

富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

二〇二三年中期报告

2023 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： 2023 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 2023 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 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§2	基金简介	6
2.1	基金基本情况	6
2.2	基金产品说明	6
2.3	基金管理人和基金托管人	6
2.4	信息披露方式	7
2.5	其他相关资料	7
§3	主要财务指标和基金净值表现	8
3.1	主要会计数据和财务指标	8
3.2	基金净值表现	8
§4	管理人报告	10
4.1	基金管理人及基金经理情况	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	13
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	14
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	15
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	20
§7	投资组合报告	55
7.1	期末基金资产组合情况	55

7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	55
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.....	57
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	71
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	73
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.....	73
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.....	73
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.....	73
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.....	73
7.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	73
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	74
7.12	投资组合报告附注.....	74
§8	基金份额持有人信息.....	77
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	77
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	77
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	77
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.....	77
§9	开放式基金份额变动.....	78
§10	重大事件揭示.....	79
10.1	基金份额持有人大会决议.....	79
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.....	79
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	79
10.4	基金投资策略的改变.....	79
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	79
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.....	79
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	79
10.8	其他重大事件.....	82
§11	影响投资者决策的其他重要信息.....	83
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.....	83
§12	备查文件目录.....	84

§ 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	458,602,125.00 份
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	010-66596688
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.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	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披 露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正 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(2023年01月01日至2023年06月30日)
本期已实现收益	-10,102,104.15
本期利润	2,571,717.11
加权平均基金份额本期利润	0.0053
本期加权平均净值利润率	0.70%
本期基金份额净值增长率	0.65%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年06月30日)
期末可供分配利润	-115,965,919.86
期末可供分配基金份额利润	-0.2529
期末基金资产净值	342,636,205.14
期末基金份额净值	0.7471
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年06月30日)
基金份额累计净值增长率	-25.29%

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	3.78%	0.97%	3.09%	0.93%	0.69%	0.04%
过去三个月	-2.72%	0.89%	-3.68%	0.87%	0.96%	0.02%
过去六个月	0.65%	0.91%	-0.90%	0.88%	1.55%	0.03%
过去一年	-8.70%	1.11%	-11.31%	1.08%	2.61%	0.03%
自基金合同	-25.29%	1.21%	-31.10%	1.20%	5.81%	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2023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情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

富国基金管理有限公司于 1999 年 4 月 13 日获国家工商行政管理局登记注册成立，是经中国证监会批准设立的首批十家基金管理公司之一。公司于 2001 年 3 月从北京迁址上海。2003 年 9 月，加拿大蒙特利尔银行（BMO）参股富国基金管理有限公司的工商变更登记办理完毕，富国基金管理有限公司成为国内首批成立的十家基金公司中，第一家中外合资的基金管理公司。

目前，公司注册资本金 5.2 亿元人民币，股东为：海通证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、加拿大蒙特利尔银行及山东省金融资产管理股份有限公司。公司在北京、成都、广州设立有分公司，并全资设有两家子公司——富国资产管理（上海）有限公司和富国资产管理（香港）有限公司。公司拥有公募基金、特定客户资产管理、QDII、社保、企业年金、基本养老保险基金等基金公司全部业务牌照。

截至 2023 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国新兴产业股票型证券投资基金、富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、富国天利增长债券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国中债-1-3 年国开行债券指数证券投资基金、富国全球科技互联网股票型证券投资基金（QDII）、富国鑫旺稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、富国富钱包货币市场基金、富国首创水务封闭式基础设施证券投资基金等 304 只公开募集证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
田希蒙	本基金现任基金经理	2023-03-03	—	6	硕士，自 2017 年 5 月加入富国基金管理有限公司，历任助理定量研究员、定量研究员、定量投资经理；现任富国基金量化投资部定量基金经理。自 2023 年 01 月起任富

					<p>国中证港股通互联网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；自 2023 年 01 月起任富国中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2023 年 03 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基金经理；自 2023 年 03 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；自 2023 年 04 月起任富国恒生港股通高股息低波动交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理；自 2023 年 06 月起任富国恒生港股通医疗保健交易型开放式指数证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。</p>
张圣贤	本基金前任基金经理	2021-02-09	2023-03-03	16	<p>硕士，曾任上海申银万国证券研究所有限公司分析师；自 2015 年 3 月加入富国基金管理有限公司，历任基金经理助理、定量基金经理、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。自 2015 年 06 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)基金经理；自 2015 年 06 月起任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)基金经理；自 2015 年 08 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)基金经理；自 2015 年 08 月起任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)基金经理；自 2016 年 02 月起任富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）基金经理；自 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)基金经理；自 2020 年 04 月起任富国中证银行交</p>

					易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 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基金经理；自 2020 年 12 月起任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；自 2021 年 06 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；自 2021 年 08 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；自 2022 年 01 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；自 2022 年 01 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；自 2022 年 06 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；自 2022 年 08 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联接基金基金经理；自 2023 年 03 月起任富国中证绿色电力交易型开放式指数证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。
--	--	--	--	--	---

注：1、上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、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，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现1次同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

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

年初以来，随着主要城市疫情高峰过去，疫情对经济的冲击逐步减小，投资者对 2023 年经济复苏预期变动更加乐观，A 股迎来开门红。进入 3 月，由于两会政府工作报告公布的 GDP 增速目标低于市场预期，市场迎来一轮快速调整。海外方面，美国公布的 2 月通胀数据超预期，加息预期再次升温，全球资本市场迎来调整。4 月以来，尽管 1-2 月工业企业利润下降一度压制市场情绪，但 3 月 PMI 验证经济进一步向好，提振市场信心。在经济弱复苏，流动性宽裕的背景下，人工智能相关板块迎来加速上涨。石油化工、建筑等板块在中特估及一带一路等主题概念的驱动下也迎来靓丽表现。进入 5 月中旬，由于金融、通胀数据均回落，指向经济内生动能不强，复苏斜率放缓压制市场情绪，同时海外银行业危机和债务违约风险持续发酵，引发市场担忧加剧，各板块均迎来快速调整。6 月初，虽然国内方面经济数据维持弱势，但结构性政策开始落地，结合外资巨头接连访华为经济注入新动力，提振市场信心。6 月下旬，随着短期宏观政策兑现，同时部分 TMT 公司涨幅过大，投资者选择获利了结，叠加人民币进一步贬值及节前避险情绪升温，A 股迎来调整。

总体来看，2023 年上半年上证综指上涨 3.65%，沪深 300 下跌 0.75%，创业板指下跌 5.61%，中证 500 指数上涨 2.29%。

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 2023 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.7471 元；份额累计净值为 0.7471 元；本报告期，本基金份额净值增长率为 0.65%，同期业绩比较基准收益率为-0.90%。

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 2023 下半年，积极因素正进一步累积，悲观预期将逐步修正。首先，外部的扰动将逐步缓解。当前市场已将 7 月美联储会议的加息预期较充分地计入，并且后续 8 月没有美联储议息会议的情况下，市场将阶段性进入鹰派信息的“空窗期”，来自美债利率上行、汇率贬值等外部压力已在缓和。其次，6 月份

多项经济数据已经止跌企稳、甚至拐头向上，市场对于经济增长的悲观预期仍有逐步修正。2 季度 GDP 数据虽略不及预期，但 6 月经济数据已经边际回暖。生产端，尽管工业增加值、服务业生产指数两年复合增速仍低于疫情前水平，但 5-6 月已出现持续改善。消费端，边际上居民收入改善，5-6 月商品消费加速。投资端，基建、制造业投资维持强势。近期各项经济政策也在密集加码落地，如促进家居消费若干措施、促民营经济、城中村改造等政策密集加码。此外，当前市场本身仍处在一个隐含风险溢价较高、多数行业拥挤度较低的位置，具备整体修复的空间。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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：2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	3,971,571.48	1,732,014.16
结算备付金	8,037.96	9,928.23
存出保证金	6,382.37	5,730.48
交易性金融资产	339,290,988.40	365,677,645.07
其中：股票投资	339,290,988.40	365,661,277.09
基金投资	—	—
债券投资	—	16,367.98
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	—	—
应收股利	792,322.10	15,208.91
应收申购款	—	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	1,981.46	990.88
资产总计	344,071,283.77	367,441,517.73
负债和净资产	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 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	1,098,799.56	32.41
应付赎回款	—	—
应付管理人报酬	141,356.07	155,694.43
应付托管费	28,271.21	31,138.89
应付销售服务费	—	—
应付投资顾问费	—	—
应交税费	328.18	82.90

应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	166,323.61	93,188.69
负债合计	1,435,078.63	280,137.32
净资产：		
实收基金	458,602,125.00	494,602,125.00
其他综合收益	—	—
未分配利润	-115,965,919.86	-127,440,744.59
净资产合计	342,636,205.14	367,161,380.41
负债和净资产总计	344,071,283.77	367,441,517.73

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.7471 元，基金份额总额 458,602,125.00 份。

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：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日)	上年度可比期间 (2022 年 01 月 01 日 至 2022 年 06 月 30 日)
一、营业总收入	3,767,572.92	-32,157,931.46
1.利息收入	47,958.32	26,826.60
其中：存款利息收入	5,224.61	8,737.48
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	—	—
证券出借利息收入	42,733.71	18,089.12
其他利息收入	—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）	-8,921,079.83	-15,558,792.15
其中：股票投资收益	-13,326,110.71	-20,341,007.95
基金投资收益	—	—
债券投资收益	16,993.70	63,078.34
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	4,388,037.18	4,709,087.53
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）	12,673,821.26	-16,645,972.55
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—

5.其他收入（损失以“-”号填列）	-33,126.83	20,006.64
减：二、营业总支出	1,195,855.81	1,364,212.74
1. 管理人报酬	916,330.11	1,053,759.46
2. 托管费	183,266.05	210,751.85
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	153.79	101.51
8. 其他费用	96,105.86	99,599.92
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	2,571,717.11	-33,522,144.20
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	2,571,717.11	-33,522,144.20
五、其他综合收益的税后净额	—	—
六、综合收益总额	2,571,717.11	-33,522,144.20

