# 富国中证旅游主题交易型开放式指数证券投资基金

# 二 0 二三年年度报告

2023 年 12 月 31 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：　2024 年 03 月 30 日

# §1 重要提示及目录

## 1.1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度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 2024 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况 ..... 8
3.1 主要会计数据和财务指标 ..... 8
3.2 基金净值表现 ..... 8
3.3 过去三年基金的利润分配情况 ..... 10
§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遵规守信情况的说明 ..... 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 ..... 15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核报告 ..... 15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 ..... 17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 ..... 17
4.9 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 ..... 17
§5 托管人报告 ..... 17
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 ..... 17
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 ..... 17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 ..... 18
§6 审计报告 ..... 18
6.1 审计报告基本信息 ..... 18
6.2 审计报告的基本内容 ..... 18
§7 年度财务报告 ..... 21
7.1 资产负债表 ..... 21

7.2 利润表.....22
7.3 净资产变动表.....23
7.4 报表附注.....25
§8 投资组合报告.....61
8.1 期末基金资产组合情况.....61
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....62
8.3 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.....63
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....66
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....68
8.6 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.....68
8.7 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.....68
8.8 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.....68
8.9 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.....68
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....68
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....68
8.12 投资组合报告附注.....68
§9 基金份额持有人信息.....70
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....70
9.2 期末上市基金前十名持有人.....70
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....71
9.4 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.....71
§10 开放式基金份额变动.....71
§11 重大事件揭示.....71
11.1 基金份额持有人大会决议.....71
11.2 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.....71
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....72
11.4 基金投资策略的改变.....72
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....72
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....72
11.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....72
11.8 其他重大事件.....75
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....76
12.1 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.....76
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....76

§13 备查文件目录 ..... 76

# §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金名称 | 富国中证旅游主题交易型开放式指数证券投资基金 |
| 场内简称 | 旅游 ETF |
| 基金简称 | 富国中证旅游主题 ETF |
| 基金主代码 | 159766 |
| 交易代码 | 159766 |
| 基金运作方式 | 契约型，交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2021 年 07 月 15 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 | 3,748,640,963.00 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 |
| 上市日期 | 2021 年 7 月 23 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 | 本基金主要采用完全复制法，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。当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股票长期停牌；（4）因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响；（5）由于交易成本、交易制度等原因导致基金无法及时完成投资组合的同步调整；（6）其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。<br>当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。本基金的资产配置策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、可转债（含分离交易可转债）及可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、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 | 本基金业绩比较基准为中证旅游主题指数收益率。 |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型基金，预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。 |

## 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 |
| 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 | 证券日报 |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.fullgoal.com.cn |
| 基金年度报告备置地点 | 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<br>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 |
|---|---|---|
| 会计师事务所 | 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙） | 北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 |
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京市西城区太平桥大街 17 号 |

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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 | 2023 年 | 2022 年 | 2021 年 7 月 15 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| 本期已实现收益 | -459,004,968.62 | 66,976,193.45 | -3,566,667.85 |
| 本期利润 | -1,422,658,857.03 | 226,417,169.98 | 9,790,213.18 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.4551 | 0.1234 | 0.0349 |
| 本期加权平均净值利润率 | -51.42% | 12.54% | 3.67% |
| 本期基金份额净值增长率 | -37.83% | 12.15% | 0.40% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2023 年 12 月 31 日 | 2022 年 12 月 31 日 | 2021 年 12 月 31 日 |
| 期末可供分配利润 | -1,124,715,345.00 | 69,101,425.14 | -5,540,283.77 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.3000 | 0.0401 | -0.0123 |
| 期末基金资产净值 | 2,623,925,618.00 | 1,940,823,176.81 | 453,940,770.91 |
| 期末基金份额净值 | 0.7000 | 1.1260 | 1.0040 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2023 年 12 月 31 日 | 2022 年 12 月 31 日 | 2021 年 12 月 31 日 |
| 基金份额累计净值增长率 | -30.00% | 12.60% | 0.40% |

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

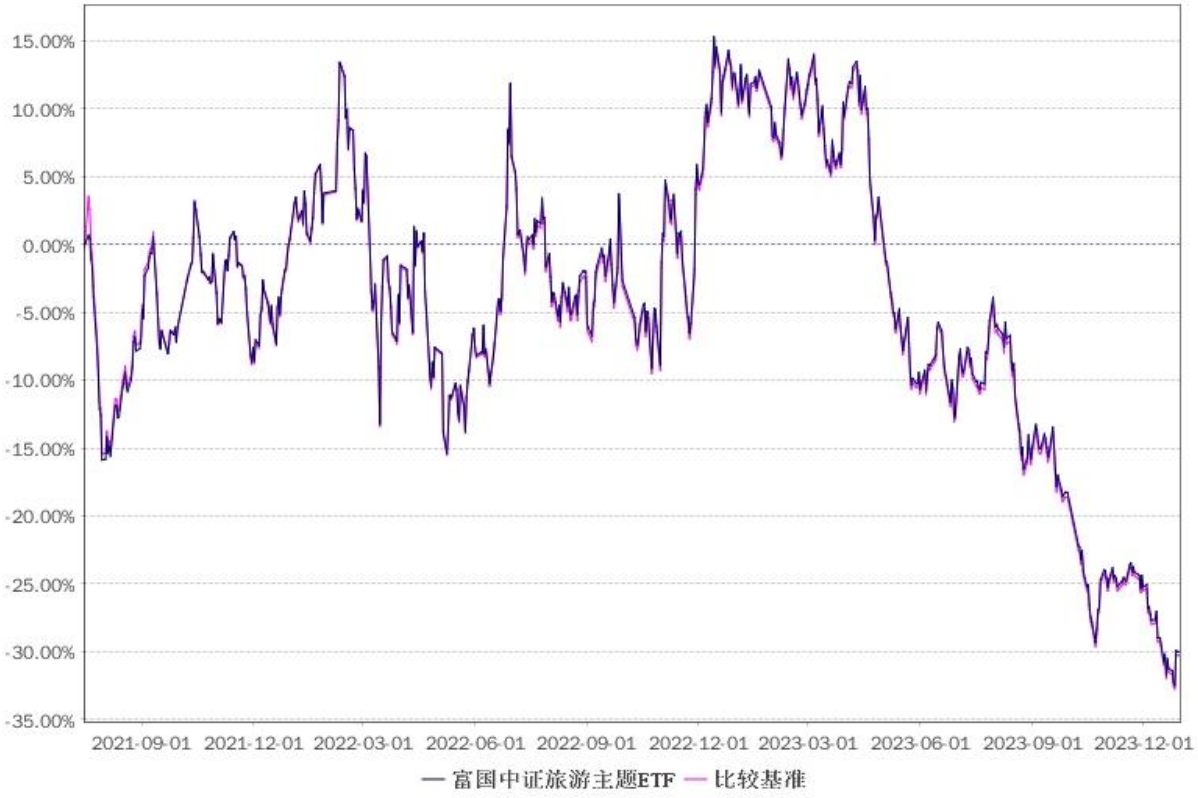
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -14.36% | 1.35% | -14.30% | 1.36% | -0.06% | -0.01% |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去六个月 | -19.99% | 1.35% | -20.03% | 1.35% | 0.04% | 0.00% |
| 过去一年 | -37.83% | 1.37% | -37.95% | 1.37% | 0.12% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | -30.00% | 1.81% | -30.27% | 1.83% | 0.27% | -0.02% |

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。

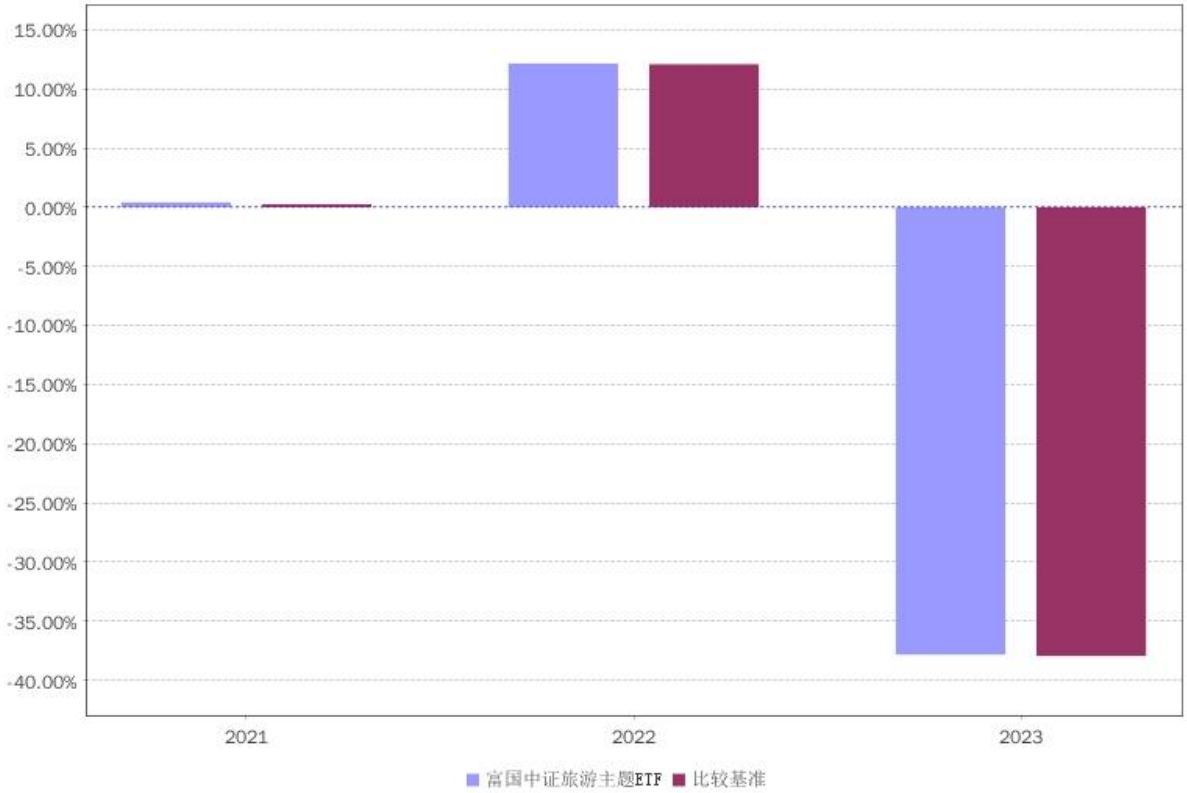
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较




