

富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金

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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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	7
2.4	信息披露方式	7
2.5	其他相关资料	7
§3	主要财务指标和基金净值表现	8
3.1	主要会计数据和财务指标	8
3.2	基金净值表现	9
§4	管理人报告	12
4.1	基金管理人及基金经理情况	12
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
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	15
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	47
7.1	期末基金资产组合情况	47

7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	47
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	48
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	57
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	58
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.....	59
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.....	59
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.....	59
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.....	59
7.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	59
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	59
7.12	投资组合报告附注.....	60
§8	基金份额持有人信息.....	62
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	62
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	62
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	62
§9	开放式基金份额变动.....	63
§10	重大事件揭示.....	64
10.1	基金份额持有人大会决议.....	64
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	64
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	64
10.4	基金投资策略的改变.....	64
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	64
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.....	64
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	64
10.8	其他重大事件.....	67
§11	影响投资者决策的其他重要信息.....	68
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.....	68
§12	备查文件目录.....	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金		
基金简称	富国天源沪港深平衡混合		
基金主代码	100016		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2002年08月16日		
基金管理人	富国基金管理有限公司		
基金托管人	中国农业银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	213,764,822.59份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	富国天源沪港深平衡混合 A/B	富国天源沪港深平衡混合C	
下属分级基金的交易代码	前端	后端	014931
	100016	100017	
报告期末下属分级基金的份额总额	203,558,717.06份		10,206,105.53份

2.2 基金产品说明

投资目标	<p>本基金的投资目标是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增长。</p> <p>本基金为平衡型证券投资基金，将基金资产均衡投资于股票和债券，并对基金的投资组合进行主动的管理，从而使投资者在承受相对较小风险的情况下，尽可能获得稳定的投资收益。</p>
投资策略	<p>本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，进行定量与定性相结合的分析研究，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。同时，本基金将运用“价值为本，成长为重”的合理价格成长投资策略来确定对境内股票及港股通标的股票的具体选股标准，该策略通过建立统一的价值评估框架，综合考虑上市公司的增长潜力和市场估值水平，以寻找具有增长潜力且价格合理或被低估的股票。本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的研究判断，进行存托凭证的投资。本基金采用久期控制下的主动性债券投资策略。本基金的金融衍生工具投资策略详见法律文件。</p>
业绩比较基准	<p>沪深300指数收益率×65%+中债综合全价指数收益率×30%+同业存款利率×5%。</p>
风险收益特征	<p>本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，需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。</p>

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	秦一楠
	联系电话	021-20361818	010-66060069
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		95105686、4008880688	95599
传真		021-20361616	010-63201816
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层	北京市东城区建国门内大街69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28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		200120	100031
法定代表人		裴长江	谷澍

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 中国农业银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

(1) 富国天源沪港深平衡混合 A/B

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	9,550,015.93
本期利润	29,346,026.01
加权平均基金份额本期利润	0.1353
本期加权平均净值利润率	5.05%
本期基金份额净值增长率	5.73%
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	340,682,378.72
期末可供分配基金份额利润	1.6736
期末基金资产净值	544,241,095.78
期末基金份额净值	2.674
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	862.02%

(2) 富国天源沪港深平衡混合 C

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	-135,629.94
本期利润	-21,715.89
加权平均基金份额本期利润	-0.0102
本期加权平均净值利润率	-0.38%
本期基金份额净值增长率	5.40%
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	16,696,310.81
期末可供分配基金份额利润	1.6359
期末基金资产净值	26,902,416.34
期末基金份额净值	2.636
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	-2.12%

注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

(1) 富国天源沪港深平衡混合 A/B

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.10%	0.83%	0.82%	0.56%	0.28%	0.27%
过去三个月	-1.55%	0.73%	-3.06%	0.54%	1.51%	0.19%
过去六个月	5.73%	0.74%	-0.02%	0.55%	5.75%	0.19%
过去一年	-2.41%	0.91%	-8.93%	0.64%	6.52%	0.27%
过去三年	8.04%	1.15%	-3.03%	0.78%	11.07%	0.37%
自基金合同生效起至今	862.02%	1.16%	166.13%	1.03%	695.89%	0.13%

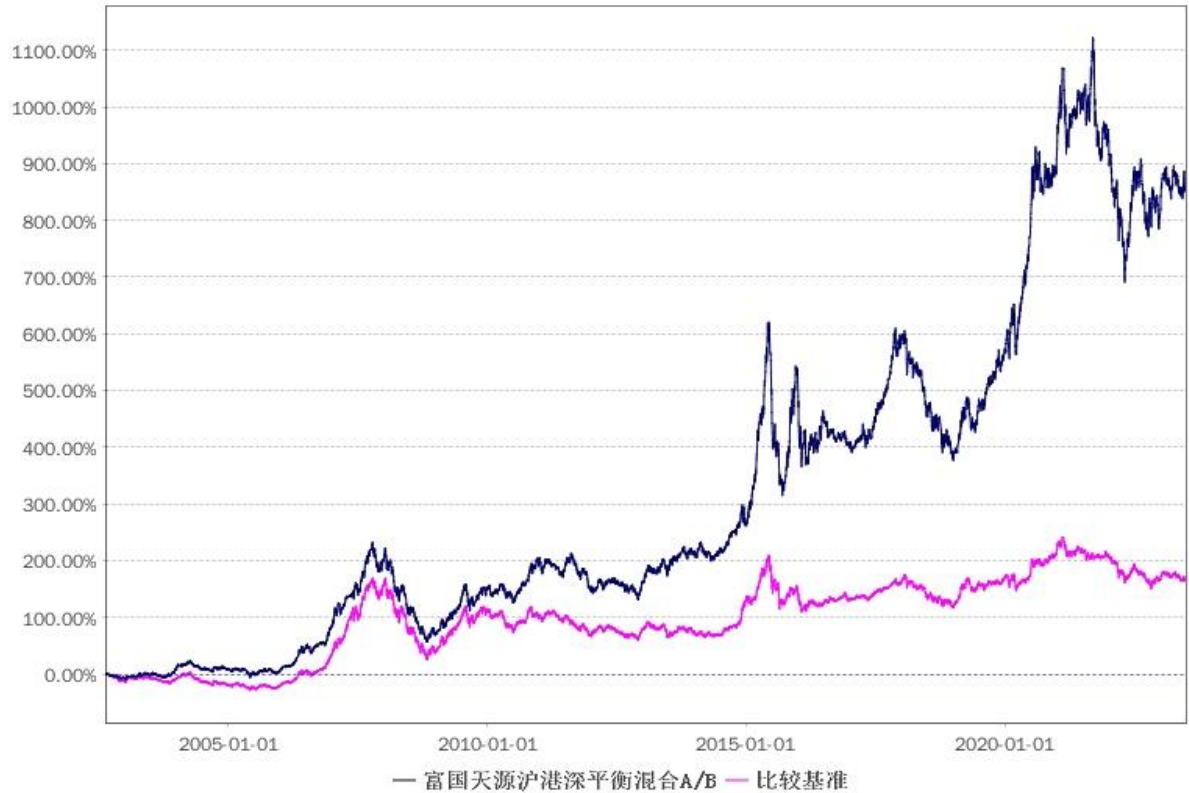
(2) 富国天源沪港深平衡混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.03%	0.83%	0.82%	0.56%	0.21%	0.27%
过去三个月	-1.72%	0.73%	-3.06%	0.54%	1.34%	0.19%
过去六个月	5.40%	0.74%	-0.02%	0.55%	5.42%	0.19%
过去一年	-3.55%	0.91%	-8.93%	0.64%	5.38%	0.27%
自基金分级生效日起至今	-2.12%	1.08%	-11.25%	0.75%	9.13%	0.33%