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：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 (2023 年 01 月 01 日至 2023 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）	494,602,125.00	— 127,440,744.59	367,161,380.41
加：会计政策变更	—	—	—
二、本期期初净资产（基金净值）	494,602,125.00	— 127,440,744.59	367,161,380.41
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-36,000,000.00	11,474,824.73	-24,525,175.27
（一）、综合收益总额	—	2,571,717.11	2,571,717.11
（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）	-36,000,000.00	8,903,107.62	-27,096,892.38
其中：1. 基金申购款	9,000,000.00	-2,166,012.44	6,833,987.56
2. 基金赎回款	-45,000,000.00	11,069,120.06	-33,930,879.94
（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）	458,602,125.00	115,965,919.86	342,636,205.14
项目	上年度可比期间 (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

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向社会公开发行募集,基金合同于 2021 年 2 月 9 日正式生效,首次设立募集规模为 787,102,125.00 份基金份额。

本基金为交易型开放式，存续期限不定。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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号《年度报告和中期报告》》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 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

本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

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法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育费附加的单位外）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 (2023年06月30日)
活期存款	3,971,571.48
等于：本金	3,971,217.24

加：应计利息	354.24
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	3,971,571.48

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（2023 年 06 月 30 日）			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	438,733,398.90	—	339,290,988.40	99,442,410.50
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	438,733,398.90	—	339,290,988.40	99,442,410.50

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（2023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	1,981.46
合计	1,981.46

6.4.7.6其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2023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	14,562.71
其中：交易所市场	14,562.71
银行间市场	—
应付利息	—
预提信息披露费	60,000.00
预提审计费	61,843.91
IOPV 计算发布费	29,916.99
合计	166,323.61

6.4.7.7实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	494,602,125.00	494,602,125.00
本期申购	9,000,000.00	9,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-45,000,000.00	-45,000,000.00
本期末	458,602,125.00	458,602,125.00

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	—	—	—
	38,337,182.70	89,103,561.89	127,440,744.59
本期利润	—	12,673,821.26	2,571,717.11
	10,102,104.15		
本期基金份额交易产生	3,200,428.13	5,702,679.49	8,903,107.62

的变动数			
其中：基金申购款	-727,597.52	-1,438,414.92	-2,166,012.44
基金赎回款	3,928,025.65	7,141,094.41	11,069,120.06
本期已分配利润	—	—	—
本期末	45,238,858.72	70,727,061.14	115,965,919.86

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）
活期存款利息收入	4,302.46
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	866.35
其他	55.80
合计	5,224.61

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（2023年01月01日至2023年06月30日）
股票投资收益——买卖股票差价收入	-10,957,260.56
股票投资收益——赎回差价收入	-2,368,850.15
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	-13,326,110.71

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（2023年01月01日至2023年06月30日）
卖出股票成交总额	37,187,228.70
减：卖出股票成本总额	48,071,342.46
减：交易费用	73,146.80
买卖股票差价收入	-10,957,260.56

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（2023年01月01日至2023年06月30日）
赎回基金份额对价总额	33,930,879.94
减：现金支付赎回款总额	22,060,852.94
减：赎回股票成本总额	14,238,877.15
减：交易费用	—

赎回差价收入	-2,368,850.15
--------	---------------

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（2023年01月01日至2023年06月30日）
债券投资收益——利息收入	21.85
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	16,971.85
合计	16,993.70

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（2023年01月01日至2023年06月30日）
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	89,000.18
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	72,000.00
减：应计利息总额	24.77
减：交易费用	3.56
债券投资收益-差价收入	16,971.85

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.13 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无买卖贵金属交易。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）
股票投资产生的股利收益	4,388,037.18
其中：证券出借权益补偿收入	39,368.60
基金投资产生的股利收益	—
合计	4,388,037.18

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）
1. 交易性金融资产	12,673,821.26
股票投资	12,677,186.96
债券投资	-3,365.70
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	12,673,821.26

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）
基金赎回费收入	—
替代损益	-33,126.83
合计	-33,126.83

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（2023年01月01日至2023年06月30日）
审计费用	18,843.91

信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	1,520.00
其他	15,741.95
合计	96,105.86

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（2023年01月01日至2023年06月30日）		上年度可比期间（2022年01月01日至2022年06月30日）	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
海通证券	8,063,599.34	15.83	29,778,770.80	29.93
申万宏源	680,548.07	1.34	966,684.10	0.97

6.4.10.1.2 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）		上年度可比期间（2022年01月01日至2022年06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

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2023年01月01日至2023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（%）
海通证券	2,596.63	14.62	2,061.69	14.16
申万宏源	490.90	2.76	328.99	2.26
关联方名称	上年度可比期间（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

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（2023年01月01日至 2023年06月30日）	上年度可比期间（2022年01月 01日至2022年06月30日）
当期发生的基金应支付的管理费	916,330.11	1,053,759.46
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（2023年01月01 日至2023年06月30 日）	上年度可比期间（2022年01 月01日至2022年06月30 日）
当期发生的基金应支付的托管费	183,266.05	210,751.85

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均未与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

单位：人民币元

本期（2023年01月01日至2023年06月30日）				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
海通证券	207,754.00	119.17	—	—

注：本基金上年度可比期间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

金额单位：人民币元

本期（2023年01月01日至2023年06月30日）										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量（单位：股）	出借期限（单位：天）	费率	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
海通证券	2023041100003043	中国国航	2023年04月11日	48,224.00	4,400.00	7	4.32	39.32	—	—
海通证券	2023041800009639	中国国航	2023年04月18日	49,280.00	4,400.00	7	4.32	40.21	—	—
海通证券	2023042500005552	中兴通讯	2023年04月25日	206,584.00	5,600.00	14	3.20	249.66	—	—
海通证券	2023042500062797	中国国航	2023年04月25日	44,704.00	4,400.00	7	4.32	46.84	—	—
海通证券	202304260000	中天科技	2023年04月	14,940.00	1,000.00	14	3.20	18.03	—	—

	2111		月 26 日							
海通证 券	202304 270000 4928	中天科 技	2023 年 04 月 27 日	68,573 .00	4,70 0.00	14	3.51	90.80	—	—
海通证 券	202305 090000 5900	中国海 油	2023 年 05 月 09 日	65,109 .00	3,30 0.00	14	3.10	76.25	—	—
海通证 券	202305 090001 1821	中兴通 讯	2023 年 05 月 09 日	185,69 6.00	5,60 0.00	14	3.20	224.37	—	—
海通证 券	202305 100000 2094	中金公 司	2023 年 05 月 10 日	82,116 .00	1,80 0.00	14	3.50	108.55	—	—
海通证 券	202305 100000 2125	中航产 融	2023 年 05 月 10 日	51,528 .00	11,3 00.0 0	14	5.67	110.26	—	—
海通证 券	202305 100000 2141	中国银 河	2023 年 05 月 10 日	36,568 .00	2,80 0.00	7	4.50	31.09	—	—
海通证 券	202305 100001 6014	中天科 技	2023 年 05 月 10 日	14,300 .00	1,00 0.00	14	3.20	17.24	—	—
海通证 券	202305 110000 3805	爱旭股 份	2023 年 05 月 11 日	39,884 .00	1,30 0.00	14	3.20	48.23	—	—
海通证 券	202305 110001 7181	中天科 技	2023 年 05 月 11 日	70,218 .00	4,70 0.00	14	3.51	93.05	—	—
海通证 券	202305 170000 4441	中国银 河	2023 年 05 月 17 日	34,244 .00	2,80 0.00	7	4.50	29.12	—	—
海通证 券	202305 230000	三峡能 源	2023 年 05	93,708 .00	17,1 00.0	14	3.22	113.98	—	—

	4068		月 23 日		0					
海通证 券	202305 240002 0890	中金公 司	2023 年 05 月 24 日	75,294 .00	1,80 0.00	14	3.50	99.54	—	—
海通证 券	202305 240002 0900	中航产 融	2023 年 05 月 24 日	44,522 .00	11,3 00.0 0	14	5.67	95.37	—	—
海通证 券	202305 240002 8360	中天科 技	2023 年 05 月 24 日	15,430 .00	1,00 0.00	14	3.20	18.64	—	—
海通证 券	202306 070000 3385	中天科 技	2023 年 06 月 07 日	61,950 .00	4,20 0.00	14	3.65	85.41	—	—
海通证 券	202306 070000 3541	长城汽 车	2023 年 06 月 07 日	55,416 .00	2,40 0.00	7	3.50	36.59	—	—
海通证 券	202306 140004 9151	长城汽 车	2023 年 06 月 14 日	57,912 .00	2,40 0.00	7	3.50	38.29	—	—
海通证 券	202306 160000 2632	玲珑轮 胎	2023 年 06 月 16 日	28,405 .00	1,30 0.00	14	3.10	33.26	—	—
海通证 券	202306 190000 5233	芒果超 媒	2023 年 06 月 19 日	52,403 .00	1,30 0.00	14	3.10	48.18	44,473 .00	49.61
海通证 券	202306 210001 5655	长城汽 车	2023 年 06 月 21 日	60,192 .00	2,40 0.00	7	3.50	39.77	—	—
海通证 券	202306 210001 5854	中天科 技	2023 年 06 月 21 日	66,360 .00	4,20 0.00	14	3.65	58.77	66,822 .00	60.57
海通证 券	202306 270000	世纪华 通	2023 年 06	80,769 .00	10,9 00.0	7	3.20	20.91	82,731 .00	21.54

	7243		月 27 日		0					
海通证 券	202306 280000 8614	中国船 舶	2023 年 06 月 28 日	136,12 2.00	4,20 0.00	14	3.20	23.50	138,22 2.00	24.20
海通证 券	202306 290001 0948	卫星化 学	2023 年 06 月 29 日	46,720 .00	3,20 0.00	14	3.10	3.90	47,872 .00	4.02
申万宏 源	202306 070000 3109	中国长 城	2023 年 06 月 07 日	51,282 .00	3,70 0.00	14	3.78	73.14	—	—
申万宏 源	202306 080000 3111	通威股 份	2023 年 06 月 08 日	103,48 8.00	3,30 0.00	14	3.78	189.83	—	—
申万宏 源	202306 260004 6011	通威股 份	2023 年 06 月 26 日	112,13 4.00	3,30 0.00	14	3.78	45.72	113,22 3.00	47.08

