	273,462.00	0.07
340	601360	三六零	31,500	268,380.00	0.06
341	002013	中航机电	21,700	267,995.00	0.06
342	002252	上海莱士	45,100	267,443.00	0.06
343	300144	宋城演艺	17,400	267,090.00	0.06
344	01209	华润万象生活	8,000	266,160.00	0.06
345	300003	乐普医疗	14,200	263,694.00	0.06
346	600298	安琪酵母	5,400	263,250.00	0.06
347	300919	中伟股份	2,100	260,190.00	0.06
348	000703	恒逸石化	24,600	258,546.00	0.06
349	601155	新城控股	10,100	256,843.00	0.06
350	603882	金域医学	3,100	255,905.00	0.06
351	601077	渝农商行	69,100	255,670.00	0.06
352	000783	长江证券	43,100	255,583.00	0.06
353	00384	中国燃气	24,600	254,856.00	0.06
354	300146	汤臣倍健	11,400	246,810.00	0.06

355	600332	白云山	7,800	246,402.00	0.06
356	601696	中银证券	18,500	246,050.00	0.06
357	601878	浙商证券	21,600	245,808.00	0.06
358	300433	蓝思科技	22,200	245,754.00	0.06
359	01066	威高股份	31,200	243,360.00	0.06
360	603517	绝味食品	4,200	242,844.00	0.06
361	002602	世纪华通	50,000	241,000.00	0.06
362	688036	传音控股	2,700	240,921.00	0.06
363	603589	口子窖	4,100	240,301.00	0.06
364	00019	太古股份公 司A	6,000	239,880.00	0.06
365	600918	中泰证券	31,000	237,150.00	0.06
366	002185	华天科技	25,100	235,438.00	0.06
367	300223	北京君正	2,200	233,750.00	0.06
368	000066	中国长城	21,600	233,712.00	0.06
369	600674	川投能源	19,600	233,632.00	0.06
370	603737	三棵树	1,800	232,974.00	0.06
371	002938	鹏鼎控股	7,700	232,617.00	0.06
372	601727	上海电气	56,500	232,215.00	0.06
373	300033	同花顺	2,400	230,760.00	0.06
374	603899	晨光股份	4,100	229,928.00	0.06
375	601636	旗滨集团	17,900	228,225.00	0.05
376	00144	招商局港口	20,000	228,200.00	0.05
377	000708	中信特钢	11,300	227,695.00	0.05
378	601728	中国电信	60,800	226,784.00	0.05
379	600109	国金证券	25,100	225,900.00	0.05
380	002916	深南电路	2,400	224,904.00	0.05
381	601607	上海医药	12,400	224,192.00	0.05
382	01972	太古地产	13,400	223,244.00	0.05
383	00285	比亚迪电子	10,500	222,285.00	0.05
384	00762	中国联通	70,000	221,900.00	0.05
385	600183	生益科技	13,000	220,870.00	0.05
386	002624	完美世界	15,300	219,861.00	0.05
387	300957	贝泰妮	1,000	217,530.00	0.05
388	03692	翰森制药	16,000	216,800.00	0.05
389	603939	益丰药房	4,040	213,433.20	0.05
390	00270	粤海投资	30,000	213,000.00	0.05
391	601898	中煤能源	20,400	211,752.00	0.05
392	600018	上港集团	36,300	211,629.00	0.05
393	601865	福莱特	5,500	209,550.00	0.05
394	002791	坚朗五金	1,600	207,552.00	0.05