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

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

(1) 自基金合同生效以来富国天源沪港深平衡混合 A/B 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2023 年 6 月 30 日。

2、本基金于 2002 年 8 月 16 日成立，建仓期 6 个月，从 2002 年 8 月 16 日起至 2003 年 2 月 15 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

(2) 自基金合同生效以来富国天源沪港深平衡混合 C 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2023 年 6 月 30 日。

2、本基金自 2022 年 1 月 25 日起增加 C 类份额，相关数据按实际存续期计算。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

目前，公司注册资本金 5.2 亿元人民币，股东为：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		
曾新杰	本基金现任基金经理	2021-11-23	—	7	硕士，曾任深圳物明投资管理有限公司研究员；自 2018 年 5 月加入富国基金管理有限公司，历任行业研究员、权益基金经理；现任富国基金权益投资部高级权益基金经

					理。自 2020 年 05 月起任富国生物科技混合型证券投资基金基金经理；自 2021 年 11 月起任富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金(原富国天源平衡混合型证券投资基金)基金经理；具有基金从业资格。
--	--	--	--	--	--------------------------------------------------------------------------------------------------------

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作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天源沪港深平衡混合型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》、《富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金基金合同》（原《富国天源平衡混合型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

2023年上半年，万得全A上涨3%，沪深300下跌0.75%，市场经历了大幅波动。受海外加息及经济复苏预期减弱影响，市场风险偏好降低，以消费、医药、新能源为代表的赛道白马股明显回调，以人工智能、机器人为代表的科技新成长迎来一波牛市行情。展望未来，各个行业中具备远期成长空间的新成长公司将迎来新一轮的成长周期和投资机会。本基金的主要策略是继续在新科技、新医药、新消费、新能源等成长领域均衡配置，同时自下而上寻找长期有竞争力和成长空间的标的，在合理估值时买入，以期分享行业与公司长期成长带来的回报。

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A/B级为2.674元，C级为2.636元；份额累计净值A/B级为4.387元，C级为2.636元；本报告期，本基金份额

净值增长率 A/B 级为 5.73%，C 级为 5.40%，同期业绩比较基准收益率 A/B 级为-0.02%，C 级为-0.02%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来 5 年，人工智能、机器人、自动驾驶等领域可能出现许多颠覆性技术，他们将极大改变人类的生活，也蕴含着巨大的投资机会。尤其是本轮人工智能革命有可能引领本次技术革命浪潮，带来史诗级的行业变化。另外，机器人，自动驾驶，新医药，新消费也有望迎新一轮成长周期。国企改革密集落地，有可能系统性提升国企的经营效率和投资回报，其中具有良好产品和技术积累的国企可能在体制机制理顺后可能具备重大投资机会。

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—富国基金管理有限公司 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，富国基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，富国基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 中期财务报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金

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	20,760,587.44	34,629,365.62
结算备付金	2,030,729.62	2,151,034.65
存出保证金	211,642.95	173,623.75
交易性金融资产	535,742,183.07	469,521,961.25
其中：股票投资	378,194,156.21	340,424,715.56
基金投资	—	—
债券投资	157,548,026.86	129,097,245.69
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	-6,205.79	—
应收清算款	14,147,319.87	2,726,467.97
应收股利	16,101.49	—
应收申购款	423,765.97	18,537.10
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	573,326,124.62	509,220,990.34
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	0.19	3,163,594.26
应付赎回款	249,585.58	263,655.43
应付管理人报酬	685,698.52	649,967.45
应付托管费	114,283.07	108,327.93
应付销售服务费	5,728.72	2,197.80
应付投资顾问费	—	—
应交税费	36,274.81	36,662.06

应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	1,091,041.61	629,119.27
负债合计	2,182,612.50	4,853,524.20
净资产：		
实收基金	213,764,822.59	199,448,074.12
其他综合收益	—	—
未分配利润	357,378,689.53	304,919,392.02
净资产合计	571,143,512.12	504,367,466.14
负债和净资产总计	573,326,124.62	509,220,990.34

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.672 元，基金份额总额 213,764,822.59 份。其中：富国天源沪港深平衡混合 A/B 份额净值 2.674 元，份额总额 203,558,717.06 份；富国天源沪港深平衡混合 C 份额净值 2.636 元，份额总额 10,206,105.53 份。

6.2 利润表

会计主体：富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金

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	34,540,824.43	-39,515,462.85
1.利息收入	146,175.14	70,396.89
其中：存款利息收入	143,072.25	68,591.95
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	3,102.89	1,804.94
证券出借利息收入	—	—
其他利息收入	—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）	14,403,547.26	-30,735,752.86
其中：股票投资收益	12,308,875.93	-33,879,243.27
基金投资收益	—	—
债券投资收益	-811,659.36	916,335.82
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具收益	—	—
股利收益	2,906,330.69	2,227,154.59
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）	19,909,924.13	-8,879,885.68
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	81,177.90	29,778.80
减：二、营业总支出	5,216,514.31	4,668,599.84
1. 管理人报酬	4,371,591.42	3,916,955.04
2. 托管费	728,598.55	652,825.84
3. 销售服务费	17,366.49	979.33
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	1,054.06	1,013.18
8. 其他费用	97,903.79	96,826.45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	29,324,310.12	-44,184,062.69
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	29,324,310.12	-44,184,062.69
五、其他综合收益的税后净额	—	—
六、综合收益总额	29,324,310.12	-44,184,062.69

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金

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）	199,448,074.12	304,919,392.02	504,367,466.14
加：会计政策变更	—	—	—
二、本期期初净资产（基金净值）	199,448,074.12	304,919,392.02	504,367,466.14
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	14,316,748.47	52,459,297.51	66,776,045.98
（一）、综合收益总额	—	29,324,310.12	29,324,310.12
（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）	14,316,748.47	23,134,987.39	37,451,735.86
其中：1. 基金申购款	47,122,200.76	77,728,868.97	124,851,069.73
2. 基金赎回款	-32,805,452.29	-54,593,881.58	-87,399,333.87
（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）	213,764,822.59	357,378,689.53	571,143,512.12
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）	211,518,090.71	411,721,158.31	623,239,249.02
加：会计政策变更	—	—	—
二、本期期初净资产（基金净值）	211,518,090.71	411,721,158.31	623,239,249.02
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-6,934,349.40	-55,836,660.05	-62,771,009.45
（一）、综合收益总额	—	-44,184,062.69	-44,184,062.69
（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）	-6,934,349.40	-11,652,597.36	-18,586,946.76
其中：1.基金申购款	8,068,823.19	12,677,402.28	20,746,225.47
2.基金赎回款	-15,003,172.59	-24,329,999.64	-39,333,172.23
（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）	204,583,741.31	355,884,498.26	560,468,239.57

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 基金管理公司负责人

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

富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金（原名富国天源平衡混合型证券投资基金）（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2002]36号文《关于同意富国动态平衡证券投资基金设

立的批复》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 2002 年 8 月 16 日正式生效，首次设立募集规模为 4,616,913,656.00 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。根据基金管理人于 2022 年 1 月 21 日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下部分基金增加 C 类基金份额并相应修订基金合同及托管协议的公告》，自 2022 年 1 月 25 日起，本基金增加 C 类份额。本基金的基金管理人及注册登记机构为富国基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。自 2007 年 4 月 13 日起，本基金由“富国动态平衡证券投资基金”正式更名为“富国天源平衡混合型证券投资基金”。