注：本基金上年度可比期间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（2023年06月30日）		上年度末（2022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	108,940,900.00	23.75	103,886,800.00	21.00

500 交易型开放式 指数证券投资基金 联接基金				
海通证券股份有限 公司	1,164,900.00	0.25	1,165,100.00	0.24

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（2023年01月01日至2023年06月30日）		上年度可比期间（2022年01月01日至2022年06月30日）	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	3,971,571.48	4,302.46	5,118,804.47	5,900.13

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（2023年01月01日至2023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：股/张）	总金额
海通证券股份有限公司	688531	日联科技	IPO网下申购	1,269	193,370.22
海通证券股份有限公司	688515	裕太微	IPO网下申购	1,853	171,328.38
申万宏源证券承销保荐有限责任公司	601916	浙商银行	配股	23,220	46,904.40

金额单位：人民币元

上年度可比期间（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：股/张）	总金额
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

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）、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）、中银航空租赁（2588.HK）、中银香港（2388.HK）。

本报告期末，本基金持有海通证券 95,600 股，占基金资产净值比例 0.26%。上年度末，本基金持有海通证券 103,600 股，占基金资产净值比例 0.25%。

本报告期末，本基金持有申万宏源 89,300 股，占基金资产净值比例 0.12%。上年度末，本基金持有申万宏源 96,700 股，占基金资产净值比例 0.10%。

本报告期末，本基金持有中国银行（601988.SH）208,600 股，占基金资产净值比例 0.24%。上年度末，本基金持有中国银行（601988.SH）226,100 股，占基金资产净值比例 0.19%。

本报告期末，本基金持有中国银行（3988.HK）826,000 股，占基金资产净值比例 0.70%。上年度末，本基金持有中国银行（3988.HK）897,000 股，占基金资产净值比例 0.62%。

本报告期末，本基金持有中银证券 16,300 股，占基金资产净值比例 0.05%。上年度末，本基金持有中银证券 17,900 股，占基金资产净值比例 0.05%。

本报告期末，本基金持有中银航空租赁 2,100 股，占基金资产净值比例 0.04%。上年度末，本基金持有中银航空租赁 2,200 股，占基金资产净值比例 0.03%。

本报告期末，本基金持有中银香港 41,500 股，占基金资产净值比例 0.27%。上年度末，本基金持有中银香港 45,500 股，占基金资产净值比例 0.29%。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023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
001282	三联锻造	2023-05-15	6个月	新股限售	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	—
001287	中电港	2023-03-30	6个月	新股限售	11.88	21.02	533	6,332.04	11,203.66	—

001324	长青科技	2023-05-12	6个月	新股限售	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	—
001367	海森药业	2023-03-30	6个月	新股限售	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	—
001380	华纬科技	2023-05-09	6个月	新股限售	28.84	30.78	166	4,787.44	5,109.48	—
300804	广康生化	2023-06-15	6个月	新股限售	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	—
301170	锡南科技	2023-06-16	6个月	新股限售	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	—
301202	朗威股份	2023-06-28	1个月内 (含)	新股认购	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	—
301202	朗威股份	2023-06-28	6个月	新股限售	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	—
301203	国泰环保	2023-03-28	6个月	新股限售	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	—
301225	恒勃股份	2023-06-08	6个月	新股限售	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	—
301246	宏源药业	2023-03-10	6个月	新股限售	50.00	30.71	416	20,800.00	12,775.36	—
301260	格力博	2023-01-20	6个月	新股限售	30.85	23.63	684	21,101.40	16,162.92	—
301261	恒工精密	2023-06-29	1个月内 (含)	新股认购	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	—
301261	恒工精密	2023-06-29	6个月	新股限售	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	—
301262	海看股份	2023-06-13	6个月	新股限售	30.22	25.50	480	14,505.60	12,240.00	—
301281	科源制药	2023-03-28	6个月	新股限售	44.18	25.10	233	10,293.94	5,848.30	—
301281	科源制药	2023-05-26	5个月	新股限售_转增	—	25.10	93	—	2,334.30	—
301293	三博脑科	2023-04-25	6个月	新股限售	29.60	71.42	326	9,649.60	23,282.92	—
301303	真兰仪表	2023-02-13	6个月	新股限售	26.80	22.32	693	18,572.40	15,467.76	—
301315	威士顿	2023-06-13	6个月	新股限售	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	—
301317	鑫磊股份	2023-01-12	6个月	新股限售	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	—
301322	绿通科技	2023-02-27	6个月	新股限售	131.11	53.24	122	15,995.42	6,495.28	—
301322	绿通科技	2023-05-25	4个月	新股限售_转增	—	53.24	61	—	3,247.64	—
301323	新莱福	2023-05-29	6个月	新股限售	39.06	39.36	222	8,671.32	8,737.92	—
301332	德尔玛	2023-05-09	6个月	新股限售	14.81	13.73	842	12,470.02	11,560.66	—
301337	亚华电子	2023-05-16	6个月	新股限售	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	—
301345	涛涛车业	2023-03-10	6个月	新股限售	73.45	46.64	136	9,989.20	6,343.04	—
301357	北方长龙	2023-04-11	6个月	新股限售	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	—
301358	湖南裕能	2023-02-01	6个月	新股限售	23.77	42.89	546	12,978.42	23,417.94	—
301373	凌玮科技	2023-01-20	6个月	新股限售	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	—
301376	致欧科技	2023-06-14	6个月	新股限售	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	—
301386	未来电器	2023-03-21	6个月	新股限售	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	—
301387	光大同创	2023-04-10	6个月	新股限售	58.32	45.36	275	16,038.00	12,474.00	—
301395	仁信新材	2023-06-21	1个月内 (含)	新股认购	26.68	26.68	4,052	108,107.36	108,107.36	—
301395	仁信新材	2023-06-21	6个月	新股限售	26.68	26.68	451	12,032.68	12,032.68	—
301408	华人健康	2023-02-22	6个月	新股限售	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	—
301429	森泰股份	2023-04-10	6个月	新股限售	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	—

301486	致尚科技	2023-06-30	1个月内 (含)	新股认购	57.66	57.66	1,971	113,647.86	113,647.86	—
301486	致尚科技	2023-06-30	6个月	新股限售	57.66	57.66	220	12,685.20	12,685.20	—
301488	豪恩汽电	2023-06-26	1个月内 (含)	新股认购	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	—
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6个月	新股限售	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	—
601916	浙商银行	2023-06-27	1个月内 (含)	网上配股 限售	2.02	2.64	23,220	46,904.40	61,300.80	—
603125	常青科技	2023-03-30	6个月	新股限售	25.98	24.53	130	3,377.40	3,188.90	—
688249	晶合集成	2023-04-24	6个月	新股限售	19.86	18.06	1,901	37,753.86	34,332.06	—
688352	硕中科技	2023-04-11	6个月	新股限售	12.10	12.07	1,012	12,245.20	12,214.84	—
688361	中科飞测	2023-05-12	6个月	新股限售	23.60	64.67	369	8,708.40	23,863.23	—
688429	时创能源	2023-06-20	6个月	新股限售	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	—
688458	美芯晟	2023-05-15	6个月	新股限售	75.00	90.76	121	9,075.00	10,981.96	—
688472	阿特斯	2023-06-02	6个月	新股限售	11.10	17.04	1,482	16,450.20	25,253.28	—
688479	友车科技	2023-05-04	6个月	新股限售	33.99	29.49	235	7,987.65	6,930.15	—
688484	南芯科技	2023-03-28	6个月	新股限售	39.99	36.71	339	13,556.61	12,444.69	—
688506	百利天恒	2022-12-28	6个月	新股限售	24.70	71.38	12,609	311,442.30	900,030.42	—
688523	航天环宇	2023-05-26	6个月	新股限售	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	—
688531	日联科技	2023-03-24	6个月	新股限售	152.38	135.97	127	19,352.26	17,268.19	—
688535	华海诚科	2023-03-28	6个月	新股限售	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	—
688576	西山科技	2023-05-30	6个月	新股限售	135.80	120.41	132	17,925.60	15,894.12	—
688581	安杰思	2023-05-12	6个月	新股限售	125.80	118.03	82	10,315.60	9,678.46	—
688593	新相微	2023-05-25	6个月	新股限售	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	—
688603	天承科技	2023-06-30	1个月内 (含)	新股认购	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	—
688603	天承科技	2023-06-30	6个月	新股限售	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	—
688623	二元科技	2023-05-31	6个月	新股限售	125.88	86.79	87	10,951.56	7,550.73	—
688631	莱斯信息	2023-06-19	6个月	新股限售	25.28	29.87	292	7,381.76	8,722.04	—

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
06666	恒大物业	2022年03月21日	重大事项停牌	2.12	2023年08月03日	1.46	53,500.00	363,162.51	113,420.00	—
00813	世茂集团	2022年04月01日	重大事项停牌	4.08	2023年07月31日	2.00	18,000.00	336,810.89	73,440.00	—

03333	中国恒大	2022年03月 21日	重大事项停牌	1.52	2023 年08 月28 日	0.22	25,000.00	310,184.60	38,000.00	-
-------	------	-----------------	--------	------	-------------------------	------	-----------	------------	-----------	---

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 2023 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 2023 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	601868	中国能建	2023年07月 12日	2.34	25,500	59,670.00
2	601766	中国中车	2023年07月 05日	6.50	13,800	89,700.00
3	601919	中远海控	2023年07月 05日-2023 年07月13 日	9.40	12,200	114,680.00
4	601006	大秦铁路	2023年07月 03日	7.43	11,700	86,931.00
5	600031	三一重工	2023年07月 12日	16.63	11,700	194,571.00
6	600115	中国东航	2023年07月 14日	4.76	11,200	53,312.00
7	002602	世纪华通	2023年07月 04日	7.59	10,900	82,731.00
8	600705	中航产融	2023年07月 10日	3.83	10,500	40,215.00
9	000625	长安汽车	2023年07月 05日	12.93	9,700	125,421.00
10	000792	盐湖股份	2023年07月 10日	19.17	9,200	176,364.00
11	002252	上海莱士	2023年07月 12日	7.51	9,200	69,092.00
12	601216	君正集团	2023年07月	4.10	6,600	27,060.00