注：1、截止日期为 2023 年 12 月 31 日。

2、本基金于 2021 年 7 月 15 日成立，建仓期 6 个月，从 2021 年 7 月 15 日起至 2022 年 1 月 14 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较




注：2021 年按实际存续期计算。

## 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金 2021 年 7 月 15 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日未进行利润分配

# §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 12 月 31 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 330 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 | | |
| 曹璐迪 | 本基金现任基金经理 | 2021-07-15 | — | 8 | 硕士，自 2016 年 7 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；现任富国基金量化投资部定量基金经理。自 2020 年 05 月起任富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2020 年 05 月起任富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；自 2020 年 08 月起任富国创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2021 年 03 月起任富国中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2021 年 06 月起任富国中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2021 年 07 月起任富国中证旅游主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2021 年 08 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | 月起任富国中证科创创业50交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；自2021年08月起任富国中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自2022年06月起任富国中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自2022年11月起任富国中证电池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2023年09月起任富国国证信息技术创新主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自2023年12月起任富国国证信息技术创新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2023年12月起任富国中证细分化工产业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2024年02月起任富国创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金(原富国创业板指数分级证券投资基金)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旅游主题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》、《富国中证旅游主题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 公平交易制度和控制方法

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。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期，在同向交易价差分析方面，公司采集连续四个季度，不同时间窗口（1 日内、3 日内、5 日内）的同向交易样本，在假设同向交易价差为零及 95% 的置信水平下，对同向交易价差进行 t 分布假设检验并对检验结果进行跟踪分

析。分析结果显示本投资组合与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

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。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 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。4 月以来，由于 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。2023 下半年以来，由于国内经济增长压力仍然较大，二季度 GDP 数据不及预期，人民币贬值压力再度加大，市场出现调整。7 月末，随着政治局会议超预期释放利好，美联储如期加息 25bps 但表态偏鸽，指数强势回升。进入 8 月，由于 7 月多项经济金融数据超预期回落，政治局会议后政策出台密度和力度不及预期，同时美债收益率大幅攀升、美联储连续放鹰等外部冲击持续，北向资金大幅流出。进入 4 季度，由于公布的 9 月地产数据超预期下行、物价延续走低等引发市场担忧，资金面出现赎回等负反馈，沪指下破 3000 点。另外，美十年期国债突破新高、巴以冲突等海外风险持续压制全球风险资产。随着中央汇金持续增持 ETF，叠加万亿国债增发出台，市场悲观情绪缓解，走出底部反弹态势，沪指重回 3000 点以上。11 月，海外利率快速下行带动市场走出谷底，但国内经济复苏依然偏缓，市场波折震荡。12 月，海外抢跑降息预期，但国内经济

复苏再次放缓叠加政策预期较低，市场创出年内新低。总体来看，2023 年上证综指下跌 3.7%，沪深 300 下跌 11.38%，创业板指下跌 19.41%，中证 500 指数下跌 7.42%。在投资管理上，我们坚持采取采用量化和人工管理相结合的方法进行投资和风险管理。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.7 元；份额累计净值为 0.7 元；本报告期，本基金份额净值增长率为-37.83%，同期业绩比较基准收益率为-37.95%。

## 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 2024 年，随着年初的快速调整，市场整体风险进一步释放，已具备较高的中长期配置价值。从政策层面看，呵护力度显著提升。其中，央行超预期降准，且下调支农支小再贷款、再贴现利率。房地产政策开始加码发力，“做好经营性物业贷款管理，满足房地产企业合理融资需求”，上海、苏州、广州等地购房政策进一步放开。从估值来看，1 月末市场估值处于历史底部，性价比凸显。沪深 300 指数股权风险溢价再次突破+2x 标准差，其估值分位数回落至近十年 13%分位附近，创业板指已处于历史估值最底部。从中长期来看，市场具备较高的配置价值。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核报告

本基金管理人始终坚持持有人利益优先原则，报告期内持续完善内控管理机制，全方位推动监察稽核工作深入开展。在基础性工作的基础上，2023 年度基金管理人重点开展的监察稽核工作包括以下方面：

（一）持续推进制度流程建设，保障业务合规开展

公司以建立重点业务内控制度体系，规范各业务部门内部管理为重点，持续强化公司内控管理与风险防范水平。报告期内，公司新增、修订多项内部管理制度，并以制度为基础相应完善业务流程。

（二）深入进行新规学习，扎实推动新规落地

2023 年度，公司从新规解读、制度建立、系统建设、流程改造等方面持续推进各项重要法律法规、监管要求的落地工作，并对落地情况开展专项检查，确保各项业务合法合规开展。

（三）培育合规文化，全面提升员工合规意识

为持续提高全员合规意识，公司对新员工、特定业务条线员工、全体员工开展不同侧重点的合规培训与宣导，结合多维度、多层次的合规谈话及合规考试，多管齐下全面提升员工的合规意识。

（四）立足于合规，不断拓展风险管理职能

报告期内，公司持续推进旗下组合的投资合规风控阈值多维度排查梳理和日常投资合规监督工作的规范化管理，进一步根据系统升级迭代情况整合优化历史风控工具。公司持续强化合规风控培训工作，提升各部门主动合规的能力和意识。公司不断加强对新业务、新品种及整体风险控制能力的研究，保持对各类风险的敏感度，加强日常监测和定期风险评估，持续提升对于各类投资标的的风险管理水平。

（五）持续推进合规风控工作的系统化建设

2023 年公司结合自主研发和专业系统外采等多种途径，持续推动合规风控信息化建设。公司通过搭建、完善覆盖事前、事中、事后的风控系统工具体系，助力有效监测、识别投资组合运作过程中的各类风险，加强投资过程中各类风险的管理能力。在合规管理方面，新增或优化系统管理功能模块包括合规考试、合规谈话、采购及合同一体化管理流程等。通过系统建设，提升合规管理工作质效。

（六）全面加强员工行为管理

报告期内，公司持续加强对从业人员的行为管控，内容包括监控录像、电子邮件、电话录音抽查，特定员工通讯工具集中管理，员工证券投资申报管理及廉洁从业管理等方面。通过日常合规管理与定期事后检查相结合的方式，提升全员合规意识，加强员工行为管理，确保各项业务合规开展。

（七）扎实推进反洗钱工作

公司高度重视反洗钱工作，认真贯彻落实各项反洗钱监管要求。除在客户尽职调查、大额和可疑交易报告、客户资料和交易记录保存等反洗钱核心义务方面积极履职外，还通过重点专项工作等方式有序推动反洗钱工作深入开展。报告期内，主要重点工作包括开展机构洗钱风险评估、持续推动系统建设和数据治理工作、强化客户身份识别前端管控、多层次立体化文化宣贯等。

（八）深入开展内部审计，发挥第三道防线功能

公司围绕各条线各部门制度框架体系建立情况、法规落实情况及当年工作重

点开展审计工作。通过基础风险点例行检查与法规落实情况、监管重点排查相结合的方式，深入开展内部审计检查并督导整改完善。报告期内，公司开展多项专项审计，涵盖投研、交易、销售、信息技术、反洗钱等各业务领域。

**4.7 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。

**4.8 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。

**4.9 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”）在富国中证旅游主题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 托管人对本年度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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

| | |
|---|---|
| 财务报表是否经过审计 | 是 |
| 审计意见类型 | 标准无保留意见 |
| 审计报告编号 | 安永华明（2024）审字第 70015656_B212 号 |

### 6.2 审计报告的基本内容

| | |
|---|---|
| 审计报告标题 | 审计报告 |
| 审计报告收件人 | 富国中证旅游主题交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人 |
| 审计意见 | 我们审计了富国中证旅游主题交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的富国中证旅游主题交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了富国中证旅游主题交易型开放式指数证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。 |
| 形成审计意见的基础 | 我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于富国中证旅游主题交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。 |
| 强调事项 | 无 |
| 其他事项 | 无 |

| | |
|---|---|
| 其他信息 | 富国中证旅游主题交易型开放式指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。<br>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。<br>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。 |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | 管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。<br>在编制财务报表时，管理层负责评估富国中证旅游主题交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。<br>治理层负责监督富国中证旅游主题交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。 |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | 我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。<br>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：<br>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的 |

| | | |
|---|---|---|
| | 财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。<br>(2)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。<br>(3)评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。<br>(4)对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对富国中证旅游主题交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致富国中证旅游主题交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。<br>(5)评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。<br>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。 | |
| 会计师事务所的名称 | 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙） | |
| 注册会计师的姓名 | 王珊珊 | 费泽旭 |
| 会计师事务所的地址 | 北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 | |
| 审计报告日期 | 2024 年 03 月 28 日 | |

## §7 年度财务报告

### 7.1 资产负债表

会计主体：富国中证旅游主题交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产 | 本期末<br>2023 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| **资 产：** | | |
| 货币资金 | 17,052,129.58 | 15,672,359.94 |
| 结算备付金 | 909,182.20 | 5,399,777.63 |
| 存出保证金 | 611,634.79 | 177,589.13 |
| 交易性金融资产 | 2,609,578,584.12 | 1,929,273,734.47 |
| 其中：股票投资 | 2,609,578,584.12 | 1,929,273,734.47 |
| 基金投资 | — | — |
| 债券投资 | — | — |
| 资产支持证券投资 | — | — |
| 贵金属投资 | — | — |
| 其他投资 | — | — |
| 衍生金融资产 | — | — |
| 买入返售金融资产 | — | — |
| 应收清算款 | 1,009,194.12 | 10,504,732.25 |
| 应收股利 | — | — |
| 应收申购款 | — | — |
| 递延所得税资产 | — | — |
| 其他资产 | 72,008.55 | 83,511.08 |
| 资产总计 | 2,629,232,733.36 | 1,961,111,704.50 |
| **负债和净资产** | **本期末**<br>2023 年 12 月 31 日 | **上年度末**<br>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 | 3,100,978.00 | 18,955,673.33 |
| 应付赎回款 | — | — |
| 应付管理人报酬 | 1,163,413.35 | 785,711.80 |

| | | |
|---|---|---|
| 应付托管费 | 232,682.66 | 157,142.35 |
| 应付销售服务费 | — | — |
| 应付投资顾问费 | — | — |
| 应交税费 | 7,628.89 | 9,387.43 |
| 应付利润 | — | — |
| 递延所得税负债 | — | — |
| 其他负债 | 802,412.46 | 380,612.78 |
| 负债合计 | 5,307,115.36 | 20,288,527.69 |
| **净资产：** | | |
| 实收基金 | 3,748,640,963.00 | 1,723,640,963.00 |
| 其他综合收益 | — | — |
| 未分配利润 | -1,124,715,345.00 | 217,182,213.81 |
| 净资产合计 | 2,623,925,618.00 | 1,940,823,176.81 |
| 负债和净资产总计 | 2,629,232,733.36 | 1,961,111,704.50 |