根据富国天源平衡混合型证券投资基金基金份额持有人大会通过的《关于修改富国天源平衡混合型证券投资基金基金合同、招募说明书有关事项的议案》，自 2015 年 10 月 27 日起，变更后的《富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金基金合同》生效，原《富国天源平衡混合型证券投资基金基金合同》同日起失效。

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会批准上市的股票）、港股通标的股票、存托凭证、固定收益类资产（包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、可交换债券、中小企业私募债券、证券公司发行的短期公司债券、资产支持证券、债券回购、银行存款等经中国证监会允许投资的固定收益类资产）、衍生工具（权证、股指期货）、以及经中国证监会批准允许基金投资的其他金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：股票及存托凭证投资占基金资产的比例为 0-75%（其中，投资于国内依法发行上市的股票及存托凭证的比例占基金资产的 0-75%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-75%）；债券投资占基金资产的比例为 25%-80%；权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，基金管理人在履行适当程序后，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：沪深 300 指数收益率×65%+中债综合全价指数收

益率×30%+同业存款利率×5%。

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 (2023年06月30日)
活期存款	20,760,587.44
等于：本金	20,748,434.20
加：应计利息	12,153.24
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	20,760,587.44

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	402,510,597.58	—	378,194,156.21	—24,316,441.37
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—
债券	155,351,097.34	1,761,507.86	157,548,026.86	435,421.66

	银行间市场	—	—	—	—
	合计	155,351,097.34	1,761,507.86	157,548,026.86	435,421.66
	资产支持证券	—	—	—	—
	基金	—	—	—	—
	其他	—	—	—	—
	合计	557,861,694.92	1,761,507.86	535,742,183.07	23,881,019.71

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

单位：人民币元

项目	本期末（2023年06月30日）	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-6,205.79	—
银行间市场	—	—
合计	-6,205.79	—

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易。

6.4.7.5 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2023年06月30日）
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	113.09
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	966,604.91
其中：交易所市场	966,604.91
银行间市场	—
应付利息	—
预提信息披露费	60,000.00
预提审计费	64,323.61
合计	1,091,041.61

6.4.7.7 实收基金

富国天源沪港深平衡混合 A/B:

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	198,024,652.09	198,024,652.09
本期申购	35,353,319.74	35,353,319.74
本期赎回（以“-”号填列）	-29,819,254.77	-29,819,254.77
本期末	203,558,717.06	203,558,717.06

富国天源沪港深平衡混合 C:

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	1,423,422.03	1,423,422.03
本期申购	11,768,881.02	11,768,881.02
本期赎回（以“-”号填列）	-2,986,197.52	-2,986,197.52
本期末	10,206,105.53	10,206,105.53

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

富国天源沪港深平衡混合 A/B:

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	393,198,965.77	-	302,783,327.35
本期利润	9,550,015.93	19,796,010.08	29,346,026.01
本期基金份额交易产生的变动数	9,309,836.52	-756,811.16	8,553,025.36
其中：基金申购款	71,062,987.17	-	58,174,065.17
基金赎回款	-61,753,150.65	12,132,110.84	-49,621,039.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	412,058,818.22	-	340,682,378.72

富国天源沪港深平衡混合 C:

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	2,784,823.14	-648,758.47	2,136,064.67
本期利润	-135,629.94	113,914.05	-21,715.89
本期基金份额交易产生的变动数	17,629,654.02	-	14,581,962.03
其中：基金申购款	23,551,726.94	-	19,554,803.80

		3,996,923.14	
基金赎回款	-5,922,072.92	949,231.15	-4,972,841.77
本期已分配利润	—	—	—
本期末	20,278,847.22	3,582,536.41	16,696,310.81

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	120,313.26
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	20,041.24
其他	2,717.75
合计	143,072.25

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）
卖出股票成交总额	1,189,378,547.70
减：卖出股票成本总额	1,173,901,481.82
减：交易费用	3,168,189.95
买卖股票差价收入	12,308,875.93

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	1,205,651.39
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-2,017,310.75
合计	-811,659.36

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	185,383,517.36
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	185,725,020.01
减：应计利息总额	1,668,072.22

减：交易费用	7,735.88
债券投资收益-差价收入	-2,017,310.75

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	2,906,330.69
其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	—
合计	2,906,330.69

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	19,909,924.13
股票投资	14,973,358.46
债券投资	4,936,565.67
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	19,909,924.13
----	---------------

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	79,868.22
基金转换费收入	1,309.68
合计	81,177.90

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	21,323.61
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	6,731.72
债券账户维护费	9,000.00
其他	848.46
合计	97,903.79

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、注册登记机构、基金销售机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
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
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
申万宏源证券承销保荐有限责任公司	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	207,576,599.59	8.74	78,835,586.24	5.79
申万宏源	386,787,003.53	16.29	218,407,324.99	16.05

6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

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	28,309,718.96	8.81	25,348,812.31	9.23
申万宏源	37,093,653.41	11.55	33,936,307.50	12.35

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	149,724.78	9.00	112,405.25	11.63
申万宏源	227,881.62	13.70	161,760.08	16.73
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	169,148.63	13.93	60,619.44	12.67
海通证券	71,895.14	5.92	11,938.03	2.50

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	4,371,591.42	3,916,955.04
其中：支付销售机构的客户维护费	893,961.64	801,736.00

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（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	728,598.55	652,825.84

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富国天源沪港深平衡混合 A/B	富国天源沪港深平衡混合 C	合计
富国基金管理有限公司	—	4,094.80	4,094.80
合计	—	4,094.80	4,094.80

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间（2022年01月01日至2022年06月30日）		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富国天源沪港深平衡混合 A/B	富国天源沪港深平衡混合 C	合计
富国基金管理有限公司	—	972.86	972.86
合计	—	972.86	972.86

注：自 2022 年 1 月 25 日起，本基金增加收取销售服务费的 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.60% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

C 类基金份额的销售服务费每日计提，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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适

用固定期限费率从事证券出借业务。

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期（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）	
	富国天源沪港深平衡混合 A/B	富国天源沪港深平衡混合 C	富国天源沪港深平衡混合 A/B	富国天源沪港深平衡混合 C
基金合同生效日（2002年08月16日）持有的基金份额	—	—	—	—
期初持有的基金份额	—	371.33	—	—
期间申购/买入总份额	—	—	—	371.33
期间因拆分变动份额	—	—	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	—	—	—
期末持有的基金份额	—	371.33	—	371.33
期末持有的基金份额占基金总份额比例	—	0.00%	—	0.02%

注：本基金管理人投资本基金按照公告的费率条款执行，不存在费率优惠的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期（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）

	月 30 日)		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
中国农业银行股份有限公司	20,760,587.44	120,313.26	14,692,148.28	50,704.59

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	688469	中芯集成	IPO 网下申购	63,339	360,398.91

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	2,608	109,821.58
海通证券股份有限公司	688062	迈威生物	IPO 网下申购	13,819	483,305.71
海通证券股份有限公司	688220	翱捷科技	IPO 网下申购	3,236	535,113.70

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（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	—
001286	陕西能源	2023-03-31	6 个月	新股限售	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	—
001287	中电港	2023-03-30	6 个月	新股限售	11.88	21.02	860	10,216.80	18,077.20	—