395	600705	中航产融	59,800	206,908.00	0.05
396	600362	江西铜业	11,600	206,828.00	0.05
397	601990	南京证券	24,700	205,998.00	0.05
398	600779	水井坊	2,200	203,588.00	0.05
399	002080	中材科技	7,400	203,500.00	0.05
400	300676	华大基因	2,800	200,760.00	0.05
401	00853	微创医疗	10,300	200,438.00	0.05
402	002673	西部证券	29,800	194,892.00	0.05
403	002508	老板电器	5,300	190,959.00	0.05
404	600143	金发科技	20,000	190,400.00	0.05
405	002414	高德红外	14,724	189,497.88	0.05
406	00772	阅文集团	5,800	187,978.00	0.05
407	688169	石头科技	300	185,010.00	0.04
408	600161	天坛生物	7,600	184,528.00	0.04
409	601216	君正集团	37,800	184,464.00	0.04
410	000728	国元证券	29,100	181,002.00	0.04
411	601319	中国人保	35,700	180,642.00	0.04
412	688185	康希诺	900	179,172.00	0.04
413	00316	东方海外国 际	1,000	177,880.00	0.04
414	000408	藏格矿业	5,400	177,876.00	0.04
415	06110	滔搏	29,000	176,900.00	0.04
416	00656	复星国际	28,500	176,700.00	0.04
417	600803	新奥股份	9,500	176,605.00	0.04
418	00884	旭辉控股集 团	52,000	175,240.00	0.04
419	01691	J S 环球生 活	20,000	174,800.00	0.04
420	600079	人福医药	10,900	174,400.00	0.04
421	603893	瑞芯微	1,900	172,786.00	0.04
422	688363	华熙生物	1,200	170,616.00	0.04
423	300558	贝达药业	2,800	170,240.00	0.04
424	01579	颐海国际	7,000	169,400.00	0.04
425	002568	百润股份	5,580	167,623.20	0.04
426	600372	中航电子	8,600	166,754.00	0.04
427	01999	敏华控股	22,800	165,300.00	0.04
428	601966	玲珑轮胎	6,500	164,905.00	0.04
429	300832	新产业	3,600	162,396.00	0.04
430	00909	明源云	15,000	161,100.00	0.04
431	601198	东兴证券	17,900	159,310.00	0.04
432	002600	领益智造	31,500	158,130.00	0.04

433	01918	融创中国	40,000	156,800.00	0.04
434	01313	华润水泥控股	34,000	153,340.00	0.04
435	003022	联泓新科	4,600	152,858.00	0.04
436	00754	合生创展集团	14,630	149,957.50	0.04
437	600038	中直股份	3,300	149,160.00	0.04
438	600369	西南证券	37,200	147,684.00	0.04
439	02588	中银航空租赁	2,500	141,000.00	0.03
440	601881	中国银河	14,500	140,215.00	0.03
441	002064	华峰化学	16,600	140,104.00	0.03
442	600025	华能水电	20,000	139,800.00	0.03
443	603233	大参林	4,424	138,471.20	0.03
444	000050	深天马A	13,800	137,586.00	0.03
445	00966	中国太平	16,400	135,792.00	0.03
446	300677	英科医疗	5,351	135,701.36	0.03
447	300866	安克创新	2,000	132,640.00	0.03
448	02018	瑞声科技	8,500	131,240.00	0.03
449	02689	玖龙纸业	23,000	130,640.00	0.03
450	688187	时代电气	2,000	129,980.00	0.03
451	01833	平安好医生	6,400	127,232.00	0.03
452	603087	甘李药业	2,600	124,722.00	0.03
453	002607	中公教育	20,600	119,274.00	0.03
454	000987	越秀金控	16,810	118,174.30	0.03
455	06993	蓝月亮集团	20,500	117,465.00	0.03
456	603707	健友股份	4,150	117,030.00	0.03
457	00293	国泰航空	15,000	110,250.00	0.03
458	002153	石基信息	6,904	109,566.48	0.03
459	06666	恒大物业	53,500	105,395.00	0.03
460	601231	环旭电子	7,300	104,828.00	0.03
461	002939	长城证券	10,100	102,616.00	0.02
462	605499	东鹏饮料	600	102,516.00	0.02
463	002032	苏泊尔	1,800	101,412.00	0.02
464	300888	稳健医疗	1,500	99,750.00	0.02
465	000800	一汽解放	10,400	97,136.00	0.02
466	601808	中海油服	6,500	90,675.00	0.02
467	01128	永利澳门	18,000	82,080.00	0.02
468	000877	天山股份	6,600	81,180.00	0.02
469	300979	华利集团	1,000	73,080.00	0.02
470	06808	高鑫零售	32,500	70,850.00	0.02

471	00813	世茂集团	18,000	68,040.00	0.02
472	601825	沪农商行	10,700	67,089.00	0.02
473	01516	融创服务	15,000	61,200.00	0.01
474	06699	时代天使	400	53,776.00	0.01
475	03380	龙光集团	22,000	40,920.00	0.01
476	001289	龙源电力	1,700	36,992.00	0.01
477	03333	中国恒大	25,000	35,250.00	0.01