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.7000 元，基金份额总额 3,748,640,963.00 份。

**7.2 利润表**

会计主体：富国中证旅游主题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 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期（2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日） | 上年度可比期间（2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日 ） |
|---|---|---|
| **一、营业总收入** | -1,405,649,174.76 | 237,582,347.20 |
| 1.利息收入 | 3,493,637.31 | 2,272,678.83 |
| 其中：存款利息收入 | 152,276.87 | 156,768.01 |
| 债券利息收入 | — | — |
| 资产支持证券利息收入 | — | — |
| 买入返售金融资产收入 | — | — |
| 其他利息收入 | 3,341,360.44 | 2,115,910.82 |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | -451,214,086.30 | 44,741,414.44 |
| 其中：股票投资收益 | -456,976,818.62 | 39,938,146.66 |
| 基金投资收益 | — | — |
| 债券投资收益 | — | 224,422.77 |
| 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 | 5,762,732.32 | 4,578,845.01 |
| 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） | -963,653,888.41 | 159,440,976.53 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | — | — |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 5,725,162.64 | 31,127,277.40 |
| **减：二、营业总支出** | 17,009,682.27 | 11,165,177.22 |
| 1．管理人报酬 | 13,860,740.16 | 8,995,427.89 |
| 2．托管费 | 2,772,147.96 | 1,799,085.58 |
| 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 | 12,029.83 | 7,617.85 |
| 8．其他费用 | 364,764.32 | 363,045.90 |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** | -1,422,658,857.03 | 226,417,169.98 |
| 减：所得税费用 | — | — |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | -1,422,658,857.03 | 226,417,169.98 |
| **五、其他综合收益的税后净额** | — | — |
| **六、综合收益总额** | -1,422,658,857.03 | 226,417,169.98 |

**7.3 净资产变动表**

会计主体：富国中证旅游主题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 12 月 31 日

单位：人民币元

| **项目** | **本期（2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日）** | | |
|---|---|---|---|
| | **实收基金** | **未分配利润** | **净资产合计** |
| 一、上期期末净资产 | 1,723,640,963.00 | 217,182,213.81 | 1,940,823,176.81 |
| 二、本期期初净资产 | 1,723,640,963.00 | 217,182,213.81 | 1,940,823,176.81 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 2,025,000,000.00 | -1,341,897,558.81 | 683,102,441.19 |
| （一）、综合收益总额 | — | -1,422,658,857.03 | -1,422,658,857.03 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列） | 2,025,000,000.00 | 80,761,298.22 | 2,105,761,298.22 |
| 其中：1.基金申购款 | 5,993,500,000.00 | -251,044,311.29 | 5,742,455,688.71 |
| 2.基金赎回款 | -3,968,500,000.00 | 331,805,609.51 | -3,636,694,390.49 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | — | — | — |
| 四、本期期末净资产 | 3,748,640,963.00 | -1,124,715,345.00 | 2,623,925,618.00 |

| 项目 | 上年度可比期间（2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日） | | |
|---|---|---|---|
| | **实收基金** | **未分配利润** | **净资产合计** |
| 一、上期期末净资产 | 452,140,963.00 | 1,799,807.91 | 453,940,770.91 |
| 二、本期期初净资产 | 452,140,963.00 | 1,799,807.91 | 453,940,770.91 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 1,271,500,000.00 | 215,382,405.90 | 1,486,882,405.90 |
| （一）、综合收益总额 | — | 226,417,169.98 | 226,417,169.98 |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列） | 1,271,500,000.00 | -11,034,764.08 | 1,260,465,235.92 |
| 其中：1.基金申购款 | 7,799,500,000.00 | -49,224,637.94 | 7,750,275,362.06 |
| 2.基金赎回款 | -6,528,000,000.00 | -38,189,873.86 | -6,489,810,126.14 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | — | — | — |
| 四、本期期末净资产 | 1,723,640,963.00 | 217,182,213.81 | 1,940,823,176.81 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

| 陈 戈 | 林志松 | 徐慧 |
| --- | --- | --- |
| ———————— | ———————— | ———————— |
| 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 |

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

富国中证旅游主题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[2021]1727号《关于准予富国中证旅游主题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7月15日正式生效，首次设立募集规模为291,640,963.00份基金份额。本基金为契约型，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、创业板及其他经中国证监会允许发行的股票、存托凭证）、债券（国债、央行票据、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、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、衍生工具（股指期货、股票期权等）、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）。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）的比例不得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。本基金每个交易日日终在扣除股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规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。

本基金业绩比较基准为中证旅游主题指数收益率。

### 7.4.2 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 2 号《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。

### 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1)金融资产分类

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

以摊余成本计量的金融资产；

(2)金融负债分类

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

**7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认**

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

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

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

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

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

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

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

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

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

**7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则**

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二

层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2)不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4)如有新增事项，按国家最新规定估值。

**7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此

以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

**7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

**7.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。 未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

**7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量**

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

(2)交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

(5)买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

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

(7)转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入。出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入计入投资收益；

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

**7.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。 以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

**7.4.4.11 基金的收益分配政策**

1、每一基金份额享有同等分配权；

2、基金每年收益分配次数没有限制，每次基金收益分配数额的确定原则为使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日（即收益评价日）的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值；

3、若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

4、本基金收益分配采用现金方式；

5、法律法规、监管机关、登记机构、深圳证券交易所另有规定的，从其规定。

在遵守法律法规和监管部门的规定，且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人在与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大

会，并应于变更实施日前在规定媒介公告。

**7.4.4.12 分部报告**

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；

(2)能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；

(3)能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

**7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

**7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

**7.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期无会计政策变更。

**7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期无会计估计变更。

**7.4.5.3 差错更正的说明**

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

**7.4.6 税项**

1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

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。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>（2023 年 12 月 31 日） | 上年度末<br>（2022 年 12 月 31 日） |
|---|---|---|
| 活期存款 | 17,052,129.58 | 15,672,359.94 |
| 等于：本金 | 17,050,244.72 | 15,670,450.54 |
| 加：应计利息 | 1,884.86 | 1,909.40 |
| 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 | 17,052,129.58 | 15,672,359.94 |

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有定期存款。

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末（2023 年 12 月 31 日） | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 3,400,434,614.97 | — | 2,609,578,584.12 | -790,856,030.85 |
| 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 | 3,400,434,614.97 | — | 2,609,578,584.12 | -790,856,030.85 |
| 项目 | 上年度末（2022 年 12 月 31 日） | | | |
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 1,756,475,876.91 | — | 1,929,273,734.47 | 172,797,857.56 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | — | — | — | — |
| 债券 交易所市场 | — | — | — | — |
| 债券 银行间市场 | — | — | — | — |
| 债券 合计 | — | — | — | — |
| 资产支持证券 | — | — | — | — |
| 基金 | — | — | — | — |
| 其他 | — | — | — | — |
| 合计 | 1,756,475,876.91 | — | 1,929,273,734.47 | 172,797,857.56 |

**7.4.7.3 衍生金融资产/负债**

**7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额**

注：本报告期末及上年度末本基金未持有衍生金融资产/负债。

**7.4.7.4 买入返售金融资产**

**7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

**7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购中取得的债券。

**7.4.7.5 其他资产**

单位：人民币元

| 项目 | 本期末（2023 年 12 月 31 日） | 上年度末（2022 年 12 月 31 日） |
|---|---|---|
| 应收利息 | — | — |
| 其他应收款 | — | — |
| 待摊费用 | — | — |
| 转融通证券出借利息 | 72,008.55 | 83,511.08 |
| 合计 | 72,008.55 | 83,511.08 |

### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末（2023 年 12 月 31 日） | 上年度末（2022 年 12 月 31 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 | 607,412.46 | 187,612.78 |
| 其中：交易所市场 | 607,412.46 | 187,612.78 |
| 银行间市场 | — | — |
| 应付利息 | — | — |
| 预提信息披露费 | 120,000.00 | 120,000.00 |
| 预提审计费 | 55,000.00 | 53,000.00 |
| IOPV 计算发布费 | 20,000.00 | 20,000.00 |
| 合计 | 802,412.46 | 380,612.78 |

### 7.4.7.7 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 12 月 31 日） | |
|---|---|---|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 1,723,640,963.00 | 1,723,640,963.00 |
| 本期申购 | 5,993,500,000.00 | 5,993,500,000.00 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -3,968,500,000.00 | -3,968,500,000.00 |
| 本期末 | 3,748,640,963.00 | 3,748,640,963.00 |

### 7.4.7.8 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 |
|---|---|---|---|
| 上年度末 | 69,101,425.14 | 148,080,788.67 | 217,182,213.81 |
| 本期期初 | 69,101,425.14 | 148,080,788.67 | 217,182,213.81 |
| 本期利润 | -459,004,968.62 | -963,653,888.41 | -1,422,658,857.03 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 141,698,076.10 | -60,936,777.88 | 80,761,298.22 |
| 其中：基金申购款 | 252,153,987.58 | -503,198,298.87 | -251,044,311.29 |
| 基金赎回款 | -110,455,911.48 | 442,261,520.99 | 331,805,609.51 |
| 本期已分配利润 | — | — | — |
| 本期末 | -248,205,467.38 | -876,509,877.62 | -1,124,715,345.00 |