			05日			
13	001979	招商蛇口	2023年07月05日	13.03	6,100	79,483.00
14	002493	荣盛石化	2023年07月14日	11.64	6,000	69,840.00
15	600018	上港集团	2023年07月10日	5.25	5,400	28,350.00
16	601872	招商轮船	2023年07月05日	5.79	5,200	30,108.00
17	600522	中天科技	2023年07月05日-2023年07月10日	15.91	5,200	82,732.00
18	600027	华电国际	2023年07月11日	6.69	5,100	34,119.00
19	600438	通威股份	2023年07月10日	34.31	5,000	171,550.00
20	601238	广汽集团	2023年07月07日	10.42	4,300	44,806.00
21	600406	国电南瑞	2023年07月10日	23.10	4,200	97,020.00
22	600346	恒力石化	2023年07月10日	14.33	4,200	60,186.00
23	600150	中国船舶	2023年07月12日	32.91	4,200	138,222.00
24	601225	陕西煤业	2023年07月13日	18.19	4,100	74,579.00
25	002064	华峰化学	2023年07月05日-2023年07月11日	6.86	3,900	26,754.00
26	002230	科大讯飞	2023年07月10日	67.96	3,600	244,656.00
27	600176	中国巨石	2023年07月10日	14.16	3,600	50,976.00
28	601898	中煤能源	2023年07月12日	8.44	3,500	29,540.00
29	002648	卫星化学	2023年07月13日	14.96	3,200	47,872.00
30	601233	桐昆股份	2023年07月05日	13.25	3,200	42,400.00
31	000617	中油资本	2023年07月10日	7.23	3,200	23,136.00
32	300012	华测检测	2023年07月	19.50	3,100	60,450.00

			03日-2023 年07月10 日			
33	002202	金风科技	2023年07月 06日	10.62	3,000	31,860.00
34	600089	特变电工	2023年07月 27日	22.29	3,000	66,870.00
35	000877	天山股份	2023年07月 04日-2023 年07月10 日	8.14	2,900	23,606.00
36	002601	龙佰集团	2023年07月 10日	16.50	2,900	47,850.00
37	002241	歌尔股份	2023年07月 10日	17.75	2,800	49,700.00
38	601881	中国银河	2023年07月 13日	11.61	2,600	30,186.00
39	601088	中国神华	2023年07月 13日	30.75	2,500	76,875.00
40	002625	光启技术	2023年07月 05日-2023 年07月10 日	15.26	2,400	36,624.00
41	600183	生益科技	2023年07月 05日	14.20	2,300	32,660.00
42	601788	光大证券	2023年07月 03日-2023 年07月04 日	15.89	2,000	31,780.00
43	600011	华能国际	2023年07月 10日	9.26	2,000	18,520.00
44	601998	中信银行	2023年07月 12日	5.98	2,000	11,960.00
45	002555	三七互娱	2023年07月 13日-2023 年07月14 日	34.88	2,000	69,760.00
46	601318	中国平安	2023年07月 11日	46.40	2,000	92,800.00
47	600660	福耀玻璃	2023年07月 10日-2023 年07月12 日	35.85	2,000	71,700.00
48	601699	潞安环能	2023年07月	16.32	2,000	32,640.00

			10日			
49	000301	东方盛虹	2023年07月12日	11.82	1,900	22,458.00
50	600026	中远海能	2023年07月10日	12.64	1,800	22,752.00
51	601995	中金公司	2023年07月10日	35.52	1,600	56,832.00
52	002603	以岭药业	2023年07月10日	25.69	1,500	38,535.00
53	688008	澜起科技	2023年07月06日	57.42	1,500	86,130.00
54	600141	兴发集团	2023年07月05日	22.22	1,400	31,108.00
55	002008	大族激光	2023年07月03日	26.20	1,300	34,060.00
56	603806	福斯特	2023年07月03日	37.19	1,300	48,347.00
57	002352	顺丰控股	2023年07月13日	45.09	1,300	58,617.00
58	300413	芒果超媒	2023年07月03日	34.21	1,300	44,473.00
59	600160	巨化股份	2023年07月03日	13.78	1,200	16,536.00
60	600732	爱旭股份	2023年07月10日	30.75	1,200	36,900.00
61	603816	顾家家居	2023年07月07日	38.15	1,100	41,965.00
62	601231	环旭电子	2023年07月03日	14.96	1,100	16,456.00
63	601628	中国人寿	2023年07月10日	34.96	1,000	34,960.00
64	300529	健帆生物	2023年07月14日	23.18	1,000	23,180.00
65	600061	国投资本	2023年07月10日	7.12	1,000	7,120.00
66	600188	兖矿能源	2023年07月05日	29.92	1,000	29,920.00
67	601808	中海油服	2023年07月13日	13.88	1,000	13,880.00
68	600426	华鲁恒升	2023年07月14日	30.63	1,000	30,630.00
69	601155	新城控股	2023年07月10日	14.41	1,000	14,410.00
70	600383	金地集团	2023年07月	7.21	1,000	7,210.00

			10日			
71	600111	北方稀土	2023年07月05日	23.98	1,000	23,980.00
72	002236	大华股份	2023年07月12日	19.75	1,000	19,750.00
73	002120	韵达股份	2023年07月05日	9.56	1,000	9,560.00
74	002459	晶澳科技	2023年07月14日	41.70	1,000	41,700.00
75	600803	新奥股份	2023年07月03日	18.98	1,000	18,980.00
76	000938	紫光股份	2023年07月10日	31.85	1,000	31,850.00
合计	-	-	-	-	300,400.00	4,144,216.00

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（2023年06月30日）	上年度末（2022年12月31日）
AAA	—	—
AAA 以下	—	16,367.98
未评级	—	—
合计	—	16,367.98

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的信用债。本表主要列示除短融和超短融之外的信用债，债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的

基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的15%。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金本报告期末无重大流动性风险。

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（2023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	3,971,571.48	—	—	—	—	—	3,971,571.48
结算备付金	8,037.96	—	—	—	—	—	8,037.96
存出保证金	6,382.37	—	—	—	—	—	6,382.37
交易性金融资产	—	—	—	—	—	339,290,988.40	339,290,988.40
应收股利	—	—	—	—	—	792,322.10	792,322.10
其他资产	—	—	—	—	—	1,981.46	1,981.46
资产总计	3,985,991.81	—	—	—	—	340,085,291.96	344,071,283.77
负债							
应付清算款	—	—	—	—	—	1,098,799.56	1,098,799.56
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	141,356.07	141,356.07
应付托管费	—	—	—	—	—	28,271.21	28,271.21
应交税费	—	—	—	—	—	328.18	328.18
其他负债	—	—	—	—	—	166,323.61	166,323.61
负债总计	—	—	—	—	—	1,435,078.63	1,435,078.63
利率敏感度缺口	3,985,991.81	—	—	—	—	338,650,213.33	342,636,205.14
上年度末（2022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	1,732,014.16	—	—	—	—	—	1,732,014.16
结算备付金	9,928.23	—	—	—	—	—	9,928.23

存出保证金	5,730.48	—	—	—	—	—	5,730.48
交易性金融资产	—	—	16,367.98	—	—	365,661,277.09	365,677,645.07
应收股利	—	—	—	—	—	15,208.91	15,208.91
其他资产	—	—	—	—	—	990.88	990.88
资产总计	1,747,672.87	—	16,367.98	—	—	365,677,476.88	367,441,517.73
负债							
应付清算款	—	—	—	—	—	32.41	32.41
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	155,694.43	155,694.43
应付托管费	—	—	—	—	—	31,138.89	31,138.89
应交税费	—	—	—	—	—	82.90	82.90
其他负债	—	—	—	—	—	93,188.69	93,188.69
负债总计	—	—	—	—	—	280,137.32	280,137.32
利率敏感度缺口	1,747,672.87	—	16,367.98	—	—	365,397,339.56	367,161,380.41

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（2023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	—	136,951,588.50	—	—	136,951,588.50
应收股利	—	785,818.10	—	—	785,818.10
资产合计	—	137,737,406.60	—	—	137,737,406.60
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	—	137,737,406.60	—	—	137,737,406.60
项目	上年度末（2022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	—	148,091,776.00	—	—	148,091,776.00
应收股利	—	15,208.91	—	—	15,208.91
资产合计	—	148,106,984.91	—	—	148,106,984.91
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	—	148,106,984.91	—	—	148,106,984.91

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（2023年06月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	港币相对人民币贬值 1%	-1,377,374.07	-1,481,069.85
	港币相对人民币升值 1%	1,377,374.07	1,481,069.85

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（2023年06月30日）		上年度末（2022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	339,290,988.40	99.02	365,661,277.09	99.59
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	16,367.98	0.00
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	339,290,988.40	99.02	365,677,645.07	99.60

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（2023年06月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	1. 业绩比较基准增加 1%	3,530,470.68	3,732,433.85
2. 业绩比较基准减少 1%	-3,530,470.68	-3,732,433.85	

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 (2023年06月30日)	上年度末 (2022年12月31日)
第一层次	336,977,022.30	364,027,000.77
第二层次	865,095.84	836,438.30
第三层次	1,448,870.26	814,206.00
合计	339,290,988.40	365,677,645.07

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	339,290,988.40	98.61
	其中：股票	339,290,988.40	98.61
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	3,979,609.44	1.16
8	其他各项资产	800,685.93	0.23
9	合计	344,071,283.77	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 136,951,588.50 元，占资产净值比例为 39.97%；通过转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 4,144,216.00 元，占资产净值比例为 1.21%。

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	1,914,734.32	0.56
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	124,953.31	0.04
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	46,491.15	0.01

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	7,740.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	23,282.92	0.01
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	2,117,201.70	0.62

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	2,076,480.00	0.61
B	采矿业	7,446,904.00	2.17
C	制造业	116,093,879.58	33.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,692,652.00	1.66
E	建筑业	4,415,950.00	1.29
F	批发和零售业	809,545.00	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	4,445,564.00	1.30
H	住宿和餐饮业	194,764.00	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,475,189.25	3.06
J	金融业	40,056,402.36	11.69
K	房地产业	2,793,441.00	0.82
L	租赁和商务服务业	1,754,043.06	0.51
M	科学研究和技术服务业	2,118,690.20	0.62
N	水利、环境和公共设施管理业	85,799.00	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	1,295,862.75	0.38
R	文化、体育和娱乐业	467,032.00	0.14
S	综合	—	—
	合计	200,222,198.20	58.44