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	—
001360	南矿集团	2023-03-31	6个月	新股限售	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	—
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	170	4,902.80	5,232.60	—
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	—
301246	宏源药业	2023-03-10	6个月	新股限售	50.00	30.71	658	32,900.00	20,207.18	—
301260	格力博	2023-01-20	6个月	新股限售	30.85	23.63	956	29,492.60	22,590.28	—
301293	三博脑科	2023-04-25	6个月	新股限售	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	—
301303	真兰仪表	2023-02-13	6个月	新股限售	26.80	22.32	1,058	28,354.40	23,614.56	—
301305	朗坤环境	2023-05-15	6个月	新股限售	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	—
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	198	25,959.78	10,541.52	—
301322	绿通科技	2023-05-25	4个月	新股限售 转增	—	53.24	99	—	5,270.76	—
301323	新莱福	2023-05-29	6个月	新股限售	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	—
301332	德尔玛	2023-05-09	6个月	新股限售	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	—
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	216	15,865.20	10,074.24	—
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	—
301360	荣旗科技	2023-04-17	6个月	新股限售	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	—
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	—
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	307	17,904.24	13,925.52	—
301399	英特科技	2023-05-16	6个月	新股限售	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	—
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	—
601065	江盐集团	2023-03-31	6个月	新股限售	10.36	11.84	600	6,216.00	7,104.00	—
603125	常青科技	2023-03-30	6个月	新股限售	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	—
688249	晶合集成	2023-04-24	6个月	新股限售	19.86	18.06	3,110	61,764.60	56,166.60	—
688352	顾中科技	2023-04-11	6个月	新股限售	12.10	12.07	1,649	19,952.90	19,903.43	—
688361	中科飞测	2023-05-12	6个月	新股限售	23.60	64.67	608	14,348.80	39,319.36	—
688433	华曙高科	2023-04-07	6个月	新股限售	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	—
688458	美芯晟	2023-05-15	6个月	新股限售	75.00	90.76	198	14,850.00	17,970.48	—
688469	中芯集成	2023-04-28	6个月	新股限售	5.69	5.41	6,334	36,040.46	34,266.94	—
688478	晶升股份	2023-04-13	6个月	新股限售	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	—
688479	友车科技	2023-05-04	6个月	新股限售	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	—
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	—
688581	安杰思	2023-05-12	6个月	新股限售	125.80	118.03	131	16,479.80	15,461.93	—
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	—

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 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

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部和合规稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。由于国债、央行票据和政策性金融债的信用风险很低，故不进行列示。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的信用债。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末（2023年06月30日）	上年度末（2022年12月31日）
AAA	31,124,039.64	48,134,784.35
AAA 以下	18,767,751.43	29,241,916.02
未评级	—	—
合计	49,891,791.07	77,376,700.37

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。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、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	20,760,587.44	—	—	—	—	—	20,760,587.44
结算备付金	2,030,729.62	—	—	—	—	—	2,030,729.62
存出保证金	211,642.95	—	—	—	—	—	211,642.95
交易性金融资产	55,378,052.38	15,391,416.57	76,377,665.85	10,400,892.06	—	378,194,156.21	535,742,183.07
买入返售金融资产	-6,205.79	—	—	—	—	—	-6,205.79
应收清算款	—	—	—	—	—	14,147,319.87	14,147,319.87
应收股利	—	—	—	—	—	16,101.49	16,101.49
应收申购款	—	—	—	—	—	423,765.97	423,765.97
资产总计	78,374,806.60	15,391,416.57	76,377,665.85	10,400,892.06	—	392,781,343.54	573,326,124.62
负债							
应付清算款	—	—	—	—	—	0.19	0.19
应付赎回款	—	—	—	—	—	249,585.58	249,585.58
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	685,698.52	685,698.52
应付托管费	—	—	—	—	—	114,283.07	114,283.07
应付销售服务费	—	—	—	—	—	5,728.72	5,728.72
应交税费	—	—	—	—	—	36,274.81	36,274.81
其他负债	—	—	—	—	—	1,091,041.61	1,091,041.61
负债总计	—	—	—	—	—	2,182,612.50	2,182,612.50
利率敏感度缺口	78,374,806.60	15,391,416.57	76,377,665.85	10,400,892.06	—	390,598,731.04	571,143,512.12
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

月 31 日)							
资产							
银行存款	34,629,365.62	—	—	—	—	—	34,629,365.62
结算备付金	2,151,034.65	—	—	—	—	—	2,151,034.65
存出保证金	173,623.75	—	—	—	—	—	173,623.75
交易性金融资产	59,457,178.52	13,739,338.46	27,019,601.41	28,881,127.30	—	340,424,715.56	469,521,961.25
应收清算款	—	—	—	—	—	2,726,467.97	2,726,467.97
应收申购款	—	—	—	—	—	18,537.10	18,537.10
资产总计	96,411,202.54	13,739,338.46	27,019,601.41	28,881,127.30	—	343,169,720.63	509,220,990.34
负债							
应付清算款	—	—	—	—	—	3,163,594.26	3,163,594.26
应付赎回款	—	—	—	—	—	263,655.43	263,655.43
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	649,967.45	649,967.45
应付托管费	—	—	—	—	—	108,327.93	108,327.93
应付销售服务费	—	—	—	—	—	2,197.80	2,197.80
应交税费	—	—	—	—	—	36,662.06	36,662.06
其他负债	—	—	—	—	—	629,119.27	629,119.27
负债总计	—	—	—	—	—	4,853,524.20	4,853,524.20
利率敏感度缺口	96,411,202.54	13,739,338.46	27,019,601.41	28,881,127.30	—	338,316,196.43	504,367,466.14

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

下表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

假设	1. 影响生息资产公允价值的其他变量不变，仅利率发生变动；2. 利率变动范围合理。		
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. 基准点利率增加0.1%	-53,362.47	-17,704.85
	2. 基准点利率减少0.1%	53,362.47	17,704.85

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	—	12,943,418.90	—	—	12,943,418.90
应收股利	—	16,101.49	—	—	16,101.49
资产合计	—	12,959,520.39	—	—	12,959,520.39
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	—	12,959,520.39	—	—	12,959,520.39
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	—	14,216,928.77	—	—	14,216,928.77
资产合计	—	14,216,928.77	—	—	14,216,928.77
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	—	14,216,928.77	—	—	14,216,928.77

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%	-129,595.20	-142,169.29
	港币相对人民币升值 1%	129,595.20	142,169.29

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

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会批准上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、固定收益类资产（包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、可交换债券、中小企业私募债券、证券公司发行的短期公司债券、资产

支持证券、债券回购、银行存款等经中国证监会允许投资的固定收益类资产)、衍生工具(权证、股指期货)、以及经中国证监会批准允许基金投资的其他金融工具(但需符合中国证监会的相关规定)。基金的投资组合比例为:股票及存托凭证投资占基金资产的比例为0-75%(其中,投资于国内依法发行上市的股票及存托凭证的比例占基金资产的0-75%,投资于港股通标的股票的比例占基金资产的0-75%);债券投资占基金资产的比例为25%-80%;权证投资占基金资产净值的比例为0%-3%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金面临的整体市场价格风险列示如下:

金额单位:人民币元

项目	本期末(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	378,194,156.21	66.22	340,424,715.56	67.50
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	157,548,026.86	27.58	129,097,245.69	25.60
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	535,742,183.07	93.80	469,521,961.25	93.09

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%	5,337,836.46	5,993,583.90
	2. 业绩比较基准减少 1%	-5,337,836.46	-5,993,583.90

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	405,256,094.44	380,819,938.91
第二层次	129,878,401.56	84,107,335.21
第三层次	607,687.07	4,594,687.13
合计	535,742,183.07	469,521,961.25