### 7.4.7.9 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 12 月 31 日） | 上年度可比期间（2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日） |
|---|---|---|
| 活期存款利息收入 | 58,165.82 | 84,738.01 |
| 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 | 84,550.94 | 64,444.31 |
| 其他 | 9,560.11 | 7,585.69 |
| 合计 | 152,276.87 | 156,768.01 |

**7.4.7.10 股票投资收益**

**7.4.7.10.1 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 12 月 31 日） | 上年度可比期间（2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日） |
|---|---|---|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -403,796,419.49 | 33,045,719.24 |
| 股票投资收益——赎回差价收入 | -53,180,399.13 | 6,892,427.42 |
| 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 | -456,976,818.62 | 39,938,146.66 |

**7.4.7.10.2 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 12 月 31 日） | 上年度可比期间（2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日） |
|---|---|---|
| 卖出股票成交总额 | 3,348,616,234.19 | 4,899,803,128.18 |
| 减：卖出股票成本总额 | 3,747,955,685.99 | 4,860,280,212.37 |
| 减：交易费用 | 4,456,967.69 | 6,477,196.57 |
| 买卖股票差价收入 | -403,796,419.49 | 33,045,719.24 |

**7.4.7.10.3 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 12 月 31 日） | 上年度可比期间（2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日） |
|---|---|---|
| 赎回基金份额对价总额 | 3,636,694,390.49 | 6,489,810,126.14 |
| 减：现金支付赎回款总额 | 2,642,648,485.49 | 4,724,512,967.14 |

| | | |
|---|---|---|
| 减：赎回股票成本总额 | 1,047,226,304.13 | 1,758,404,731.58 |
| 减：交易费用 | — | — |
| 赎回差价收入 | -53,180,399.13 | 6,892,427.42 |

**7.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无股票投资收益——申购差价收入。

**7.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无股票投资收益——证券出借差价收入。

**7.4.7.11 债券投资收益**

**7.4.7.11.1 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 12 月 31 日） | 上年度可比期间（2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日） |
|---|---|---|
| 债券投资收益——利息收入 | — | 35.69 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | — | 224,387.08 |
| 合计 | — | 224,422.77 |

注：本基金本报告期无债券投资收益。

**7.4.7.11.2 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12月31日） | 上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日） |
|---|---|---|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | — | 2,088,425.92 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | — | 1,864,000.00 |
| 减：应计利息总额 | — | 36.77 |
| 减：交易费用 | — | 2.07 |
| 买卖债券差价收入 | — | 224,387.08 |

注：本基金本报告期无买卖债券差价收入。

**7.4.7.12 资产支持证券投资收益**

**7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

**7.4.7.13 贵金属投资收益**

注:本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖贵金属交易。

**7.4.7.14 衍生工具收益**

**7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注:本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

**7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注:本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益。

**7.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

| 项目 | 本期（2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日） | 上年度可比期间（2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日） |
|---|---|---|
| 股票投资产生的股利收益 | 5,762,732.32 | 4,578,845.01 |
| 其中:证券出借权益补偿收入 | 242,790.00 | 115,514.70 |
| 基金投资产生的股利收益 | — | — |
| 合计 | 5,762,732.32 | 4,578,845.01 |

**7.4.7.16 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 12 月 31 日） | 上年度可比期间（2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日） |
|---|---|---|
| 1.交易性金融资产 | -963,653,888.41 | 159,440,976.53 |
| 股票投资 | -963,653,888.41 | 159,440,976.53 |

| | | |
|---|---|---|
| 债券投资 | — | — |
| 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 | -963,653,888.41 | 159,440,976.53 |

**7.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

| 项目 | 本期（2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日） | 上年度可比期间（2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日） |
|---|---|---|
| 基金赎回费收入 | — | — |
| 替代损益 | 5,725,162.64 | 31,127,277.40 |
| 合计 | 5,725,162.64 | 31,127,277.40 |

**7.4.7.18 信用减值损失**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

**7.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

| 项目 | 本期（2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日） | 上年度可比期间（2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日） |
|---|---|---|
| 审计费用 | 55,000.00 | 53,000.00 |
| 信息披露费 | 120,000.00 | 120,000.00 |
| 证券出借违约金 | — | — |
| 银行费用 | 19,764.32 | 20,045.90 |
| 其他 | 170,000.00 | 170,000.00 |
| 合计 | 364,764.32 | 363,045.90 |

**7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**

**7.4.8.1 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。

**7.4.8.2 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。

**7.4.9 关联方关系**

| 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 |
| 山东省金融资产管理股份有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 蒙特利尔银行 | 基金管理人的股东 |
| 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。

**7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**

**7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

**7.4.10.1.1 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 12 月 31 日） | | 上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31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 | 8,429,226.11 | 0.10 | 49,517,017.65 | 0.46 |
| 申万宏源 | 5,014,930.82 | 0.06 | 44,766,369.33 | 0.42 |

**7.4.10.1.2 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。

**7.4.10.1.3 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。

**7.4.10.1.4 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。

**7.4.10.1.5 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12月31日） |
|---|---|

| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例（%） | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例（%） |
|---|---|---|---|---|
| 海通证券 | 6,137.54 | 0.54 | 2,052.53 | 0.34 |
| 申万宏源 | 3,632.02 | 0.32 | 304.69 | 0.05 |
| 关联方名称 | 上年度可比期间（2022年01月01日至2022年12月31日） | | | |
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例（%） | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例（%） |
| 海通证券 | 45,564.37 | 7.71 | 161.35 | 0.09 |
| 申万宏源 | 40,379.42 | 6.84 | 6,916.04 | 3.69 |

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。

7.4.10.2 关联方报酬

**7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目 | 本期（2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日） | 上年度可比期间（2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日） |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 13,860,740.16 | 8,995,427.89 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 319,999.64 | — |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 13,540,740.52 | 8,995,427.89 |

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

H＝E×0.50%÷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，逐日累计至每个月月末，按月支付。

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目 | 本期（2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 | 上年度可比期间（2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 |
|---|---|---|

| | 日） | 31 日） |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,772,147.96 | 1,799,085.58 |

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

H＝E×0.10%÷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，逐日累计至每个月月末，按月支付。

**7.4.10.3 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。

**7.4.10.4 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**

**7.4.10.4.1 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 12 月 31 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 | 11,346,345.00 | 8,253.79 | — | — |
| 申万宏源 | 5,698,920.00 | 3,784.43 | — | — |
| 上年度可比期间（2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 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 | 25,307,184.00 | 16,075.55 | 1,557,121.00 | 471.34 |
| 申万宏源 | 26,867,487.00 | 17,245.24 | — | — |

**7.4.10.4.2 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 12 月 31 日） |
|---|

| 关联方名称 | 交易金额 | 费率区间（%） | 加权平均费率（%） | 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 | 66,396,776.00 | 1.00～5.50 | 3.30 | 82,489.25 | 3,575,548.00 | 2,021.38 |
| 申万宏源 | 6,509,436.00 | 3.78～5.67 | 4.49 | 12,474.57 | — | — |
| 上年度可比期间（2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日） | | | | | | |
| 关联方名称 | 交易金额 | 费率区间（%） | 加权平均费率（%） | 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 | 9,754,892.00 | 3.20 | 3.20 | 12,310.16 | — | — |
| 申万宏源 | 3,435,093.00 | 3.20～3.80 | 3.33 | 4,422.99 | — | — |

**7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**

**7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

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固有资金投资本基金。

**7.4.10.5.2 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 12 月 31 日） | | 上期末（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(%) |
| 海通证券股份有限公司 | 3,163,114.00 | 0.08 | 10,911,090.00 | 0.63 |
| 申万宏源证券有限公司 | 1,464,927.00 | 0.04 | 3,925,255.00 | 0.23 |

### 7.4.10.6 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 12 月 31 日） | | 上年度可比期间（2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 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 | 17,052,129.58 | 58,165.82 | 15,672,359.94 | 84,738.01 |

### 7.4.10.7 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 12 月 31 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 | 301525 | 儒竞科技 | IPO 网下申购 | 2,660 | 264,856.20 |
| 海通证券股份有限公司 | 301568 | 思泰克 | IPO 网下申购 | 2,456 | 57,052.88 |
| 申万宏源证券承销保荐有限责任公司 | 603193 | 润本股份 | IPO 网下申购 | 3,022 | 52,522.36 |
| 海通证券股份有限公司 | 688507 | 索辰科技 | IPO 网下申购 | 1,495 | 367,112.20 |
| 海通证券股份有限公司 | 688515 | 裕太微 | IPO 网下申购 | 4,183 | 386,760.18 |
| 海通证券股份有限公司 | 688531 | 日联科技 | IPO 网下申购 | 3,460 | 527,234.80 |
| 海通证券股份有限公司 | 688548 | 广钢气体 | IPO 网下申购 | 40,476 | 399,498.12 |
| 海通证券股份有限公司 | 688716 | 中研股份 | IPO 网下申购 | 2,668 | 79,132.88 |

金额单位：人民币元

| 上年度可比期间（2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 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 | 688271 | 联影医疗 | IPO 网下申购 | 7,365 | 813,312.53 |
| 海通证券股份有限公司 | 688220 | 翱捷科技 | IPO 网下申购 | 1,713 | 283,266.31 |
| 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 | 3,390 | 142,751.21 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 海通证券股份有限公司 | 688062 | 迈威生物 | IPO 网下申购 | 7,545 | 263,878.83 |