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	47,250,793.00	13.79

通信服务	27,800,714.00	8.11
非日常生活消费品	20,331,963.00	5.93
房地产	8,513,318.00	2.48
日常消费品	6,567,950.50	1.92
工业	5,538,651.00	1.62
信息技术	5,370,322.00	1.57
公用事业	4,893,172.00	1.43
能源	4,861,030.00	1.42
医疗保健	4,791,725.00	1.40
原材料	1,031,950.00	0.30
合计	136,951,588.50	39.97

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	66,500	20,331,045.00	5.93
2	00005	汇丰控股	200,000	11,248,000.00	3.28
3	600519	贵州茅台	6,000	10,146,000.00	2.96
4	01299	友邦保险	114,600	8,357,778.00	2.44
5	601318	中国平安	107,200	4,974,080.00	1.45
5	02318	中国平安	73,500	3,378,060.00	0.99
6	03690	美团-W	61,700	6,957,292.00	2.03
7	00939	建设银行	1,189,000	5,552,630.00	1.62
7	601939	建设银行	66,400	415,664.00	0.12
8	300750	宁德时代	26,080	5,966,843.20	1.74
9	00941	中国移动	81,000	4,783,050.00	1.40
9	600941	中国移动	8,500	793,050.00	0.23
10	600036	招商银行	122,476	4,012,313.76	1.17
10	03968	招商银行	45,500	1,493,310.00	0.44
11	01398	工商银行	860,000	3,311,000.00	0.97
11	601398	工商银行	346,900	1,672,058.00	0.49
12	01211	比亚迪股份	10,500	2,420,250.00	0.71
12	002594	比亚迪	8,900	2,298,603.00	0.67
13	00388	香港交易所	12,500	3,402,125.00	0.99
14	03988	中国银行	826,000	2,395,400.00	0.70
14	601988	中国银行	208,600	815,626.00	0.24
15	000858	五粮液	19,200	3,140,544.00	0.92

16	000333	美的集团	48,700	2,869,404.00	0.84
17	601328	交通银行	272,000	1,577,600.00	0.46
17	03328	交通银行	174,000	833,460.00	0.24
18	601899	紫金矿业	157,800	1,794,186.00	0.52
18	02899	紫金矿业	58,000	614,800.00	0.18
19	601166	兴业银行	143,900	2,252,035.00	0.66
20	600030	中信证券	96,635	1,911,440.30	0.56
20	06030	中信证券	26,000	340,340.00	0.10
21	600028	中国石化	182,000	1,157,520.00	0.34
21	00386	中国石油化工股份	240,000	1,015,200.00	0.30
22	600900	长江电力	96,900	2,137,614.00	0.62
23	00883	中国海洋石油	175,000	1,807,750.00	0.53
23	600938	中国海油	17,100	309,852.00	0.09
24	600276	恒瑞医药	44,160	2,115,264.00	0.62
25	601288	农业银行	316,000	1,115,480.00	0.33
25	01288	农业银行	304,000	863,360.00	0.25
26	688981	中芯国际	19,400	980,088.00	0.29
26	00981	中芯国际	47,000	884,070.00	0.26
27	00857	中国石油股份	210,000	1,050,000.00	0.31
27	601857	中国石油	107,900	806,013.00	0.24
28	600887	伊利股份	63,100	1,786,992.00	0.52
29	300059	东方财富	125,602	1,783,548.40	0.52
30	601088	中国神华	32,600	1,002,450.00	0.29
30	01088	中国神华	33,500	739,680.00	0.22
31	601012	隆基绿能	60,116	1,723,525.72	0.50
32	01810	小米集团—W	173,400	1,713,192.00	0.50
33	09987	百胜中国	4,100	1,669,315.00	0.49
34	600309	万华化学	18,700	1,642,608.00	0.48
35	000651	格力电器	44,600	1,628,346.00	0.48
36	002475	立讯精密	49,400	1,603,030.00	0.47
37	00016	新鸿基地产	17,500	1,592,500.00	0.46
38	09633	农夫山泉	39,800	1,587,224.00	0.46
39	02888	渣打集团	24,800	1,541,072.00	0.45
40	02015	理想汽车—W	12,300	1,536,639.00	0.45
41	002415	海康威视	46,300	1,532,993.00	0.45
42	000725	京东方A	371,100	1,517,799.00	0.44

43	600690	海尔智家	37,300	875,804.00	0.26
43	06690	海尔智家	28,200	640,986.00	0.19
44	000568	泸州老窖	7,100	1,487,947.00	0.43
45	02628	中国人寿	74,000	890,960.00	0.26
45	601628	中国人寿	16,300	569,848.00	0.17
46	300760	迈瑞医疗	4,872	1,460,625.60	0.43
47	00669	创科实业	18,500	1,452,435.00	0.42
48	02269	药明生物	41,500	1,436,730.00	0.42
49	01024	快手-W	29,100	1,436,667.00	0.42
50	000063	中兴通讯	31,500	1,434,510.00	0.42
51	601601	中国太保	33,900	880,722.00	0.26
51	02601	中国太保	27,400	511,558.00	0.15
52	603259	药明康德	20,220	1,259,908.20	0.37
53	002230	科大讯飞	18,300	1,243,668.00	0.36
54	00027	银河娱乐	27,000	1,237,140.00	0.36
55	06160	百济神州	12,300	1,217,946.00	0.36
56	300274	阳光电源	10,400	1,212,952.00	0.35
57	600050	中国联通	188,900	906,720.00	0.26
57	00762	中国联通	62,000	296,360.00	0.09
58	00001	长和	27,000	1,191,240.00	0.35
59	601668	中国建筑	206,800	1,187,032.00	0.35
60	300124	汇川技术	18,350	1,178,253.50	0.34
61	00002	中电控股	20,500	1,151,075.00	0.34
62	002714	牧原股份	26,800	1,129,620.00	0.33
63	01109	华润置地	36,000	1,101,960.00	0.32
64	002352	顺丰控股	24,100	1,086,669.00	0.32
65	000001	平安银行	96,000	1,078,080.00	0.31
66	601888	中国中免	9,702	1,072,362.06	0.31
67	002129	TCL 中环	31,950	1,060,740.00	0.31
68	601658	邮储银行	109,500	535,455.00	0.16
68	01658	邮储银行	117,000	519,480.00	0.15
69	000792	盐湖股份	53,700	1,029,429.00	0.30
70	02331	李宁	26,000	1,010,360.00	0.29
71	02020	安踏体育	13,600	1,003,680.00	0.29
72	002142	宁波银行	39,190	991,507.00	0.29
73	601138	工业富联	39,300	990,360.00	0.29
74	600031	三一重工	58,700	976,181.00	0.28
75	300498	温氏股份	51,600	946,860.00	0.28
76	000002	万科A	67,300	943,546.00	0.28
77	600016	民生银行	245,700	921,375.00	0.27
78	600048	保利发展	70,500	918,615.00	0.27

79	600406	国电南瑞	39,758	918,409.80	0.27
80	02388	中银香港	41,500	916,320.00	0.27
81	600809	山西汾酒	4,920	910,544.40	0.27
82	600438	通威股份	26,500	909,215.00	0.27
83	00168	青岛啤酒股份	8,000	525,120.00	0.15
83	600600	青岛啤酒	3,600	373,068.00	0.11
84	688111	金山办公	1,900	897,218.00	0.26
85	600837	海通证券	95,600	881,432.00	0.26
86	02319	蒙牛乳业	32,000	870,400.00	0.25
87	601728	中国电信	153,200	862,516.00	0.25
88	01113	长实集团	21,500	860,215.00	0.25
89	600919	江苏银行	116,900	859,215.00	0.25
90	600436	片仔癀	3,000	859,080.00	0.25
91	002371	北方华创	2,700	857,655.00	0.25
92	00291	华润啤酒	18,000	856,260.00	0.25
93	600089	特变电工	38,400	855,936.00	0.25
94	300015	爱尔眼科	46,045	854,134.75	0.25
95	600000	浦发银行	116,200	841,288.00	0.25
96	600585	海螺水泥	23,800	565,012.00	0.16
96	00914	海螺水泥	13,500	258,930.00	0.08
97	01928	金沙中国有限公司	32,400	797,688.00	0.23
98	601766	中国中车	120,400	782,600.00	0.23
99	00011	恒生银行	7,600	781,280.00	0.23
100	603501	韦尔股份	7,965	780,888.60	0.23
101	601390	中国中铁	101,700	770,886.00	0.22
102	603288	海天味业	16,405	768,574.25	0.22
103	00267	中信股份	87,000	749,940.00	0.22
104	002304	洋河股份	5,700	748,695.00	0.22
105	300014	亿纬锂能	12,200	738,100.00	0.22
106	600905	三峡能源	135,200	726,024.00	0.21
107	002466	天齐锂业	10,300	720,073.00	0.21
108	02688	新奥能源	7,900	710,921.00	0.21
109	600150	中国船舶	21,600	710,856.00	0.21
110	601688	华泰证券	50,900	700,893.00	0.20
111	000938	紫光股份	21,900	697,515.00	0.20
112	601225	陕西煤业	38,300	696,677.00	0.20
113	688012	中微公司	4,400	688,380.00	0.20
114	01997	九龙仓置业	19,000	685,900.00	0.20
115	00688	中国海外发	43,500	685,125.00	0.20