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资 明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	01114	BRILLIANCE CHI	72,000	449,280.00	0.11
2	688150	莱特光电	5,626	110,269.60	0.03
3	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
4	301201	诚达药业	303	21,676.62	0.01
5	301162	国能日新	334	18,072.74	0.00
6	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.00
7	301150	中一科技	180	14,896.80	0.00
8	301200	大族数控	286	14,849.12	0.00
9	301206	三元生物	295	13,478.55	0.00
10	301219	腾远钴业	144	12,646.08	0.00
11	301123	奕东电子	430	10,917.70	0.00
12	300834	星辉环材	314	9,429.42	0.00
13	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
14	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
15	301196	唯科科技	187	7,016.24	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	000792	盐湖股份	1,566,103.00	0.32
2	00700	腾讯控股	1,522,651.53	0.31
3	02015	理想汽车-W	1,489,192.10	0.30
4	002466	天齐锂业	1,318,061.00	0.27
5	09868	小鹏汽车-W	1,254,103.44	0.26
6	600519	贵州茅台	740,836.00	0.15
7	01024	快手-W	703,359.63	0.14
8	03800	协鑫科技	625,973.10	0.13

9	01299	友邦保险	551,673.65	0.11
10	00005	汇丰控股	548,520.19	0.11
11	000733	振华科技	533,210.00	0.11
12	601615	明阳智能	505,491.00	0.10
13	600941	中国移动	338,518.00	0.07
13	00941	中国移动	128,302.54	0.03
14	002340	格林美	448,843.00	0.09
15	02359	药明康德	384,701.62	0.08
15	603259	药明康德	56,460.00	0.01
16	00939	建设银行	419,062.57	0.09
16	601939	建设银行	13,940.00	0.00
17	688220	翱捷科技	422,867.80	0.09
18	300012	华测检测	406,547.00	0.08
19	688213	思特威-W	387,257.90	0.08
20	688062	迈威生物	378,658.80	0.08

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	00700	腾讯控股	4,697,171.59	0.96
2	03690	美团-W	3,922,201.31	0.80
3	00005	汇丰控股	1,940,357.08	0.40
4	01299	友邦保险	1,766,221.88	0.36
5	00939	建设银行	1,252,305.22	0.26
5	601939	建设银行	28,656.00	0.01
6	300750	宁德时代	1,232,958.00	0.25
7	02318	中国平安	636,871.47	0.13
7	601318	中国平安	337,118.00	0.07
8	01398	工商银行	730,306.05	0.15
8	601398	工商银行	114,636.00	0.02
9	002594	比亚迪	536,487.00	0.11
9	01211	比亚迪	269,655.43	0.06
10	00388	香港交易所	761,605.94	0.16
11	09618	京东集团-SW	726,237.17	0.15
12	000858	五粮液	661,403.00	0.14
13	600036	招商银行	341,258.00	0.07
13	03968	招商银行	312,027.52	0.06
14	688213	思特威-W	618,336.84	0.13
15	600887	伊利股份	566,710.00	0.12

16	600519	贵州茅台	559,206.00	0.11
17	000333	美的集团	541,150.00	0.11
18	688223	晶科能源	534,452.71	0.11
19	03988	中国银行	468,461.11	0.10
19	601988	中国银行	47,040.00	0.01
20	00941	中国移动	487,664.38	0.10

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	41,941,458.96
卖出股票收入（成交）总额	64,993,027.42

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）	53,824.35	0.01
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	53,824.35	0.01

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	113060	浙22转债	360	36,002.68	0.01
2	113059	福莱转债	140	17,821.67	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将基于谨慎原则运用股指期货、国债期货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。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

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

本基金将基于谨慎原则运用股指期货、国债期货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。本基金将充分考虑国债期货流动性和风险收益特征，在风险可控的基础上，以套期保值为目的，参与国债期货的投资，以降低跟踪误差。

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 申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，美团在报告编制日前一年内曾受到国家市场监督管理总局的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，腾讯控股有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家市场监督管理总局的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会、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 申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	5,263.03
2	应收清算款	—
3	应收股利	1,144,899.15
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	应计出借证券利息	117.62
9	其他	—
10	合计	1,150,279.80

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688150	莱特光电	110,269.60	0.03	新股限售
2	301201	诚达药业	21,676.62	0.01	新股限售
3	301162	国能日新	18,072.74	0.00	新股限售

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

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		富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
8,012	63,417.64	148,481,375.00	29.22	359,620,750.00	70.78	97,648,300.00	19.22