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	378,194,156.21	65.96
	其中：股票	378,194,156.21	65.96
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	157,548,026.86	27.48
	其中：债券	157,548,026.86	27.48
	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	-6,205.79	0.00
	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	22,791,317.06	3.98
8	其他各项资产	14,798,830.28	2.58
9	合计	573,326,124.62	100.00

注：本基金通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为 881,256.02 元，占资产净值比例为 0.15%；通过深港通交易机制投资的港股公允价值为 12,062,162.88 元，占资产净值比例为 2.11%。

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

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	6,862,119.03	1.20
C	制造业	232,333,054.23	40.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,413,362.59	0.60
E	建筑业	6,083,059.55	1.07
F	批发和零售业	4,669,665.45	0.82
G	交通运输、仓储和邮政业	1,950,847.70	0.34
H	住宿和餐饮业	1,139,818.40	0.20
I	信息传输、软件和信息技术服务业	53,571,502.12	9.38
J	金融业	10,601,698.09	1.86

K	房地产业	2,989,367.00	0.52
L	租赁和商务服务业	3,189.69	0.00
M	科学研究和技术服务业	33,498,779.84	5.87
N	水利、环境和公共设施管理业	314,799.10	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	2,886,376.86	0.51
R	文化、体育和娱乐业	4,933,097.66	0.86
S	综合	—	—
	合计	365,250,737.31	63.95

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（%）
医疗保健	12,338,826.96	2.16
非日常生活消费品	529,920.00	0.09
日常消费品	72,597.84	0.01
工业	1,722.88	0.00
能源	351.22	0.00
合计	12,943,418.90	2.27

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沪港通深港通投资的股票。

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	占基金资产净值比例（%）
1	688621	阳光诺和	487,326	28,664,515.32	5.02
2	600519	贵州茅台	14,900	25,195,900.00	4.41
3	600941	中国移动	145,700	13,593,810.00	2.38
4	02279	雍禾医疗	1,567,000	11,125,700.00	1.95
5	300573	兴齐眼药	51,600	11,032,080.00	1.93
6	000568	泸州老窖	46,800	9,807,876.00	1.72
7	688358	祥生医疗	185,365	9,453,615.00	1.66
8	300750	宁德时代	39,260	8,982,295.40	1.57
9	300308	中际旭创	51,200	7,549,440.00	1.32
10	000596	古井贡酒	24,900	6,159,762.00	1.08
11	002555	三七互娱	173,700	6,058,656.00	1.06
12	600600	青岛啤酒	55,400	5,741,102.00	1.01
12	00168	青岛啤酒股份	1,106	72,597.84	0.01

13	600329	达仁堂	123,200	5,530,448.00	0.97
14	688389	普门科技	233,303	5,480,287.47	0.96
15	300487	蓝晓科技	77,700	4,850,034.00	0.85
16	688111	金山办公	9,756	4,606,978.32	0.81
17	605186	健麾信息	92,200	4,563,900.00	0.80
18	600572	康恩贝	662,700	4,539,495.00	0.79
19	002230	科大讯飞	57,100	3,880,516.00	0.68
20	000858	五粮液	23,200	3,794,824.00	0.66
21	300624	万兴科技	30,100	3,526,215.00	0.62
22	600566	济川药业	118,300	3,435,432.00	0.60
23	000989	九芝堂	245,900	3,403,256.00	0.60
24	300274	阳光电源	28,300	3,300,629.00	0.58
25	603019	中科曙光	60,900	3,099,810.00	0.54
26	300394	天孚通信	27,400	2,927,142.00	0.51
27	000063	中兴通讯	60,800	2,768,832.00	0.48
28	601138	工业富联	98,800	2,489,760.00	0.44
29	002959	小熊电器	29,600	2,471,600.00	0.43
30	601801	皖新传媒	261,900	2,459,241.00	0.43
31	300494	盛天网络	98,820	2,449,747.80	0.43
32	600028	中国石化	381,900	2,428,884.00	0.43
33	600422	昆药集团	117,000	2,424,240.00	0.42
34	688351	微电生理	124,148	2,417,161.56	0.42
35	688338	赛科希德	41,703	2,312,431.35	0.40
36	600900	长江电力	102,000	2,250,120.00	0.39
37	600938	中国海油	123,500	2,237,820.00	0.39
37	00883	中国海洋石油	34	351.22	0.00
38	600285	羚锐制药	135,800	2,180,948.00	0.38
39	002154	报喜鸟	391,400	2,160,528.00	0.38
40	002271	东方雨虹	78,300	2,134,458.00	0.37
41	300298	三诺生物	78,900	2,133,456.00	0.37
42	600426	华鲁恒升	69,500	2,128,785.00	0.37
43	000977	浪潮信息	43,700	2,119,450.00	0.37
44	601881	中国银河	180,151	2,091,553.11	0.37
45	688073	毕得医药	29,491	2,087,372.98	0.37
46	601988	中国银行	529,800	2,071,518.00	0.36
47	002275	桂林三金	112,000	2,017,120.00	0.35
48	601668	中国建筑	347,600	1,995,224.00	0.35
49	600050	中国联通	414,000	1,987,200.00	0.35
50	600016	民生银行	526,300	1,973,625.00	0.35
51	001330	博纳影业	207,800	1,928,384.00	0.34

52	601669	中国电建	334,700	1,921,178.00	0.34
53	301015	百洋医药	64,300	1,784,968.00	0.31
54	300118	东方日升	62,100	1,591,623.00	0.28
55	300748	金力永磁	52,300	1,564,816.00	0.27
56	688576	西山科技	11,650	1,550,149.00	0.27
57	688385	复旦微电	30,779	1,542,027.90	0.27
58	300953	震裕科技	20,500	1,509,415.00	0.26
59	688498	源杰科技	5,165	1,472,025.00	0.26
60	300502	新易盛	21,280	1,446,401.60	0.25
61	600547	山东黄金	61,300	1,439,324.00	0.25
62	601136	首创证券	101,139	1,433,139.63	0.25
63	603444	吉比特	2,800	1,375,108.00	0.24
64	300315	掌趣科技	163,200	1,272,960.00	0.22
65	688071	华依科技	20,452	1,250,639.80	0.22
66	300316	晶盛机电	17,500	1,240,750.00	0.22
67	600211	西藏药业	20,600	1,223,640.00	0.21
68	301191	菲菱科思	11,800	1,220,356.00	0.21
69	688793	倍轻松	22,433	1,209,138.70	0.21
70	300559	佳发教育	72,300	1,192,950.00	0.21
71	688566	吉贝尔	30,328	1,183,095.28	0.21
72	601728	中国电信	209,100	1,177,233.00	0.21
73	601799	星宇股份	9,500	1,174,200.00	0.21
74	002475	立讯精密	36,100	1,171,445.00	0.21
75	688513	苑东生物	21,286	1,167,749.96	0.20
76	300705	九典制药	44,000	1,162,920.00	0.20
77	002066	瑞泰科技	97,200	1,161,540.00	0.20
78	002262	恩华药业	37,600	1,159,208.00	0.20
79	000999	华润三九	19,100	1,158,606.00	0.20
80	688668	鼎通科技	11,816	1,155,604.80	0.20
81	301030	仕净科技	16,542	1,143,052.20	0.20
82	600754	锦江酒店	26,900	1,138,946.00	0.20
83	002920	德赛西威	7,300	1,137,413.00	0.20
84	000921	海信家电	42,100	1,134,595.00	0.20
85	688677	海泰新光	19,949	1,131,906.26	0.20
86	603833	欧派家居	11,800	1,130,440.00	0.20
87	600129	太极集团	19,000	1,130,310.00	0.20
88	605289	罗曼股份	29,500	1,130,145.00	0.20
89	002605	姚记科技	24,300	1,128,249.00	0.20
90	000690	宝新能源	160,400	1,126,008.00	0.20
91	688198	佰仁医疗	10,599	1,124,659.89	0.20
92	002965	祥鑫科技	20,100	1,119,168.00	0.20