		展			
116	002027	分众传媒	100,100	681,681.00	0.20
117	603986	兆易创新	6,400	680,000.00	0.20
118	002460	赣锋锂业	11,140	679,094.40	0.20
119	601169	北京银行	146,600	678,758.00	0.20
120	00003	香港中华煤 气	108,250	675,480.00	0.20
121	000338	潍柴动力	53,700	669,102.00	0.20
122	002459	晶澳科技	15,932	664,364.40	0.19
123	600570	恒生电子	14,908	660,275.32	0.19
124	601985	中国核电	93,400	658,470.00	0.19
125	600104	上汽集团	46,200	654,654.00	0.19
126	002050	三花智控	21,200	641,512.00	0.19
127	000625	长安汽车	49,128	635,225.04	0.19
128	00066	港铁公司	19,000	630,610.00	0.18
129	601211	国泰君安	44,600	623,954.00	0.18
130	02313	申洲国际	9,000	620,280.00	0.18
131	01093	石药集团	96,000	602,880.00	0.18
132	002049	紫光国微	6,420	598,665.00	0.17
133	603019	中科曙光	11,600	590,440.00	0.17
134	000100	TCL 科技	148,720	585,956.80	0.17
135	601919	中远海控	62,240	585,056.00	0.17
136	603799	华友钴业	12,680	582,138.80	0.17
137	600111	北方稀土	24,100	577,918.00	0.17
138	06618	京东健康	12,550	572,154.50	0.17
139	00006	电能实业	15,000	567,750.00	0.17
140	601229	上海银行	98,500	566,375.00	0.17
141	601818	光大银行	183,800	564,266.00	0.16
142	02328	中国财险	70,000	562,100.00	0.16
143	002179	中航光电	12,368	560,888.80	0.16
144	600660	福耀玻璃	15,600	559,260.00	0.16
145	00992	联想集团	74,000	557,220.00	0.16
146	600893	航发动力	13,100	553,606.00	0.16
147	09868	小鹏汽车— W	12,000	553,200.00	0.16
148	600009	上海机场	12,100	549,582.00	0.16
149	02382	舜宇光学科 技	7,600	547,580.00	0.16
150	002271	东方雨虹	20,000	545,200.00	0.16
151	601989	中国重工	112,800	543,696.00	0.16
152	300896	爱美客	1,200	533,940.00	0.16

153	00998	中信银行	104,000	352,560.00	0.10
153	601998	中信银行	30,300	181,194.00	0.05
154	00175	吉利汽车	60,000	528,600.00	0.15
155	002812	恩捷股份	5,400	520,290.00	0.15
156	002555	三七互娱	14,900	519,712.00	0.15
157	600188	兖矿能源	9,000	269,280.00	0.08
157	01171	兖矿能源	12,000	248,400.00	0.07
158	300122	智飞生物	11,700	517,140.00	0.15
159	600958	东方证券	51,736	501,839.20	0.15
160	600999	招商证券	36,700	498,019.00	0.15
161	600019	宝钢股份	88,100	495,122.00	0.14
162	000977	浪潮信息	10,200	494,700.00	0.14
163	600760	中航沈飞	10,612	477,540.00	0.14
164	688036	传音控股	3,200	470,400.00	0.14
165	002709	天赐材料	11,400	469,566.00	0.14
166	688008	澜起科技	7,900	453,618.00	0.13
167	600426	华鲁恒升	14,770	452,405.10	0.13
168	00322	康师傅控股	40,000	449,200.00	0.13
169	601186	中国铁建	45,500	448,175.00	0.13
170	688599	天合光能	10,500	447,405.00	0.13
171	300316	晶盛机电	6,200	439,580.00	0.13
172	600584	长电科技	14,100	439,497.00	0.13
173	00960	龙湖集团	25,000	438,750.00	0.13
174	601006	大秦铁路	58,800	436,884.00	0.13
175	000661	长春高新	3,200	436,160.00	0.13
176	002602	世纪华通	57,200	434,148.00	0.13
177	00968	信义光能	52,000	433,680.00	0.13
178	601360	三六零	34,500	432,630.00	0.13
179	601600	中国铝业	78,500	430,965.00	0.13
180	00020	商汤-W	225,000	429,750.00	0.13
181	600522	中天科技	27,000	429,570.00	0.13
182	000776	广发证券	29,200	429,532.00	0.13
183	002410	广联达	13,200	428,868.00	0.13
184	002920	德赛西威	2,700	420,687.00	0.12
185	002241	歌尔股份	23,700	420,675.00	0.12
186	000596	古井贡酒	1,700	420,546.00	0.12
187	600588	用友网络	20,400	418,200.00	0.12
188	601377	兴业证券	68,330	418,179.60	0.12
189	600547	山东黄金	17,800	417,944.00	0.12
190	300142	沃森生物	15,800	417,910.00	0.12
191	000166	申万宏源	89,300	412,566.00	0.12

192	601009	南京银行	51,100	408,800.00	0.12
193	600745	闻泰科技	8,300	405,870.00	0.12
194	600011	华能国际	43,500	402,810.00	0.12
195	600010	包钢股份	224,900	402,571.00	0.12
196	001979	招商蛇口	30,600	398,718.00	0.12
197	300450	先导智能	10,960	396,423.20	0.12
198	01801	信达生物	14,500	395,705.00	0.12
199	601669	中国电建	68,300	392,042.00	0.11
200	300408	三环集团	13,300	390,355.00	0.11
201	600196	复星医药	12,600	389,340.00	0.11
202	300033	同花顺	2,200	385,616.00	0.11
203	01929	周大福	29,600	384,208.00	0.11
204	603659	璞泰来	10,014	382,735.08	0.11
205	601800	中国交建	34,900	380,759.00	0.11
206	600085	同仁堂	6,600	379,896.00	0.11
207	002311	海大集团	8,100	379,404.00	0.11
208	603993	洛阳钼业	70,000	373,100.00	0.11
209	000963	华东医药	8,600	372,982.00	0.11
210	00083	信和置业	42,000	372,960.00	0.11
211	01821	ESR	30,000	371,700.00	0.11
212	00788	中国铁塔	462,000	369,600.00	0.11
213	000768	中航西飞	13,800	369,150.00	0.11
214	000538	云南白药	6,940	364,211.20	0.11
215	600845	宝信软件	7,048	358,108.88	0.10
216	002384	东山精密	13,600	352,240.00	0.10
217	002340	格林美	50,800	351,028.00	0.10
218	002252	上海莱士	46,700	350,717.00	0.10
219	002493	荣盛石化	30,100	350,364.00	0.10
220	01177	中国生物制药	111,000	348,540.00	0.10
221	03800	协鑫科技	208,000	347,360.00	0.10
222	601689	拓普集团	4,300	347,010.00	0.10
223	00881	中升控股	12,500	345,125.00	0.10
224	000733	振华科技	3,600	345,060.00	0.10
225	600926	杭州银行	29,300	344,275.00	0.10
226	600015	华夏银行	63,100	341,371.00	0.10
227	600795	国电电力	88,300	338,189.00	0.10
228	600176	中国巨石	23,790	336,866.40	0.10
229	00288	万洲国际	87,500	335,125.00	0.10
230	300782	卓胜微	3,440	332,407.20	0.10
231	002180	纳思达	9,700	332,225.00	0.10

232	00019	太古股份公 司 A	6,000	332,160.00	0.10
233	000157	中联重科	49,100	331,425.00	0.10
234	600372	中航电子	21,760	330,316.80	0.10
235	600886	国投电力	26,100	330,165.00	0.10
236	00868	信义玻璃	29,000	326,250.00	0.10
237	600674	川投能源	21,600	325,080.00	0.09
238	600732	爱旭股份	10,560	324,720.00	0.09
239	002236	大华股份	16,400	323,900.00	0.09
240	300347	泰格医药	5,000	322,700.00	0.09
241	00012	恒基地产	15,000	322,200.00	0.09
242	601100	恒立液压	5,000	321,650.00	0.09
243	600029	南方航空	53,300	321,399.00	0.09
244	300012	华测检测	16,400	319,800.00	0.09
245	01876	百威亚太	17,100	318,402.00	0.09
246	300496	中科创达	3,300	317,955.00	0.09
247	06862	海底捞	20,000	317,800.00	0.09
248	000425	徐工机械	46,800	316,836.00	0.09
249	603369	今世缘	6,000	316,800.00	0.09
250	600115	中国东航	65,900	313,684.00	0.09
251	03888	金山软件	11,000	312,840.00	0.09
252	601066	中信建投	12,900	312,180.00	0.09
253	601633	长城汽车	12,200	307,074.00	0.09
254	601788	光大证券	19,300	306,677.00	0.09
255	01038	长江基建集 团	8,000	305,760.00	0.09
256	601995	中金公司	8,600	305,472.00	0.09
257	601916	浙商银行	114,220	301,540.80	0.09
258	601868	中国能建	128,500	300,690.00	0.09
259	601117	中国化学	36,200	299,736.00	0.09
260	000301	东方盛虹	25,300	299,046.00	0.09
261	600346	恒力石化	20,800	298,064.00	0.09
262	601336	新华保险	8,100	297,837.00	0.09
263	300003	乐普医疗	13,100	296,191.00	0.09
264	601877	正泰电器	10,700	295,855.00	0.09
265	00836	华润电力	18,000	293,760.00	0.09
266	002074	国轩高科	10,600	292,772.00	0.09
267	002202	金风科技	27,300	289,926.00	0.08
268	600741	华域汽车	15,500	286,130.00	0.08
269	601111	中国国航	34,500	284,280.00	0.08
270	300454	深信服	2,500	283,125.00	0.08

271	002001	新 和 成	18,328	282,251.20	0.08
272	601618	中国中冶	70,800	281,076.00	0.08
273	00916	龙源电力	33,000	245,520.00	0.07
273	001289	龙源电力	1,500	33,750.00	0.01
274	603345	安井食品	1,900	278,920.00	0.08
275	00151	中国旺旺	58,000	277,820.00	0.08
276	688396	华润微	5,300	277,773.00	0.08
277	600989	宝丰能源	21,800	274,898.00	0.08
278	601555	东吴证券	39,590	274,754.60	0.08
279	002821	凯莱英	2,320	273,435.20	0.08
280	09626	哔哩哔哩— W	2,520	271,152.00	0.08
281	601838	成都银行	22,200	271,062.00	0.08
282	605117	德业股份	1,800	269,190.00	0.08
283	002841	视源股份	4,000	267,360.00	0.08
284	603806	福斯特	7,179	266,987.01	0.08
285	00017	新世界发展	15,000	266,700.00	0.08
286	00384	中国燃气	32,200	266,294.00	0.08
287	000066	中国长城	19,200	265,536.00	0.08
288	000876	新 希 望	22,500	262,800.00	0.08
289	000807	云铝股份	20,600	262,238.00	0.08
290	601615	明阳智能	15,500	261,640.00	0.08
291	300661	圣邦股份	3,185	261,584.05	0.08
292	00268	金蝶国际	27,000	260,820.00	0.08
293	600765	中航重机	9,800	259,798.00	0.08
294	300037	新宙邦	5,000	259,450.00	0.08
295	688777	中控技术	4,125	258,967.50	0.08
296	600885	宏发股份	8,100	257,985.00	0.08
297	688122	西部超导	4,620	257,472.60	0.08
298	01066	威高股份	27,200	256,768.00	0.07
299	600039	四川路桥	25,900	254,079.00	0.07
300	000895	双汇发展	10,300	252,247.00	0.07
301	600460	士兰微	8,300	251,241.00	0.07
302	00135	昆仑能源	44,000	249,920.00	0.07
303	601607	上海医药	11,100	248,751.00	0.07
304	688126	沪硅产业	11,900	248,710.00	0.07
305	002736	国信证券	28,400	247,932.00	0.07
306	600702	舍得酒业	2,000	247,900.00	0.07
307	002648	卫星化学	16,485	246,615.60	0.07
308	300413	芒果超媒	7,200	246,312.00	0.07
309	600233	圆通速递	16,900	246,064.00	0.07