**7.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

**7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明**

本基金无其他关联交易事项。

**7.4.11 利润分配情况**

注：本基金本报告期末进行利润分配。

**7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券**

**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

**7.4.12.1.1 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 001239 | 永达股份 | 2023-12-04 | 6 个月 | 新股限售 | 12.05 | 19.92 | 189 | 2,277.45 | 3,764.88 | — |
| 001306 | 夏厦精密 | 2023-11-09 | 6 个月 | 新股限售 | 53.63 | 75.36 | 64 | 3,432.32 | 4,823.04 | — |
| 001326 | 联域股份 | 2023-11-01 | 6 个月 | 新股限售 | 41.18 | 48.64 | 99 | 4,076.82 | 4,815.36 | — |
| 001358 | 兴欣新材 | 2023-12-14 | 6 个月 | 新股限售 | 41.00 | 44.16 | 87 | 3,567.00 | 3,841.92 | — |
| 001378 | 德冠新材 | 2023-10-23 | 6 个月 | 新股限售 | 31.68 | 31.27 | 205 | 6,494.40 | 6,410.35 | — |
| 300904 | 威力传动 | 2023-08-02 | 6 个月 | 新股限售 | 35.41 | 61.53 | 304 | 10,764.64 | 18,705.12 | — |
| 301202 | 朗威股份 | 2023-06-28 | 6 个月 | 新股限售 | 25.82 | 31.80 | 306 | 7,900.92 | 9,730.80 | — |
| 301251 | 威尔高 | 2023-08-30 | 6 个月 | 新股限售 | 28.88 | 34.59 | 321 | 9,270.48 | 11,103.39 | — |
| 301261 | 恒工精密 | 2023-06-29 | 6 个月 | 新股限售 | 36.90 | 50.85 | 198 | 7,306.20 | 10,068.30 | — |
| 301272 | 英华特 | 2023-07-06 | 6 个月 | 新股限售 | 51.39 | 53.38 | 173 | 8,890.47 | 9,234.74 | — |
| 301329 | 信音电子 | 2023-07-05 | 6 个月 | 新股限售 | 21.00 | 22.23 | 458 | 9,618.00 | 10,181.34 | — |
| 301348 | 蓝箭电子 | 2023-08-01 | 6 个月 | 新股限售 | 18.08 | 44.57 | 613 | 11,083.04 | 27,321.41 | — |
| 301362 | 民爆光电 | 2023-07-27 | 6 个月 | 新股限售 | 51.05 | 38.52 | 420 | 21,441.00 | 16,178.40 | — |
| 301393 | 昊帆生物 | 2023-07-05 | 6 个月 | 新股限售 | 67.68 | 59.37 | 260 | 17,596.80 | 15,436.20 | — |
| 301395 | 仁信新材 | 2023-06-21 | 6 个月 | 新股限售 | 26.68 | 18.69 | 520 | 13,873.60 | 9,718.80 | — |
| 301413 | 安培龙 | 2023-12-11 | 6 个月 | 新股限售 | 33.25 | 58.19 | 164 | 5,453.00 | 9,543.16 | — |
| 301418 | 协昌科技 | 2023-08-10 | 6 个月 | 新股限售 | 51.88 | 50.20 | 189 | 9,805.32 | 9,487.80 | — |
| 301421 | 波长光电 | 2023-08-16 | 6 个月 | 新股限售 | 29.38 | 59.37 | 332 | 9,754.16 | 19,710.84 | — |
| 301456 | 盘古智能 | 2023-07-06 | 6 个月 | 新股限售 | 37.96 | 30.39 | 407 | 15,449.72 | 12,368.73 | — |
| 301468 | 博盈特焊 | 2023-07-12 | 6 个月 | 新股限售 | 47.58 | 30.22 | 598 | 28,452.84 | 18,071.56 | — |
| 301469 | 恒达新材 | 2023-08-10 | 6 个月 | 新股限售 | 36.58 | 33.09 | 275 | 10,059.50 | 9,099.75 | — |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 301486 | 致尚科技 | 2023-06-30 | 6 个月 | 新股限售 | 57.66 | 47.25 | 482 | 27,792.12 | 22,774.50 | — |
| 301488 | 豪恩汽电 | 2023-06-26 | 6 个月 | 新股限售 | 39.78 | 69.09 | 262 | 10,422.36 | 18,101.58 | — |
| 301498 | 乖宝宠物 | 2023-08-09 | 6 个月 | 新股限售 | 39.99 | 38.81 | 554 | 22,154.46 | 21,500.74 | — |
| 301500 | 飞南资源 | 2023-09-13 | 6 个月 | 新股限售 | 23.97 | 20.89 | 455 | 10,906.35 | 9,504.95 | — |
| 301505 | 苏州规划 | 2023-07-12 | 6 个月 | 新股限售 | 26.35 | 35.81 | 194 | 5,111.90 | 6,947.14 | — |
| 301508 | 中机认检 | 2023-11-23 | 6 个月 | 新股限售 | 16.82 | 26.68 | 419 | 7,047.58 | 11,178.92 | — |
| 301510 | 固高科技 | 2023-08-04 | 6 个月 | 新股限售 | 12.00 | 35.01 | 396 | 4,752.00 | 13,863.96 | — |
| 301511 | 德福科技 | 2023-08-08 | 6 个月 | 新股限售 | 28.00 | 22.67 | 982 | 27,496.00 | 22,261.94 | — |
| 301515 | 港通医疗 | 2023-07-13 | 6 个月 | 新股限售 | 31.16 | 28.27 | 230 | 7,166.80 | 6,502.10 | — |
| 301516 | 中远通 | 2023-12-01 | 6 个月 | 新股限售 | 6.87 | 15.51 | 604 | 4,149.48 | 9,368.04 | — |
| 301517 | 陕西华达 | 2023-10-09 | 6 个月 | 新股限售 | 26.87 | 43.69 | 185 | 4,970.95 | 8,082.65 | — |
| 301518 | 长华化学 | 2023-07-26 | 6 个月 | 新股限售 | 25.75 | 23.01 | 385 | 9,913.75 | 8,858.85 | — |
| 301520 | 万邦医药 | 2023-09-18 | 6 个月 | 新股限售 | 67.88 | 52.74 | 160 | 10,860.80 | 8,438.40 | — |
| 301525 | 儒竞科技 | 2023-08-23 | 6 个月 | 新股限售 | 99.57 | 81.46 | 266 | 26,485.62 | 21,668.36 | — |
| 301528 | 多浦乐 | 2023-08-17 | 6 个月 | 新股限售 | 71.80 | 68.91 | 148 | 10,626.40 | 10,198.68 | — |
| 301533 | 威马农机 | 2023-08-07 | 6 个月 | 新股限售 | 29.50 | 33.16 | 225 | 6,637.50 | 7,461.00 | — |
| 301550 | 斯菱股份 | 2023-09-06 | 6 个月 | 新股限售 | 37.56 | 43.57 | 260 | 9,765.60 | 11,328.20 | — |
| 301555 | 惠柏新材 | 2023-10-24 | 6 个月 | 新股限售 | 22.88 | 32.44 | 224 | 5,125.12 | 7,266.56 | — |
| 301566 | 达利凯普 | 2023-12-22 | 6 个月 | 新股限售 | 8.90 | 22.14 | 576 | 5,126.40 | 12,752.64 | — |
| 301568 | 思泰克 | 2023-11-21 | 6 个月 | 新股限售 | 23.23 | 35.58 | 246 | 5,714.58 | 8,752.68 | — |
| 301578 | 辰奕智能 | 2023-12-21 | 6 个月 | 新股限售 | 48.94 | 68.32 | 118 | 5,774.92 | 8,061.76 | — |
| 601083 | 锦江航运 | 2023-11-28 | 6 个月 | 新股限售 | 11.25 | 11.07 | 1,263 | 14,208.75 | 13,981.41 | — |
| 603004 | 鼎龙科技 | 2023-12-20 | 6 个月 | 新股限售 | 16.80 | 31.19 | 195 | 3,276.00 | 6,082.05 | — |
| 603062 | 麦加芯彩 | 2023-10-31 | 6 个月 | 新股限售 | 58.08 | 57.81 | 126 | 7,318.08 | 7,284.06 | — |
| 603107 | 上海汽配 | 2023-10-25 | 6 个月 | 新股限售 | 14.23 | 18.19 | 292 | 4,155.16 | 5,311.48 | — |
| 603193 | 润本股份 | 2023-10-09 | 6 个月 | 新股限售 | 17.38 | 16.66 | 303 | 5,266.14 | 5,047.98 | — |
| 603231 | 索宝蛋白 | 2023-12-06 | 6 个月 | 新股限售 | 21.29 | 21.53 | 161 | 3,427.69 | 3,466.33 | — |
| 603275 | 众辰科技 | 2023-08-16 | 6 个月 | 新股限售 | 49.97 | 39.70 | 193 | 9,644.21 | 7,662.10 | — |
| 603276 | 恒兴新材 | 2023-09-18 | 6 个月 | 新股限售 | 25.73 | 24.88 | 134 | 3,447.82 | 3,333.92 | — |
| 603296 | 华勤技术 | 2023-08-01 | 6 个月 | 新股限售 | 80.80 | 77.75 | 593 | 47,914.40 | 46,105.75 | — |
| 603373 | 安邦护卫 | 2023-12-13 | 6 个月 | 新股限售 | 19.10 | 34.75 | 88 | 1,680.80 | 3,058.00 | — |
| 688548 | 广钢气体 | 2023-08-08 | 6 个月 | 新股限售 | 9.87 | 12.75 | 4,048 | 39,953.76 | 51,612.00 | — |
| 688563 | 航材股份 | 2023-07-12 | 6 个月 | 新股限售 | 78.99 | 60.49 | 1,501 | 118,563.99 | 90,795.49 | — |
| 688591 | 泰凌微 | 2023-08-18 | 6 个月 | 新股限售 | 24.98 | 28.02 | 681 | 17,011.38 | 19,081.62 | — |
| 688592 | 司南导航 | 2023-08-07 | 6 个月 | 新股限售 | 50.50 | 50.53 | 216 | 10,908.00 | 10,914.48 | — |
| 688602 | 康鹏科技 | 2023-07-13 | 6 个月 | 新股限售 | 8.66 | 11.06 | 1,066 | 9,231.56 | 11,789.96 | — |
| 688603 | 天承科技 | 2023-06-30 | 6 个月 | 新股限售 | 55.00 | 74.14 | 140 | 7,700.00 | 10,379.60 | — |
| 688610 | 埃科光电 | 2023-07-10 | 6 个月 | 新股限售 | 73.33 | 51.00 | 275 | 20,165.75 | 14,025.00 | — |
| 688612 | 威迈斯 | 2023-07-19 | 6 个月 | 新股限售 | 47.29 | 37.97 | 422 | 19,956.38 | 16,023.34 | — |
| 688627 | 精智达 | 2023-07-11 | 6 个月 | 新股限售 | 46.77 | 87.72 | 222 | 10,382.94 | 19,473.84 | — |
| 688638 | 誉辰智能 | 2023-07-04 | 6 个月 | 新股限售 | 83.90 | 59.68 | 141 | 11,829.90 | 8,414.88 | — |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 688646 | 逸飞激光 | 2023-07-21 | 6 个月 | 新股限售 | 46.80 | 36.07 | 219 | 10,249.20 | 7,899.33 | — |
| 688648 | 中邮科技 | 2023-11-06 | 6 个月 | 新股限售 | 15.18 | 21.43 | 303 | 4,599.54 | 6,493.29 | — |
| 688651 | 盛邦安全 | 2023-07-19 | 6 个月 | 新股限售 | 39.90 | 46.05 | 178 | 7,102.20 | 8,196.90 | — |
| 688652 | 京仪装备 | 2023-11-22 | 6 个月 | 新股限售 | 31.95 | 52.25 | 416 | 13,291.20 | 21,736.00 | — |
| 688653 | 康希通信 | 2023-11-10 | 6 个月 | 新股限售 | 10.50 | 15.99 | 648 | 6,804.00 | 10,361.52 | — |
| 688657 | 浩辰软件 | 2023-09-25 | 6 个月 | 新股限售 | 103.40 | 78.23 | 101 | 10,443.40 | 7,901.23 | — |
| 688671 | 碧兴物联 | 2023-08-02 | 6 个月 | 新股限售 | 36.12 | 34.30 | 226 | 8,163.12 | 7,751.80 | — |
| 688702 | 盛科通信 | 2023-09-06 | 6 个月 | 新股限售 | 42.66 | 48.18 | 549 | 23,420.34 | 26,450.82 | — |
| 688716 | 中研股份 | 2023-09-13 | 6 个月 | 新股限售 | 29.66 | 36.39 | 267 | 7,919.22 | 9,716.13 | — |
| 688719 | 爱科赛博 | 2023-09-20 | 6 个月 | 新股限售 | 69.98 | 60.10 | 194 | 13,576.12 | 11,659.40 | — |
| 688720 | 艾森股份 | 2023-11-29 | 6 个月 | 新股限售 | 28.03 | 49.84 | 165 | 4,624.95 | 8,223.60 | — |