93	300765	新诺威	86,600	1,116,274.00	0.20
94	605266	健之佳	13,300	1,114,939.00	0.20
95	688580	伟思医疗	15,419	1,114,793.70	0.20
96	600570	恒生电子	25,000	1,107,250.00	0.19
97	688599	天合光能	25,940	1,105,303.40	0.19
98	688290	景业智能	16,531	1,102,783.01	0.19
99	002332	仙琚制药	83,200	1,102,400.00	0.19
100	603129	春风动力	6,800	1,100,920.00	0.19
101	603662	柯力传感	29,900	1,100,320.00	0.19
102	688658	悦康药业	52,670	1,096,062.70	0.19
103	000988	华工科技	28,600	1,087,086.00	0.19
104	600079	人福医药	40,000	1,077,600.00	0.19
105	601333	广深铁路	271,900	1,076,724.00	0.19
106	603986	兆易创新	10,100	1,073,125.00	0.19
107	300002	神州泰岳	76,400	1,069,600.00	0.19
108	600369	西南证券	291,100	1,062,515.00	0.19
109	002558	巨人网络	59,000	1,057,870.00	0.19
110	301363	美好医疗	23,945	1,053,340.55	0.18
111	301168	通灵股份	16,900	1,052,870.00	0.18
112	603198	迎驾贡酒	16,500	1,052,700.00	0.18
113	300585	奥联电子	46,700	1,049,816.00	0.18
114	002912	中新赛克	23,800	1,047,438.00	0.18
115	300770	新媒股份	22,800	1,045,608.00	0.18
116	600267	海正药业	91,800	1,044,684.00	0.18
117	688662	富信科技	17,538	1,043,686.38	0.18
118	301060	兰卫医学	60,300	1,042,587.00	0.18
119	688428	诺诚健华	90,145	1,041,174.75	0.18
120	603888	新华网	31,600	1,037,112.00	0.18
121	688078	龙软科技	20,106	1,036,464.30	0.18
122	000065	北方国际	69,000	1,036,380.00	0.18
123	601318	中国平安	22,300	1,034,720.00	0.18
124	000736	中交地产	71,700	1,028,895.00	0.18
125	002444	巨星科技	47,000	1,028,360.00	0.18
126	688197	首药控股	21,570	1,028,026.20	0.18
127	688085	三友医疗	39,147	1,028,000.22	0.18
128	300404	博济医药	97,300	1,016,785.00	0.18
129	688410	山外山	19,349	1,015,822.50	0.18
130	688314	康拓医疗	27,060	1,013,126.40	0.18
131	600266	城建发展	199,400	1,012,952.00	0.18
132	002351	漫步者	48,700	1,007,116.00	0.18
133	300687	赛意信息	35,500	986,190.00	0.17

134	002065	东华软件	139,600	985,576.00	0.17
135	688981	中芯国际	19,508	985,544.16	0.17
136	300620	光库科技	15,900	974,352.00	0.17
137	605117	德业股份	6,480	969,084.00	0.17
138	002624	完美世界	56,600	955,974.00	0.17
139	603533	掌阅科技	34,400	953,568.00	0.17
140	600657	信达地产	224,000	947,520.00	0.17
141	688617	惠泰医疗	2,497	933,253.75	0.16
142	601601	中国太保	35,900	932,682.00	0.16
143	301101	明月镜片	22,650	929,329.50	0.16
144	300114	中航电测	18,900	928,935.00	0.16
145	300238	冠昊生物	60,000	925,800.00	0.16
146	003020	立方制药	24,800	917,848.00	0.16
147	300416	苏试试验	42,510	916,515.60	0.16
148	301267	华夏眼科	15,000	914,250.00	0.16
149	000516	国际医学	107,700	905,757.00	0.16
150	001322	箭牌家居	52,695	882,114.30	0.15
151	601021	春秋航空	15,200	873,544.00	0.15
152	688302	海创药业	16,407	871,539.84	0.15
153	000831	中国稀土	28,700	849,520.00	0.15
154	600111	北方稀土	35,200	844,096.00	0.15
155	600710	苏美达	95,000	813,200.00	0.14
156	02096	先声药业	113,000	807,950.00	0.14
157	688133	泰坦科技	9,458	805,727.02	0.14
158	000975	银泰黄金	64,300	752,310.00	0.13
159	002675	东诚药业	46,900	689,899.00	0.12
160	601928	凤凰传媒	47,800	544,920.00	0.10
161	02138	医思健康	138,000	529,920.00	0.09
162	06639	瑞尔集团	58,500	404,820.00	0.07
163	002422	科伦药业	13,500	400,680.00	0.07
164	603099	长白山	22,400	287,168.00	0.05
165	688249	晶合集成	3,110	56,166.60	0.01
166	688361	中科飞测-U	608	39,319.36	0.01
167	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
168	688469	中芯集成	6,334	34,266.94	0.01
169	301303	真兰仪表	1,074	23,980.32	0.00
170	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
171	301260	格力博	956	22,590.28	0.00
172	301246	宏源药业	674	20,708.62	0.00
173	688352	颀中科技	1,649	19,903.43	0.00
174	301322	绿通科技	363	19,518.18	0.00

175	301317	鑫磊股份	736	19,295.14	0.00
176	001287	中电港	893	18,993.94	0.00
177	688458	美芯晟	198	17,970.48	0.00
178	301387	光大同创	370	17,033.31	0.00
179	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
180	301399	英特科技	325	17,014.01	0.00
181	301332	德尔玛	1,211	16,676.87	0.00
182	301305	朗坤环境	823	16,283.27	0.00
183	688581	安杰思	131	15,461.93	0.00
184	301408	华人健康	884	14,985.85	0.00
185	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
186	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
187	301360	荣旗科技	140	13,034.08	0.00
188	301345	涛涛车业	254	11,887.22	0.00
189	301373	凌玮科技	364	11,640.38	0.00
190	301386	未来电器	476	11,460.26	0.00
191	301323	新莱福	277	11,093.33	0.00
192	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
193	301337	亚华电子	318	10,004.24	0.00
194	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
195	301357	北方长龙	200	9,714.90	0.00
196	301203	国泰环保	243	8,384.22	0.00
197	601065	江盐集团	692	8,339.56	0.00
198	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
199	600809	山西汾酒	40	7,402.80	0.00
200	001367	海森药业	149	6,455.92	0.00
201	301367	怡和嘉业	43	6,378.62	0.00
202	001380	华纬科技	194	6,014.76	0.00
203	603125	常青科技	196	4,949.00	0.00
204	001282	三联锻造	145	4,896.15	0.00
205	001269	欧晶科技	65	4,779.45	0.00
206	001360	南矿集团	262	4,108.44	0.00
207	301162	国能日新	48	3,786.24	0.00
208	001301	尚太科技	64	3,603.84	0.00
209	603051	鹿山新材	72	3,371.76	0.00
210	301378	通达海	50	3,228.50	0.00
211	001228	永泰运	83	3,189.69	0.00
212	301029	怡合达	66	2,948.88	0.00
213	301046	能辉科技	90	2,943.00	0.00
214	001337	四川黄金	95	2,934.55	0.00
215	301319	唯特偶	49	2,932.65	0.00