310	688223	晶科能源	17,500	246,050.00	0.07
311	688099	晶晨股份	2,900	244,528.00	0.07
312	002007	华兰生物	10,900	244,269.00	0.07
313	00241	阿里健康	56,000	243,040.00	0.07
314	688303	大全能源	6,000	242,700.00	0.07
315	003816	中国广核	77,900	242,269.00	0.07
316	300146	汤臣倍健	10,100	242,198.00	0.07
317	000786	北新建材	9,800	240,198.00	0.07
318	603392	万泰生物	3,548	236,899.96	0.07
319	01209	华润万象生活	6,600	236,742.00	0.07
320	601901	方正证券	36,000	235,440.00	0.07
321	002601	龙佰集团	14,200	234,300.00	0.07
322	300207	欣旺达	14,300	233,376.00	0.07
323	601108	财通证券	32,180	232,983.20	0.07
324	300433	蓝思科技	19,700	231,672.00	0.07
325	603260	合盛硅业	3,300	231,066.00	0.07
326	600132	重庆啤酒	2,500	230,400.00	0.07
327	300769	德方纳米	2,080	229,278.40	0.07
328	601727	上海电气	50,100	228,957.00	0.07
329	01044	恒安国际	7,500	228,225.00	0.07
330	601238	广汽集团	21,900	228,198.00	0.07
331	01193	华润燃气	9,200	227,332.00	0.07
332	01548	金斯瑞生物科技	14,000	227,220.00	0.07
333	002625	光启技术	14,800	225,848.00	0.07
334	600383	金地集团	31,300	225,673.00	0.07
335	300999	金龙鱼	5,600	223,944.00	0.07
336	00004	九龙仓集团	13,000	223,210.00	0.07
337	600763	通策医疗	2,300	222,778.00	0.07
338	000783	长江证券	38,200	221,560.00	0.06
339	300144	宋城演艺	17,800	220,720.00	0.06
340	603605	珀莱雅	1,960	220,304.00	0.06
341	02618	京东物流	19,500	219,765.00	0.06
342	601077	渝农商行	61,200	219,708.00	0.06
343	603882	金城医学	2,900	218,950.00	0.06
344	601233	桐昆股份	16,500	218,625.00	0.06
345	600096	云天化	12,800	218,496.00	0.06
346	300751	迈为股份	1,280	216,806.40	0.06
347	600332	白云山	6,800	216,784.00	0.06
348	300759	康龙化成	5,650	216,282.00	0.06

349	002385	大北农	32,600	215,160.00	0.06
350	002008	大族激光	8,200	214,840.00	0.06
351	300223	北京君正	2,400	211,944.00	0.06
352	002603	以岭药业	8,200	210,658.00	0.06
353	600219	南山铝业	69,600	210,192.00	0.06
354	600298	安琪酵母	5,800	210,018.00	0.06
355	300763	锦浪科技	2,000	208,200.00	0.06
356	300073	当升科技	4,100	206,353.00	0.06
357	000999	华润三九	3,400	206,244.00	0.06
358	01972	太古地产	11,600	206,016.00	0.06
359	603606	东方电缆	4,200	205,926.00	0.06
360	600875	东方电气	11,000	205,150.00	0.06
361	300390	天华新能	5,630	201,554.00	0.06
362	00101	恒隆地产	18,000	200,880.00	0.06
363	600705	中航产融	52,400	200,692.00	0.06
364	600027	华电国际	29,800	199,362.00	0.06
365	00270	粤海投资	32,000	199,360.00	0.06
366	000983	山西焦煤	21,900	199,290.00	0.06
367	000799	酒鬼酒	2,200	198,330.00	0.06
368	688063	派能科技	1,000	198,250.00	0.06
369	00285	比亚迪电子	9,000	196,650.00	0.06
370	06098	碧桂园服务	21,000	195,930.00	0.06
371	02007	碧桂园	133,000	195,510.00	0.06
372	600362	江西铜业	10,300	195,494.00	0.06
373	600754	锦江酒店	4,600	194,764.00	0.06
374	002240	盛新锂能	6,100	194,407.00	0.06
375	002600	领益智造	27,900	192,789.00	0.06
376	000723	美锦能源	25,500	192,270.00	0.06
377	601699	潞安环能	11,700	190,944.00	0.06
378	600918	中泰证券	27,600	190,716.00	0.06
379	603816	顾家家居	4,990	190,368.50	0.06
380	002756	永兴材料	3,030	189,708.30	0.06
381	601878	浙商证券	19,200	189,696.00	0.06
382	300832	新产业	3,200	188,800.00	0.06
383	601865	福莱特	4,900	188,699.00	0.06
384	603939	益丰药房	5,076	187,812.00	0.05
385	06110	滔搏	30,000	187,800.00	0.05
386	603613	国联股份	5,075	187,419.75	0.05
387	605358	立昂微	5,100	187,323.00	0.05
388	603486	科沃斯	2,400	186,648.00	0.05
389	601872	招商轮船	32,200	186,438.00	0.05

390	601319	中国人保	31,600	184,544.00	0.05
391	01308	海丰国际	14,000	184,520.00	0.05
392	603589	口子窖	3,700	182,595.00	0.05
393	603688	石英股份	1,600	182,144.00	0.05
394	03311	中国建筑国际	22,000	181,060.00	0.05
395	601799	星宇股份	1,452	179,467.20	0.05
396	600061	国投资本	25,200	179,424.00	0.05
397	000069	华侨城A	40,600	178,640.00	0.05
398	600563	法拉电子	1,300	178,490.00	0.05
399	002568	百润股份	4,880	177,388.00	0.05
400	601696	中银证券	16,300	173,758.00	0.05
401	06186	中国飞鹤	43,000	172,860.00	0.05
402	600803	新奥股份	9,100	172,718.00	0.05
403	603833	欧派家居	1,800	172,440.00	0.05
404	603290	斯达半导	800	172,160.00	0.05
405	000408	藏格矿业	7,600	171,532.00	0.05
406	600884	杉杉股份	11,300	171,082.00	0.05
407	300628	亿联网络	4,820	169,037.40	0.05
408	600141	兴发集团	7,600	168,872.00	0.05
409	09688	再鼎医药	8,600	166,496.00	0.05
410	603899	晨光股份	3,700	165,168.00	0.05
411	300601	康泰生物	6,440	163,511.60	0.05
412	600183	生益科技	11,500	163,300.00	0.05
413	00144	招商局港口	16,000	163,200.00	0.05
414	002938	鹏鼎控股	6,700	162,743.00	0.05
415	600160	巨化股份	11,800	162,604.00	0.05
416	688536	思瑞浦	745	162,410.00	0.05
417	000617	中油资本	22,100	159,783.00	0.05
418	000708	中信特钢	10,000	158,400.00	0.05
419	01378	中国宏桥	27,000	158,220.00	0.05
420	601966	玲珑轮胎	7,100	157,762.00	0.05
421	688005	容百科技	2,900	156,658.00	0.05
422	600026	中远海能	12,100	152,944.00	0.04
423	601898	中煤能源	18,000	151,920.00	0.04
424	300595	欧普康视	5,000	150,950.00	0.04
425	002916	深南电路	2,000	150,740.00	0.04
426	603185	弘元绿能	2,020	150,591.00	0.04
427	601881	中国银河	12,800	148,608.00	0.04
428	000703	恒逸石化	21,800	147,804.00	0.04
429	000629	钒钛股份	37,600	147,016.00	0.04

430	603198	迎驾贡酒	2,300	146,740.00	0.04
431	603737	三棵树	2,240	146,540.80	0.04
432	688180	君实生物	3,800	146,452.00	0.04
433	002353	杰瑞股份	5,800	145,754.00	0.04
434	600018	上港集团	27,600	144,900.00	0.04
435	300919	中伟股份	2,400	144,600.00	0.04
436	688363	华熙生物	1,600	142,656.00	0.04
437	03692	翰森制药	12,000	139,440.00	0.04
438	002120	韵达股份	14,400	137,664.00	0.04
439	603517	绝味食品	3,700	137,455.00	0.04
440	601216	君正集团	33,400	136,940.00	0.04
441	002064	华峰化学	19,700	135,142.00	0.04
442	06969	思摩尔国际	18,000	132,120.00	0.04
443	000877	天山股份	16,200	131,868.00	0.04
444	002414	高德红外	16,931	131,553.87	0.04
445	002080	中材科技	6,400	131,328.00	0.04
446	601155	新城控股	8,900	128,249.00	0.04
447	600025	华能水电	17,700	126,201.00	0.04
448	002939	长城证券	15,500	126,015.00	0.04
449	300957	贝泰妮	1,400	124,432.00	0.04
450	00656	复星国际	25,000	124,000.00	0.04
451	603893	瑞芯微	1,700	123,845.00	0.04
452	603456	九洲药业	4,500	123,210.00	0.04
453	02588	中银航空租 赁	2,100	122,661.00	0.04
454	03998	波司登	40,000	121,600.00	0.04
455	600779	水井坊	2,000	117,980.00	0.03
456	300529	健帆生物	4,900	113,582.00	0.03
457	688187	时代电气	2,600	108,836.00	0.03
458	688779	长远锂科	9,200	103,684.00	0.03
459	003022	联泓新科	4,100	102,090.00	0.03
460	600606	绿地控股	36,900	101,475.00	0.03
461	00316	东方海外国 际	1,000	96,900.00	0.03
462	00293	国泰航空	13,000	96,070.00	0.03
463	000987	越秀资本	14,910	94,678.50	0.03
464	601231	环旭电子	6,300	94,248.00	0.03
465	603195	公牛集团	900	86,454.00	0.03
466	603568	伟明环保	4,900	85,799.00	0.03
467	601808	中海油服	5,600	77,728.00	0.02
468	301269	华大九天	600	73,704.00	0.02