#### 7.4.12.2 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。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2023 年 12 月 31 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。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 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。

#### 7.4.12.4 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 | 600515 | 海南机场 | 2024 年 01 月 02 日-2024 年 01 月 12 日 | 3.70 | 5,560,400 | 20,573,480.00 |
| 2 | 002707 | 众信旅游 | 2024 年 01 月 03 日- | 7.14 | 1,808,700 | 12,914,118.00 |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 2024 年 01 月 11 日 | | | |
| 3 | 000428 | 华天酒店 | 2024 年 01 月 03 日-2024 年 01 月 12 日 | 4.08 | 1,366,300 | 5,574,504.00 |
| 4 | 600754 | 锦江酒店 | 2024 年 01 月 02 日-2024 年 01 月 22 日 | 29.90 | 1,227,300 | 36,696,270.00 |
| 5 | 600138 | 中青旅 | 2024 年 01 月 02 日-2024 年 01 月 12 日 | 10.62 | 1,175,200 | 12,480,624.00 |
| 6 | 000069 | 华侨城Ａ | 2024 年 01 月 02 日-2024 年 01 月 11 日 | 3.11 | 1,172,300 | 3,645,853.00 |
| 7 | 600115 | 中国东航 | 2024 年 01 月 02 日-2024 年 01 月 08 日 | 3.88 | 965,700 | 3,746,916.00 |
| 8 | 002033 | 丽江股份 | 2024 年 01 月 02 日-2024 年 01 月 12 日 | 8.09 | 646,900 | 5,233,421.00 |
| 9 | 600258 | 首旅酒店 | 2024 年 01 月 02 日-2024 年 01 月 12 日 | 15.62 | 580,500 | 9,067,410.00 |
| 10 | 000524 | 岭南控股 | 2024 年 01 月 02 日-2024 年 01 月 12 日 | 8.91 | 539,000 | 4,802,490.00 |
| 11 | 601111 | 中国国航 | 2024 年 01 月 02 日-2024 年 01 月 09 日 | 7.34 | 508,300 | 3,730,922.00 |
| 12 | 600029 | 南方航空 | 2024 年 01 月 02 日-2024 年 01 月 10 日 | 5.76 | 491,200 | 2,829,312.00 |
| 13 | 002928 | 华夏航空 | 2024 年 01 月 02 日- | 7.14 | 468,700 | 3,346,518.00 |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 2024 年 01 月 12 日 | | | |
| 14 | 300144 | 宋城演艺 | 2024 年 01 月 02 日-2024 年 01 月 12 日 | 9.87 | 314,600 | 3,105,102.00 |
| 15 | 301073 | 君亭酒店 | 2024 年 01 月 02 日-2024 年 01 月 12 日 | 22.69 | 214,000 | 4,855,660.00 |
| 16 | 600004 | 白云机场 | 2024 年 01 月 02 日-2024 年 01 月 12 日 | 9.78 | 192,800 | 1,885,584.00 |
| 17 | 601888 | 中国中免 | 2024 年 01 月 02 日-2024 年 01 月 11 日 | 83.69 | 175,500 | 14,687,595.00 |
| 18 | 600897 | 厦门空港 | 2024 年 01 月 02 日-2024 年 01 月 10 日 | 12.49 | 141,100 | 1,762,339.00 |
| 19 | 000089 | 深圳机场 | 2024 年 01 月 02 日-2024 年 01 月 12 日 | 6.43 | 134,500 | 864,835.00 |
| 20 | 600009 | 上海机场 | 2024 年 01 月 02 日-2024 年 01 月 12 日 | 32.78 | 114,800 | 3,763,144.00 |
| 21 | 603885 | 吉祥航空 | 2024 年 01 月 02 日-2024 年 01 月 11 日 | 12.00 | 105,300 | 1,263,600.00 |
| 22 | 601021 | 春秋航空 | 2024 年 01 月 02 日 | 50.20 | 41,300 | 2,073,260.00 |
| 合计 | - | - | - | - | 17,944,400.00 | 158,902,957.00 |

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 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。

##### 7.4.13.2.1 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。

##### 7.4.13.2.2 按长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长期信用评级列示的信用债。

##### 7.4.13.2.3 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。

##### 7.4.13.2.4 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。

#### 7.4.13.3 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。

##### 7.4.13.3.1 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 7.4.12 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。

#### 7.4.13.4 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。

#### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为货币资金、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 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 12 月 31 日） | 1 个月以内 | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 资产 | | | | | | | |
| 货币资金 | 17,052,129.58 | — | — | — | — | — | 17,052,129.58 |
| 结算备付金 | 909,182.20 | — | — | — | — | — | 909,182.20 |
| 存出保证金 | 611,634.79 | — | — | — | — | — | 611,634.79 |
| 交易性金融资产 | — | — | — | — | — | 2,609,578,584.12 | 2,609,578,584.12 |
| 应收清算款 | — | — | — | — | — | 1,009,194.12 | 1,009,194.12 |
| 其他资产 | — | — | — | — | — | 72,008.55 | 72,008.55 |
| 资产总计 | 18,572,946.57 | — | — | — | — | 2,610,659,786.79 | 2,629,232,733.36 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付清算款 | — | — | — | — | — | 3,100,978.00 | 3,100,978.00 |
| 应付管理人报酬 | — | — | — | — | — | 1,163,413.35 | 1,163,413.35 |
| 应付托管费 | — | — | — | — | — | 232,682.66 | 232,682.66 |
| 应交税费 | — | — | — | — | — | 7,628.89 | 7,628.89 |
| 其他负债 | — | — | — | — | — | 802,412.46 | 802,412.46 |
| 负债总计 | — | — | — | — | — | 5,307,115.36 | 5,307,115.36 |
| 利率敏感度缺口 | 18,572,946.57 | — | — | — | — | 2,605,352,671.43 | 2,623,925,618.00 |
| 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 | | | | | | | |
| 货币资金 | 15,672,359.94 | — | — | — | — | — | 15,672,359.94 |
| 结算备付金 | 5,399,777.63 | — | — | — | — | — | 5,399,777.63 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 存出保证金 | 177,589.13 | — | — | — | — | — | 177,589.13 |
| 交易性金融资产 | — | — | — | — | — | 1,929,273,734.47 | 1,929,273,734.47 |
| 应收清算款 | — | — | — | — | — | 10,504,732.25 | 10,504,732.25 |
| 其他资产 | — | — | — | — | — | 83,511.08 | 83,511.08 |
| 资产总计 | 21,249,726.70 | — | — | — | — | 1,939,861,977.80 | 1,961,111,704.50 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付清算款 | — | — | — | — | — | 18,955,673.33 | 18,955,673.33 |
| 应付管理人报酬 | — | — | — | — | — | 785,711.80 | 785,711.80 |
| 应付托管费 | — | — | — | — | — | 157,142.35 | 157,142.35 |
| 应交税费 | — | — | — | — | — | 9,387.43 | 9,387.43 |
| 其他负债 | — | — | — | — | — | 380,612.78 | 380,612.78 |
| 负债总计 | — | — | — | — | — | 20,288,527.69 | 20,288,527.69 |
| 利率敏感度缺口 | 21,249,726.70 | — | — | — | — | 1,919,573,450.11 | 1,940,823,176.81 |

7.4.13.4.1.2 **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。

**7.4.13.4.2 外汇风险**

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

**7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 **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、创业板及其他经中国证监会允许发行的股票、存托凭证）、债券（国债、央行票据、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、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、衍生工具（股指期货、股票期权等）、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）的比例不得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。本基金每个交易日日终在扣除股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规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 12 月 31 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 | 2,609,578,584.12 | 99.45 | 1,929,273,734.47 | 99.40 |
| 交易性金融资产－基金投资 | － | － | － | － |
| 交易性金融资产－债券投资 | － | － | － | － |
| 交易性金融资产－贵金属投资 | － | － | － | － |
| 衍生金融资产－权证投资 | － | － | － | － |
| 其他 | － | － | － | － |
| 合计 | 2,609,578,584.12 | 99.45 | 1,929,273,734.47 | 99.40 |

**7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日） | 上年度末（2022 年 12 月 31 日） |
| | 1.业绩比较基准增加 1% | 26,141,813.69 | 19,272,143.15 |
| | 2.业绩比较基准减少 1% | -26,141,813.69 | -19,272,143.15 |