216	301219	腾远钴业	78	2,914.08	0.00
217	603281	江瀚新材	88	2,717.44	0.00
218	301313	凡拓数创	64	2,709.12	0.00
219	001324	长青科技	131	2,594.29	0.00
220	603173	福斯达	88	2,591.60	0.00
221	301206	三元生物	72	2,519.28	0.00
222	301181	标榜股份	83	2,497.47	0.00
223	001323	慕思股份	73	2,479.08	0.00
224	001308	康冠科技	87	2,389.02	0.00
225	301396	宏景科技	72	2,350.80	0.00
226	603235	天新药业	72	2,257.92	0.00
227	301201	诚达药业	53	2,183.60	0.00
228	301049	超越科技	96	2,121.60	0.00
229	001336	楚环科技	74	2,070.52	0.00
230	301072	中捷精工	81	2,029.05	0.00
231	603282	亚光股份	57	1,967.07	0.00
232	301309	万得凯	71	1,955.34	0.00
233	301361	众智科技	69	1,945.11	0.00
234	300226	上海钢联	60	1,944.00	0.00
235	301316	慧博云通	84	1,919.40	0.00
236	300995	奇德新材	91	1,856.40	0.00
237	301166	优宁维	41	1,760.54	0.00
238	603097	江苏华辰	77	1,744.82	0.00
239	001238	浙江正特	74	1,741.22	0.00
240	001278	一彬科技	73	1,735.94	0.00
241	03898	时代电气	64	1,722.88	0.00
242	001311	多利科技	29	1,665.47	0.00
243	301269	华大九天	13	1,596.92	0.00
244	301283	聚胶股份	44	1,561.12	0.00
245	603280	南方路机	63	1,548.54	0.00
246	001236	弘业期货	99	1,517.67	0.00
247	301016	雷尔伟	75	1,504.50	0.00
248	301365	矩阵股份	90	1,481.40	0.00
249	301068	大地海洋	44	1,478.84	0.00
250	301063	海锅股份	53	1,476.58	0.00
251	300834	星辉环材	58	1,415.20	0.00
252	603070	万控智造	75	1,401.75	0.00
253	301053	远信工业	55	1,395.35	0.00
254	301189	奥尼电子	45	1,376.55	0.00
255	301088	戎美股份	77	1,375.99	0.00
256	301158	德石股份	79	1,367.49	0.00

257	001256	炜冈科技	74	1,361.60	0.00
258	603215	比依股份	75	1,345.50	0.00
259	603150	万朗磁塑	50	1,318.00	0.00
260	001231	农心科技	55	1,308.45	0.00
261	001368	通达创智	51	1,296.42	0.00
262	301002	崧盛股份	61	1,259.04	0.00
263	001299	美能能源	76	1,239.56	0.00
264	603057	紫燕食品	49	1,231.37	0.00
265	603213	镇洋发展	99	1,181.07	0.00
266	301152	天力锂能	26	1,161.16	0.00
267	301115	建科股份	50	1,143.00	0.00
268	301227	森鹰窗业	40	1,109.20	0.00
269	603237	五芳斋	35	1,061.55	0.00
270	301027	华蓝集团	86	1,056.94	0.00
271	301017	漱玉平民	55	1,047.20	0.00
272	301200	大族数控	26	1,036.88	0.00
273	301123	奕东电子	39	996.06	0.00
274	301069	凯盛新材	39	992.16	0.00
275	603216	梦天家居	72	981.36	0.00
276	603191	望变电气	49	953.05	0.00
277	001338	永顺泰	49	903.56	0.00
278	301223	中荣股份	48	898.56	0.00
279	301280	珠城科技	25	894.00	0.00
280	603170	宝立食品	42	892.92	0.00
281	301073	君亭酒店	24	872.40	0.00
282	301150	中一科技	17	850.17	0.00
283	301040	中环海陆	41	842.55	0.00
284	301038	深水规院	46	832.14	0.00
285	300738	奥飞数据	80	816.00	0.00
286	001300	三柏硕	63	800.10	0.00
287	601089	福元医药	49	798.70	0.00
288	300614	百川畅银	29	794.31	0.00
289	301055	张小泉	55	782.65	0.00
290	001319	铭科精技	36	754.56	0.00
291	001234	泰慕士	33	752.40	0.00
292	603272	联翔股份	43	729.28	0.00
293	301349	信德新材	14	701.96	0.00
294	301356	天振股份	32	700.80	0.00
295	603182	嘉华股份	46	695.52	0.00
296	300814	中富电路	28	674.52	0.00
297	301276	嘉曼服饰	26	663.00	0.00

298	301056	森赫股份	72	659.52	0.00
299	001333	光华股份	26	653.38	0.00
300	301327	华宝新能	8	632.88	0.00
301	603073	彩蝶实业	30	625.80	0.00
302	301285	鸿日达	43	623.07	0.00
303	300996	普联软件	20	614.00	0.00
304	301092	争光股份	23	602.14	0.00
305	301048	金鹰重工	43	600.71	0.00
306	603162	海通发展	34	579.70	0.00
307	603151	邦基科技	35	571.90	0.00
308	001318	阳光乳业	42	568.26	0.00
309	603219	富佳股份	39	555.75	0.00
310	605089	味知香	14	550.20	0.00
311	603291	联合水务	36	547.56	0.00
312	301388	欣灵电气	20	537.00	0.00
313	301277	新天地	27	526.77	0.00
314	603230	内蒙新华	40	516.00	0.00
315	301041	金百泽	15	496.80	0.00
316	603132	金徽股份	42	476.28	0.00
317	600536	中国软件	10	468.80	0.00
318	301004	嘉益股份	12	465.60	0.00
319	603071	物产环能	27	447.93	0.00
320	300997	欢乐家	28	407.96	0.00
321	301091	深城交	22	407.44	0.00
322	601059	信达证券	28	399.28	0.00
323	600925	苏能股份	60	370.20	0.00
324	301028	东亚机械	33	367.95	0.00
325	301010	晶雪节能	18	365.22	0.00
326	03759	康龙化成	16	356.96	0.00
327	301033	迈普医学	8	351.68	0.00
328	001314	亿道信息	8	338.24	0.00
329	301057	汇隆新材	18	310.32	0.00
330	001313	粤海饲料	32	252.80	0.00
331	301062	上海艾录	23	243.57	0.00
332	301120	新特电气	16	243.52	0.00
333	301037	保立佳	13	231.66	0.00
334	301059	金三江	12	168.00	0.00
335	301098	金埔园林	11	132.55	0.00
336	301032	新柴股份	13	116.35	0.00
337	001298	好上好	4	99.00	0.00
338	301036	双乐股份	5	93.65	0.00

339	301196	唯科科技	2	67.90	0.00
340	001296	长江材料	3	63.03	0.00
341	300854	中兰环保	3	47.70	0.00
342	301007	德迈仕	3	46.29	0.00
343	301025	读客文化	3	36.66	0.00
344	300998	宁波方正	1	29.99	0.00
345	300059	东方财富	2	28.40	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	605186	健麾信息	69,874,879.62	13.85
2	600329	达仁堂	43,475,280.00	8.62
3	688621	阳光诺和	27,747,163.05	5.50
4	688358	祥生医疗	24,980,620.69	4.95
5	688266	泽璟制药	21,186,747.30	4.20
6	03759	康龙化成	18,215,296.24	3.61
7	688071	华依科技	15,911,635.60	3.15
8	300573	兴齐眼药	13,428,370.00	2.66
9	688389	普门科技	12,730,679.43	2.52
10	688351	微电生理	11,307,872.09	2.24
11	02273	固生堂	11,171,415.82	2.21
12	300406	九强生物	10,950,195.17	2.17
13	600941	中国移动	10,226,112.00	2.03
14	300396	迪瑞医疗	9,931,405.00	1.97
15	688212	澳华内镜	9,925,959.94	1.97
16	02279	雍禾医疗	9,658,870.46	1.92
17	300624	万兴科技	9,355,098.76	1.85
18	600572	康恩贝	9,155,434.00	1.82
19	688073	毕得医药	9,003,474.90	1.79
20	06606	诺辉健康	8,834,340.75	1.75