469	601698	中国卫通	3,700	73,556.00	0.02
470	688728	格科微	4,400	69,608.00	0.02
471	605499	东鹏饮料	400	69,160.00	0.02
472	300979	华利集团	1,200	58,488.00	0.02
473	002945	华林证券	2,700	36,936.00	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	688506	百利天恒	12,609	900,030.42	0.26
2	301486	致尚科技	2,191	126,333.06	0.04
3	301395	仁信新材	4,503	120,140.04	0.04
4	06666	恒大物业	53,500	113,420.00	0.03
5	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.03
6	301376	致欧科技	4,192	98,850.60	0.03
7	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.02
8	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.02
9	00813	世茂集团	18,000	73,440.00	0.02
10	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.02
11	03333	中国恒大	25,000	38,000.00	0.01
12	688249	晶合集成	1,901	34,332.06	0.01
13	688472	阿特斯	1,482	25,253.28	0.01
14	688361	中科飞测-U	369	23,863.23	0.01
15	301358	湖南裕能	546	23,417.94	0.01
16	301293	三博脑科	326	23,282.92	0.01
17	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.01
18	688531	日联科技	127	17,268.19	0.01
19	301260	格力博	684	16,162.92	0.00
20	688576	西山科技	132	15,894.12	0.00
21	301303	真兰仪表	693	15,467.76	0.00
22	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
23	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
24	301246	宏源药业	416	12,775.36	0.00
25	301387	光大同创	275	12,474.00	0.00
26	688484	南芯科技	339	12,444.69	0.00
27	301262	海看股份	480	12,240.00	0.00
28	688352	颀中科技	1,012	12,214.84	0.00
29	301332	德尔玛	842	11,560.66	0.00
30	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
31	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00

32	001287	中电港	533	11,203.66	0.00
33	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
34	688458	美芯晟	121	10,981.96	0.00
35	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
36	301322	绿通科技	183	9,742.92	0.00
37	688581	安杰思	82	9,678.46	0.00
38	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
39	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
40	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
41	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
42	301323	新莱福	222	8,737.92	0.00
43	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
44	688631	莱斯信息	292	8,722.04	0.00
45	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
46	301281	科源制药	326	8,182.60	0.00
47	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
48	688623	双元科技	87	7,550.73	0.00
49	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
50	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
51	688479	友车科技	235	6,930.15	0.00
52	301345	涛涛车业	136	6,343.04	0.00
53	001380	华纬科技	166	5,109.48	0.00
54	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
55	603125	常青科技	130	3,188.90	0.00
56	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
57	001367	海森药业	55	2,171.40	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	02888	渣打集团	1,497,365.74	0.41
2	00700	腾讯控股	425,975.95	0.12
3	600941	中国移动	342,935.00	0.09
3	00941	中国移动	52,629.03	0.01
4	688249	晶合集成	377,399.58	0.10
5	600028	中国石化	323,343.00	0.09
5	00386	中国石油化工股份	41,553.11	0.01
6	600886	国投电力	328,665.00	0.09
7	601916	浙商银行	305,057.40	0.08

8	09626	哔哩哔哩-W	287,114.20	0.08
9	01211	比亚迪	228,746.34	0.06
9	002594	比亚迪	53,632.00	0.01
10	600905	三峡能源	266,069.00	0.07
11	688777	中控技术	265,720.94	0.07
12	600702	舍得酒业	263,931.00	0.07
13	600372	中航电子	257,087.04	0.07
14	688126	沪硅产业	250,039.16	0.07
15	601901	方正证券	239,543.00	0.07
16	01171	兖矿能源	231,633.35	0.06
17	03690	美团-W	221,370.10	0.06
18	688223	晶科能源	217,055.21	0.06
19	000999	华润三九	211,353.00	0.06
20	301260	格力博	210,921.45	0.06

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	2,137,248.23	0.58
2	03690	美团-W	1,915,847.60	0.52
3	00005	汇丰控股	1,124,618.00	0.31
4	01299	友邦保险	1,024,456.14	0.28
5	300750	宁德时代	656,928.00	0.18
6	00939	建设银行	575,180.52	0.16
6	601939	建设银行	2,615.00	0.00
7	688515	裕太微	442,071.15	0.12
8	00941	中国移动	422,032.29	0.11
9	02318	中国平安	361,102.63	0.10
9	601318	中国平安	49,565.00	0.01
10	600900	长江电力	396,083.00	0.11
11	002594	比亚迪	267,808.00	0.07
11	01211	比亚迪	111,223.29	0.03
12	00388	香港交易所	372,488.96	0.10
13	01398	工商银行	345,804.09	0.09
13	601398	工商银行	17,686.00	0.00
14	000858	五粮液	358,772.00	0.10
15	688249	晶合集成	339,816.74	0.09
16	00981	中芯国际	338,648.86	0.09
17	600079	人福医药	308,620.00	0.08

18	000333	美的集团	274,023.00	0.07
19	02359	药明康德	255,476.99	0.07
19	603259	药明康德	13,231.00	0.00
20	002624	完美世界	265,760.00	0.07

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	20,874,329.96
卖出股票收入（成交）总额	37,187,228.70

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

注：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

注：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

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，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的处罚，在报告期内曾被中国银行间市场交易商协会立案调查。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国平安保险(集团)股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局深圳市分局的处罚。

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人民银行、中国银行保险监督管理委员会的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

本基金持有的其余证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	6,382.37
2	应收清算款	—
3	应收股利	792,322.10
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	1,981.46
9	其他	—
10	合计	800,685.93

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

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	601318	中国平安	92,800.00	0.03	转融通流通受限

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	688506	百利天恒	900,030.42	0.26	新股限售
2	301486	致尚科技	126,333.06	0.04	新股认购
3	301395	仁信新材	108,107.36	0.03	新股认购
3	301395	仁信新材	12,032.68	0.00	新股限售

4	06666	恒大物业	113,420.00	0.03	筹划重大事项
5	301488	豪恩汽电	93,721.68	0.03	新股认购
5	301488	豪恩汽电	10,422.36	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 (%)
6,845	66,998.12	143,840,865.00	31.37	314,761,260.00	68.63	108,940,900.00	23.75

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	BARCLAYS BANK PLC	12,907,739.00	2.81
2	于炳歧	10,000,000.00	2.18
3	张剑	5,000,000.00	1.09
4	中信证券股份有限公司	3,700,138.00	0.81
5	郑州尚之居物业服务有限公司	3,515,100.00	0.77
6	徐亚英	3,500,000.00	0.76
7	薛宏飞	3,500,000.00	0.76
8	北京中洲禾源投资咨询有限公司	3,000,000.00	0.65
9	陈琪	3,000,000.00	0.65
10	欧小清	2,787,600.00	0.61
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	108,940,900.00	23.75

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 (%)
基金管理人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	494,602,125.00
本报告期基金总申购份额	9,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	45,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	458,602,125.00

§ 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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
长江证券	3	5,413,219.24	10.63	3,904.21	21.99	—
诚通证券	2	157,601.45	0.31	113.68	0.64	—
东方证券	2	439,037.56	0.86	316.68	1.78	—
东吴证券	2	1,681,370.29	3.30	1,212.63	6.83	—

方正证券	1	—	—	—	—	—
广发证券	2	3,695,466.90	7.26	2,665.60	15.01	—
国盛证券	2	277,782.55	0.55	200.36	1.13	—
海通证券	2	8,063,599.34	15.83	2,596.63	14.62	—
华泰证券	2	972,317.69	1.91	701.30	3.95	—
华西证券	2	—	—	—	—	—
民生证券	3	2,571,837.53	5.05	1,855.13	10.45	—
申港证券	2	22,116,080.00	43.43	194.82	1.10	—
申万宏源	2	680,548.07	1.34	490.90	2.76	—
太平洋证券	2	367,440.95	0.72	265.07	1.49	—
银河证券	2	1,749,245.92	3.43	1,261.83	7.11	—
浙商证券	2	2,418,750.62	4.75	1,744.77	9.83	—
中金公司	2	323,730.13	0.64	233.51	1.32	—
中信建投	2	—	—	—	—	—
中信证券	2	—	—	—	—	—

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。本报告期内本基金租用券商交易单元无变更。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
长江证券	—	—	—	—	—	—
诚通证券	—	—	—	—	—	—
东方证券	—	—	—	—	—	—
东吴证券	16,411.85	18.44	—	—	—	—
方正证券	—	—	—	—	—	—
广发证券	—	—	—	—	—	—
国盛证券	18,421.95	20.70	—	—	—	—
海通证券	—	—	—	—	—	—
华泰证券	54,166.38	60.86	—	—	—	—
华西证券	—	—	—	—	—	—
民生证券	—	—	—	—	—	—

申港证券	—	—	—	—	—	—
申万宏源	—	—	—	—	—	—
太平洋证券	—	—	—	—	—	—
银河证券	—	—	—	—	—	—
浙商证券	—	—	—	—	—	—
中金公司	—	—	—	—	—	—
中信建投	—	—	—	—	—	—
中信证券	—	—	—	—	—	—

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基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2023年02月02日
2	富国基金管理有限公司关于调整旗下部分基金 2023 年非港股通交易日暂停申购、赎回等业务安排的公告	规定披露媒介	2023年03月01日
3	富国基金管理有限公司关于富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更的公告	规定披露媒介	2023年03月04日
4	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	2023年03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	2023年06月15日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
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	1	2023-01-01 至 2023-06-30	103,886,800.00	5,054,100.00	—	108,940,900.00	23.75%
产品特有风险							
<p>本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。</p>							

§ 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）公司网址： http://www.fullgoal.com.cn 。