**7.4.14 公允价值**

#### 7.4.14.1 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。

#### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.2.1 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 12 月 31 日） | 上年度末（2022 年 12 月 31 日） |
|---|---|---|
| 第一层次 | 2,608,603,861.27 | 1,927,295,556.31 |
| 第二层次 | — | 385,863.40 |
| 第三层次 | 974,722.85 | 1,592,314.76 |
| 合计 | 2,609,578,584.12 | 1,929,273,734.47 |

##### 7.4.14.2.2 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。

##### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

| 项目 | 本期（2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日） | | |
|---|---|---|---|
| | 交易性金融资产 | | 合计 |
| | 债券投资 | 股票投资 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 期初余额 | — | 1,592,314.76 | 1,592,314.76 |
| 当期购买 | — | 2,214,710.80 | 2,214,710.80 |
| 当期出售/结算 | — | — | — |
| 转入第三层次 | — | — | — |
| 转出第三层次 | — | 3,111,982.18 | 3,111,982.18 |
| 当期利得或损失总额 | — | 279,679.47 | 279,679.47 |
| 其中：计入损益的利得或损失 | — | 279,679.47 | 279,679.47 |
| 期末余额 | — | 974,722.85 | 974,722.85 |
| 期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益 | — | 53,918.48 | 53,918.48 |

| 项目 | 上年度可比期间（2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日） | | |
|---|---|---|---|
| | 交易性金融资产 | | 合计 |
| | 债券投资 | 股票投资 | |
| 期初余额 | — | 519,323.45 | 519,323.45 |
| 当期购买 | — | 1,508,329.95 | 1,508,329.95 |
| 当期出售/结算 | — | — | — |
| 转入第三层次 | — | — | — |
| 转出第三层次 | — | 509,743.14 | 509,743.14 |
| 当期利得或损失总额 | — | 74,404.50 | 74,404.50 |
| 其中：计入损益的利得或损失 | — | 74,404.50 | 74,404.50 |
| 期末余额 | — | 1,592,314.76 | 1,592,314.76 |
| 期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益 | — | 83,984.81 | 83,984.81 |

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

| 项目 | 本期末公允价值 | 采用的估值技术 | 不可观察输入值 | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | 名称 | 范围/加权平均值 | 与公允价值之间的关系 |
| 限售股票 | 974,722.85 | 平均价格亚式期权模型 | 股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率 | 0.1462-2.1752 | 负相关 |

| 项目 | 上年度末公允价值 | 采用的估值技术 | 不可观察输入值 | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | 名称 | 范围/加权平均值 | 与公允价值之间的关系 |
| 限售股票 | 1,592,314.76 | 平均价格亚式期权模型 | 股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率 | 0.2127-2.4756 | 负相关 |

**7.4.14.3 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。

**7.4.14.4 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。

**7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

7.4.15.1 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。

7.4.15.2 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。

## §8 投资组合报告

**8.1 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 | 2,609,578,584.12 | 99.25 |
| | 其中：股票 | 2,609,578,584.12 | 99.25 |
| 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 | 17,961,311.78 | 0.68 |
| 8 | 其他各项资产 | 1,692,837.46 | 0.06 |
| 9 | 合计 | 2,629,232,733.36 | 100.00 |

注：本基金通过转融通证券出借业务出借证券的公允价值为158,902,957.00元，占资产净值比例为6.06%。

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 期末按行业分类的境内股票投资组合

#### 8.2.1.1 期末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 | 888,570.03 | 0.03 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | — | — |
| E | 建筑业 | — | — |
| F | 批发和零售业 | — | — |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 13,981.41 | 0.00 |
| H | 住宿和餐饮业 | — | — |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 42,548.95 | 0.00 |
| J | 金融业 | — | — |
| K | 房地产业 | — | — |
| L | 租赁和商务服务业 | 3,058.00 | 0.00 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 26,564.46 | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | — | — |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | — | — |
| P | 教育 | — | — |
| Q | 卫生和社会工作 | — | — |
| R | 文化、体育和娱乐业 | — | — |
| S | 综合 | — | — |
| | 合计 | 974,722.85 | 0.04 |

#### 8.2.1.2 期末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 | — | — |
| B | 采矿业 | — | — |
| C | 制造业 | — | — |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | — | — |
| E | 建筑业 | — | — |
| F | 批发和零售业 | — | — |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 824,513,085.82 | 31.42 |
| H | 住宿和餐饮业 | 425,229,466.00 | 16.21 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | — | — |
| J | 金融业 | — | — |
| K | 房地产业 | 168,608,921.56 | 6.43 |
| L | 租赁和商务服务业 | 572,934,289.86 | 21.84 |
| M | 科学研究和技术服务业 | — | — |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 348,709,443.31 | 13.29 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | — | — |
| P | 教育 | — | — |
| Q | 卫生和社会工作 | — | — |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 268,608,654.72 | 10.24 |
| S | 综合 | — | — |
| | 合计 | 2,608,603,861.27 | 99.42 |

## 8.3 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

### 8.3.1 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 | 601888 | 中国中免 | 4,852,230 | 406,083,128.70 | 15.48 |
| 2 | 300144 | 宋城演艺 | 27,214,656 | 268,608,654.72 | 10.24 |
| 3 | 600754 | 锦江酒店 | 5,936,391 | 177,498,090.90 | 6.76 |
| 4 | 600009 | 上海机场 | 5,153,923 | 168,945,595.94 | 6.44 |
| 5 | 601111 | 中国国航 | 19,290,100 | 141,589,334.00 | 5.40 |
| 6 | 600115 | 中国东航 | 35,451,200 | 137,550,656.00 | 5.24 |
| 7 | 600258 | 首旅酒店 | 8,691,900 | 135,767,478.00 | 5.17 |
| 8 | 600029 | 南方航空 | 22,342,033 | 128,690,110.08 | 4.90 |
| 9 | 600515 | 海南机场 | 28,416,836 | 105,142,293.20 | 4.01 |
| 10 | 601021 | 春秋航空 | 2,017,300 | 101,268,460.00 | 3.86 |
| 11 | 600138 | 中青旅 | 7,526,900 | 79,935,678.00 | 3.05 |
| 12 | 002707 | 众信旅游 | 8,936,840 | 63,809,037.60 | 2.43 |
| 13 | 000069 | 华侨城A | 20,407,276 | 63,466,628.36 | 2.42 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 14 | 600004 | 白云机场 | 4,888,700 | 47,811,486.00 | 1.82 |
| 15 | 603885 | 吉祥航空 | 3,667,700 | 44,012,400.00 | 1.68 |
| 16 | 000888 | 峨眉山A | 4,808,200 | 42,937,226.00 | 1.64 |
| 17 | 600054 | 黄山旅游 | 3,352,400 | 36,474,112.00 | 1.39 |
| 18 | 002033 | 丽江股份 | 4,273,781 | 34,574,888.29 | 1.32 |
| 19 | 000610 | 西安旅游 | 2,472,100 | 34,139,701.00 | 1.30 |
| 20 | 002059 | 云南旅游 | 5,263,700 | 29,424,083.00 | 1.12 |
| 21 | 600706 | 曲江文旅 | 1,975,601 | 29,278,406.82 | 1.12 |
| 22 | 000978 | 桂林旅游 | 3,645,200 | 27,557,712.00 | 1.05 |
| 23 | 000089 | 深圳机场 | 4,238,600 | 27,254,198.00 | 1.04 |
| 24 | 000428 | 华天酒店 | 6,614,400 | 26,986,752.00 | 1.03 |
| 25 | 603099 | 长白山 | 1,744,600 | 26,134,108.00 | 1.00 |
| 26 | 601007 | 金陵饭店 | 3,043,100 | 24,588,248.00 | 0.94 |
| 27 | 301073 | 君亭酒店 | 1,024,051 | 23,235,717.19 | 0.89 |
| 28 | 000524 | 岭南控股 | 2,593,316 | 23,106,445.56 | 0.88 |
| 29 | 603199 | 九华旅游 | 884,300 | 22,947,585.00 | 0.87 |
| 30 | 600593 | 大连圣亚 | 1,155,100 | 22,709,266.00 | 0.87 |
| 31 | 603136 | 天目湖 | 1,183,360 | 21,738,323.20 | 0.83 |
| 32 | 600749 | 西藏旅游 | 1,768,200 | 20,794,032.00 | 0.79 |
| 33 | 002928 | 华夏航空 | 2,632,000 | 18,792,480.00 | 0.72 |
| 34 | 000721 | 西安饮食 | 1,423,987 | 15,564,177.91 | 0.59 |
| 35 | 605108 | 同庆楼 | 415,050 | 12,634,122.00 | 0.48 |
| 36 | 002186 | 全 聚 德 | 768,000 | 8,954,880.00 | 0.34 |
| 37 | 600897 | 厦门空港 | 688,420 | 8,598,365.80 | 0.33 |