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	605186	健麾信息	98,970,764.60	19.62
2	600329	达仁堂	47,520,743.00	9.42
3	688389	普门科技	37,248,938.81	7.39

4	688621	阳光诺和	34,559,997.27	6.85
5	03759	康龙化成	17,421,793.40	3.45
5	300759	康龙化成	4,359,123.00	0.86
6	688266	泽璟制药	21,433,208.41	4.25
7	688358	祥生医疗	17,418,376.22	3.45
8	300573	兴齐眼药	16,869,238.00	3.34
9	688071	华依科技	14,527,935.11	2.88
10	688073	毕得医药	12,534,150.16	2.49
11	02273	固生堂	11,773,856.24	2.33
12	300396	迪瑞医疗	10,640,336.00	2.11
13	300406	九强生物	10,387,538.00	2.06
14	688351	微电生理	10,207,377.40	2.02
15	688329	艾隆科技	9,970,033.10	1.98
16	688212	澳华内镜	9,567,155.26	1.90
17	06606	诺辉健康	9,118,714.76	1.81
18	301239	普瑞眼科	8,803,235.21	1.75
19	300624	万兴科技	8,761,725.00	1.74
20	600557	康缘药业	8,727,220.00	1.73

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	1,196,697,564.01
卖出股票收入（成交）总额	1,189,378,547.70

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

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	95,936,857.19	16.80
2	央行票据	—	—
3	金融债券	11,719,378.60	2.05
	其中：政策性金融债	11,719,378.60	2.05
4	企业债券	10,400,892.06	1.82
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	39,490,899.01	6.91
8	同业存单	—	—

9	其他	—	—
10	合计	157,548,026.86	27.58

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	019679	22 国债 14	544,000	55,378,052.38	9.70
2	019678	22 国债 13	381,000	38,186,043.37	6.69
3	132018	G 三峡 EB1	83,330	11,821,273.71	2.07
4	018008	国开 1802	113,000	11,719,378.60	2.05
5	155616	19 恒健 02	100,000	10,400,892.06	1.82

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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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	211,642.95
2	应收清算款	14,147,319.87
3	应收股利	16,101.49
4	应收利息	—
5	应收申购款	423,765.97
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	14,798,830.28

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	132018	G 三峡 EB1	11,821,273.71	2.07
2	123107	温氏转债	6,941,692.43	1.22
3	113563	柳药转债	6,928,248.14	1.21
4	127036	三花转债	3,233,443.63	0.57
5	127005	长证转债	1,894,337.23	0.33
6	128074	游族转债	1,294,450.87	0.23
7	113582	火炬转债	1,202,795.84	0.21
8	128097	奥佳转债	1,173,962.98	0.21
9	128136	立讯转债	1,134,179.51	0.20
10	118021	新致转债	1,060,484.54	0.19
11	127069	小熊转债	1,023,980.21	0.18
12	123064	万孚转债	241,629.41	0.04

13	123109	昌红转债	234,015.89	0.04
14	113044	大秦转债	65,844.21	0.01
15	127068	顺博转债	51,264.30	0.01
16	113624	正川转债	38,613.00	0.01
17	123172	漱玉转债	127.07	0.00
18	123159	崧盛转债	118.50	0.00
19	123155	中陆转债	110.14	0.00

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
富国天源沪港深平衡混合 A/B	36,338	5,601.81	47,676,567.79	23.42	155,882,149.27	76.58
富国天源沪港深平衡混合 C	27	378,003.91	10,194,465.76	99.89	11,639.77	0.11
合计	36,365	5,878.31	57,871,033.55	27.07	155,893,789.04	72.93

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	富国天源沪港深平衡混合 A/B	322,855.39	0.1586
	富国天源沪港深平衡混合 C	3.71	0.0000
	合计	322,859.10	0.1510

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	富国天源沪港深平衡混合 A/B	0~10
	富国天源沪港深平衡混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	富国天源沪港深平衡混合 A/B	10~50
	富国天源沪港深平衡混合 C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	富国天源沪港深平衡 混合 A/B	富国天源沪港深平衡 混合 C
基金合同生效日(2002年08月16日) 基金份额总额	4,616,913,656.00	—
报告期期初基金份额总额	198,024,652.09	1,423,422.03
本报告期基金总申购份额	35,353,319.74	11,768,881.02
减：本报告期基金总赎回份额	29,819,254.77	2,986,197.52
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	203,558,717.06	10,206,105.53

§ 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 (%)	
安信证券	2	79,008,468.07	3.33	56,987.53	3.42	—
德邦证券	2	—	—	—	—	—
东北证券	2	49,870,068.80	2.10	35,970.84	2.16	—
东方证券	2	214,568,581.85	9.04	154,768.27	9.30	—

国海证券	2	59,333,880.76	2.50	42,797.80	2.57	—
国联证券	1	198,041,607.04	8.34	145,345.21	8.74	—
国泰君安	2	154,689,995.92	6.52	111,578.41	6.71	—
海通证券	1	207,576,599.59	8.74	149,724.78	9.00	—
华兴证券	1	—	—	—	—	—
汇丰前海	2	—	—	—	—	—
开源证券	4	598,819,597.80	25.22	431,928.88	25.96	—
申万宏源	4	386,787,003.53	16.29	227,881.62	13.70	—
兴业证券	2	113,189,598.82	4.77	81,643.97	4.91	—
浙商证券	1	—	—	—	—	—
中泰证券	1	97,084,857.19	4.09	70,028.62	4.21	—
中信建投	2	—	—	—	—	—
中信证券	2	215,242,723.45	9.07	155,255.20	9.33	—

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 (%)
安信证券	21,414,979.98	6.67	17,035,000.00	100.00	—	—
德邦证券	—	—	—	—	—	—
东北证券	9,295,242.34	2.89	—	—	—	—
东方证券	22,520,916.20	7.01	—	—	—	—
国海证券	5,807,648.39	1.81	—	—	—	—
国联证券	15,930,242.18	4.96	—	—	—	—
国泰君安	23,844,499.80	7.42	—	—	—	—
海通证券	28,309,718.96	8.81	—	—	—	—
华兴证券	—	—	—	—	—	—
汇丰前海	—	—	—	—	—	—
开源证券	120,814,810.95	37.62	—	—	—	—
申万宏源	37,093,653.41	11.55	—	—	—	—

兴业证券	2,456,822.75	0.76	—	—	—	—
浙商证券	—	—	—	—	—	—
中泰证券	7,655,777.64	2.38	—	—	—	—
中信建投	—	—	—	—	—	—
中信证券	26,022,093.09	8.10	—	—	—	—

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
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	2023 年 05 月 04 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。

§ 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天源沪港深平衡混合型证券投资基金的文件	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 。
2、富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金基金合同		
3、富国天源沪港深平衡混合型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、富国天源沪港深平衡混合型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		