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	都邦财产保险股份有限公司—自有资金	20,000,000.00	3.94
2	于炳歧	10,000,000.00	1.97
3	BARCLAYS BANK PLC	5,218,239.00	1.03
4	张剑	5,000,000.00	0.98
5	中信建投证券股份有限公司	4,339,873.00	0.85
6	中信证券股份有限公司	4,337,038.00	0.85
7	徐亚英	3,500,000.00	0.69
8	薛宏飞	3,500,000.00	0.69
9	北京中洲禾源投资咨询有限公司	3,000,000.00	0.59
10	陈琪	3,000,000.00	0.59
11	富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	97,648,300.00	19.22

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理公司所有从业人员持有本基金	—	—

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

本基金基金经理持有本开放式基金	0
-----------------	---

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2021年02月09日)基金份额总额	787,102,125.00
报告期期初基金份额总额	557,602,125.00
本报告期基金总申购份额	4,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	54,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	508,102,125.00

§ 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

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		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 (%)	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 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
长江证券	3	8,266,986.77	8.31	—	—	—	—	—	—	7,615.03	16.98	—
诚通证券	2	615,563.51	0.62	14,512.50	4.50	—	—	—	—	561.39	1.25	—
东方证券	2	906,921.88	0.91	—	—	—	—	—	—	826.47	1.84	—
东吴证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
方正证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
广发证券	2	15,302,856.84	15.38	—	—	—	—	—	—	14,097.81	31.43	—
国盛证券	2	13,049,354.79	13.12	89,083.70	27.63	—	—	—	—	12,010.83	26.77	—
海通证券	2	29,778,770.80	29.93	—	—	—	—	10,374.54	100.00	1,627.15	3.63	—
华泰证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
华西证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
民生证券	1	63,387.37	0.06	—	—	—	—	—	—	58.02	0.13	—
申港证券	2	22,916,941.00	23.03	—	—	—	—	—	—	185.01	0.41	—
申万宏源	2	966,684.10	0.97	—	—	—	—	—	—	887.56	1.98	—
太平洋证券	2	716,619.75	0.72	117,213.00	36.35	—	—	—	—	653.41	1.46	—

银河证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
浙商证券	2	1,164,113.52	1.17	87,791.50	27.22	—	—	—	—	1,060.88	2.36	—
中金公司	2	1,068,996.62	1.07	—	—	—	—	—	—	974.45	2.17	—
中信建投	2	4,289,864.70	4.31	—	—	—	—	—	—	3,949.33	8.80	—
中信证券	2	382,691.10	0.38	13,873.12	4.30	—	—	—	—	351.89	0.78	—

注：我对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。本报告期本基金新增券商交易单元：东吴证券（002546、37910），民生证券（000132），方正证券（014091）。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	富国基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具准则的公告	规定披露媒介	2022年01月01日
2	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2022年01月07日
3	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2022年01月07日
4	关于富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金扩位简称变更的公告	规定披露媒介	2022年01月25日
5	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2022年02月10日
6	关于富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金投资关联方承销证券的公告	规定披露媒介	2022年03月29日
7	富国基金管理有限公司关于旗下管理的上海证券交易所上市 ETF 实施申赎业务多码合一的公告	规定披露媒介	2022年06月16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，经向上海证券交易所申请并获得同意，基金管理人决定自 2022 年 1 月 26 日起将本基金的基金扩位简称由“沪深港 500ETF”变更为“AH500ETF”。具体可参见基金管理人于 2022 年 1 月 25 日发布的《关于富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金扩位简称变更的公告》。

二、本报告期内，根据《关于上海证券交易所 ETF 申赎业务多码合一及迁移上线切换有关事项的通知》，自 2022 年 6 月 20 日起，本基金将取消申赎业务相关代码，投资者可通过 ETF 基金的证券代码（与交易使用的证券代码相同），选择申赎相关业务类型，参与 ETF 申赎业务。具体可参见基金管理人于 2022 年 6 月 16 日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下管理的上海证券交易所上市 ETF 实施申赎业务多码合一的公告》。

§ 12 备查文件目录

备查文件名称	备查文件存放地点	备查文件查阅方式
1、中国证监会批准设立富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金的文件 2、富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同 3、富国中证沪港深 500 交易型开放式指数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、富国中证沪港深 500 交易型开放式指数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） 公司地址： http://www.fullgoal.com.cn 。