### 8.3.2 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 | 688563 | 航材股份 | 1,501 | 90,795.49 | 0.00 |
| 2 | 688548 | 广钢气体 | 4,048 | 51,612.00 | 0.00 |
| 3 | 603296 | 华勤技术 | 593 | 46,105.75 | 0.00 |
| 4 | 301348 | 蓝箭电子 | 613 | 27,321.41 | 0.00 |
| 5 | 688702 | 盛科通信 | 549 | 26,450.82 | 0.00 |
| 6 | 301486 | 致尚科技 | 482 | 22,774.50 | 0.00 |
| 7 | 301511 | 德福科技 | 982 | 22,261.94 | 0.00 |
| 8 | 688652 | 京仪装备 | 416 | 21,736.00 | 0.00 |
| 9 | 301525 | 儒竞科技 | 266 | 21,668.36 | 0.00 |
| 10 | 301498 | 乖宝宠物 | 554 | 21,500.74 | 0.00 |
| 11 | 301421 | 波长光电 | 332 | 19,710.84 | 0.00 |
| 12 | 688627 | 精智达 | 222 | 19,473.84 | 0.00 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 13 | 688591 | 泰凌微 | 681 | 19,081.62 | 0.00 |
| 14 | 300904 | 威力传动 | 304 | 18,705.12 | 0.00 |
| 15 | 301488 | 豪恩汽电 | 262 | 18,101.58 | 0.00 |
| 16 | 301468 | 博盈特焊 | 598 | 18,071.56 | 0.00 |
| 17 | 301362 | 民爆光电 | 420 | 16,178.40 | 0.00 |
| 18 | 688612 | 威迈斯 | 422 | 16,023.34 | 0.00 |
| 19 | 301393 | 昊帆生物 | 260 | 15,436.20 | 0.00 |
| 20 | 688610 | 埃科光电 | 275 | 14,025.00 | 0.00 |
| 21 | 601083 | 锦江航运 | 1,263 | 13,981.41 | 0.00 |
| 22 | 301510 | 固高科技 | 396 | 13,863.96 | 0.00 |
| 23 | 301566 | 达利凯普 | 576 | 12,752.64 | 0.00 |
| 24 | 301456 | 盘古智能 | 407 | 12,368.73 | 0.00 |
| 25 | 688602 | 康鹏科技 | 1,066 | 11,789.96 | 0.00 |
| 26 | 688719 | 爱科赛博 | 194 | 11,659.40 | 0.00 |
| 27 | 301550 | 斯菱股份 | 260 | 11,328.20 | 0.00 |
| 28 | 301508 | 中机认检 | 419 | 11,178.92 | 0.00 |
| 29 | 301251 | 威尔高 | 321 | 11,103.39 | 0.00 |
| 30 | 688592 | 司南导航 | 216 | 10,914.48 | 0.00 |
| 31 | 688603 | 天承科技 | 140 | 10,379.60 | 0.00 |
| 32 | 688653 | 康希通信 | 648 | 10,361.52 | 0.00 |
| 33 | 301528 | 多浦乐 | 148 | 10,198.68 | 0.00 |
| 34 | 301329 | 信音电子 | 458 | 10,181.34 | 0.00 |
| 35 | 301261 | 恒工精密 | 198 | 10,068.30 | 0.00 |
| 36 | 301202 | 朗威股份 | 306 | 9,730.80 | 0.00 |
| 37 | 301395 | 仁信新材 | 520 | 9,718.80 | 0.00 |
| 38 | 688716 | 中研股份 | 267 | 9,716.13 | 0.00 |
| 39 | 301413 | 安培龙 | 164 | 9,543.16 | 0.00 |
| 40 | 301500 | 飞南资源 | 455 | 9,504.95 | 0.00 |
| 41 | 301418 | 协昌科技 | 189 | 9,487.80 | 0.00 |
| 42 | 301516 | 中远通 | 604 | 9,368.04 | 0.00 |
| 43 | 301272 | 英华特 | 173 | 9,234.74 | 0.00 |
| 44 | 301469 | 恒达新材 | 275 | 9,099.75 | 0.00 |
| 45 | 301518 | 长华化学 | 385 | 8,858.85 | 0.00 |
| 46 | 301568 | 思泰克 | 246 | 8,752.68 | 0.00 |
| 47 | 301520 | 万邦医药 | 160 | 8,438.40 | 0.00 |
| 48 | 688638 | 誉辰智能 | 141 | 8,414.88 | 0.00 |
| 49 | 688720 | 艾森股份 | 165 | 8,223.60 | 0.00 |
| 50 | 688651 | 盛邦安全 | 178 | 8,196.90 | 0.00 |
| 51 | 301517 | 陕西华达 | 185 | 8,082.65 | 0.00 |
| 52 | 301578 | 辰奕智能 | 118 | 8,061.76 | 0.00 |
| 53 | 688657 | 浩辰软件 | 101 | 7,901.23 | 0.00 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 54 | 688646 | 逸飞激光 | 219 | 7,899.33 | 0.00 |
| 55 | 688671 | 碧兴物联 | 226 | 7,751.80 | 0.00 |
| 56 | 603275 | 众辰科技 | 193 | 7,662.10 | 0.00 |
| 57 | 301533 | 威马农机 | 225 | 7,461.00 | 0.00 |
| 58 | 603062 | 麦加芯彩 | 126 | 7,284.06 | 0.00 |
| 59 | 301555 | 惠柏新材 | 224 | 7,266.56 | 0.00 |
| 60 | 301505 | 苏州规划 | 194 | 6,947.14 | 0.00 |
| 61 | 301515 | 港通医疗 | 230 | 6,502.10 | 0.00 |
| 62 | 688648 | 中邮科技 | 303 | 6,493.29 | 0.00 |
| 63 | 001378 | 德冠新材 | 205 | 6,410.35 | 0.00 |
| 64 | 603004 | 鼎龙科技 | 195 | 6,082.05 | 0.00 |
| 65 | 603107 | 上海汽配 | 292 | 5,311.48 | 0.00 |
| 66 | 603193 | 润本股份 | 303 | 5,047.98 | 0.00 |
| 67 | 001306 | 夏厦精密 | 64 | 4,823.04 | 0.00 |
| 68 | 001326 | 联域股份 | 99 | 4,815.36 | 0.00 |
| 69 | 001358 | 兴欣新材 | 87 | 3,841.92 | 0.00 |
| 70 | 001239 | 永达股份 | 189 | 3,764.88 | 0.00 |
| 71 | 603231 | 索宝蛋白 | 161 | 3,466.33 | 0.00 |
| 72 | 603276 | 恒兴新材 | 134 | 3,333.92 | 0.00 |
| 73 | 603373 | 安邦护卫 | 88 | 3,058.00 | 0.00 |

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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 | 601888 | 中国中免 | 1,003,737,221.54 | 51.72 |
| 2 | 600754 | 锦江酒店 | 569,289,158.64 | 29.33 |
| 3 | 600009 | 上海机场 | 523,836,869.04 | 26.99 |
| 4 | 600029 | 南方航空 | 357,068,097.36 | 18.40 |
| 5 | 600258 | 首旅酒店 | 340,884,984.05 | 17.56 |
| 6 | 601111 | 中国国航 | 338,728,801.13 | 17.45 |
| 7 | 600115 | 中国东航 | 314,084,892.34 | 16.18 |
| 8 | 601021 | 春秋航空 | 223,823,538.84 | 11.53 |
| 9 | 600138 | 中青旅 | 190,564,672.01 | 9.82 |
| 10 | 600004 | 白云机场 | 161,252,266.55 | 8.31 |
| 11 | 603885 | 吉祥航空 | 136,457,882.55 | 7.03 |
| 12 | 600515 | 海南机场 | 124,682,049.73 | 6.42 |
| 13 | 600054 | 黄山旅游 | 78,722,382.74 | 4.06 |
| 14 | 300144 | 宋城演艺 | 64,940,484.23 | 3.35 |
| 15 | 603136 | 天目湖 | 63,236,319.36 | 3.26 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 16 | 600706 | 曲江文旅 | 57,626,764.99 | 2.97 |
| 17 | 601007 | 金陵饭店 | 50,683,946.27 | 2.61 |
| 18 | 600749 | 西藏旅游 | 46,258,956.06 | 2.38 |
| 19 | 605108 | 同庆楼 | 41,280,542.18 | 2.13 |
| 20 | 603199 | 九华旅游 | 39,257,903.00 | 2.02 |

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

**8.4.2 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 | 601888 | 中国中免 | 538,969,549.90 | 27.77 |
| 2 | 600754 | 锦江酒店 | 407,451,335.75 | 20.99 |
| 3 | 600009 | 上海机场 | 376,392,779.40 | 19.39 |
| 4 | 600029 | 南方航空 | 294,886,886.93 | 15.19 |
| 5 | 600258 | 首旅酒店 | 250,603,163.89 | 12.91 |
| 6 | 601111 | 中国国航 | 228,914,674.63 | 11.79 |
| 7 | 600115 | 中国东航 | 212,402,660.62 | 10.94 |
| 8 | 601021 | 春秋航空 | 166,224,700.87 | 8.56 |
| 9 | 600138 | 中青旅 | 137,374,391.83 | 7.08 |
| 10 | 600004 | 白云机场 | 128,613,226.12 | 6.63 |
| 11 | 603885 | 吉祥航空 | 100,302,812.26 | 5.17 |
| 12 | 600054 | 黄山旅游 | 57,171,860.05 | 2.95 |
| 13 | 603136 | 天目湖 | 46,409,033.01 | 2.39 |
| 14 | 600706 | 曲江文旅 | 41,790,933.00 | 2.15 |
| 15 | 601007 | 金陵饭店 | 36,908,989.53 | 1.90 |
| 16 | 300144 | 宋城演艺 | 36,487,868.00 | 1.88 |
| 17 | 605108 | 同庆楼 | 35,810,230.43 | 1.85 |
| 18 | 600749 | 西藏旅游 | 35,297,323.23 | 1.82 |
| 19 | 000069 | 华侨城 A | 34,223,414.48 | 1.76 |
| 20 | 002707 | 众信旅游 | 23,361,801.12 | 1.20 |

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。

**8.4.3 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 | 4,885,847,149.38 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 3,348,616,234.19 |

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。

**8.5 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。

**8.6 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。

**8.7 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。

**8.8 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。

**8.9 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。

**8.10 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，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。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

**8.11.1 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。

**8.11.2 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。

**8.12 投资组合报告附注**

**8.12.1 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。

**8.12.2 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。

### 8.12.3 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 | 611,634.79 |
| 2 | 应收清算款 | 1,009,194.12 |
| 3 | 应收股利 | — |
| 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 | 72,008.55 |
| 9 | 其他 | — |
| 10 | 合计 | 1,692,837.46 |

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 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 | 600754 | 锦江酒店 | 36,696,270.00 | 1.40 | 转融通流通受限 |
| 2 | 600515 | 海南机场 | 20,573,480.00 | 0.78 | 转融通流通受限 |
| 3 | 601888 | 中国中免 | 14,687,595.00 | 0.56 | 转融通流通受限 |
| 4 | 600258 | 首旅酒店 | 9,067,410.00 | 0.35 | 转融通流通受限 |
| 5 | 600009 | 上海机场 | 3,763,144.00 | 0.14 | 转融通流通受限 |
| 6 | 600115 | 中国东航 | 3,746,916.00 | 0.14 | 转融通流通受限 |
| 7 | 601111 | 中国国航 | 3,730,922.00 | 0.14 | 转融通流通受限 |
| 8 | 300144 | 宋城演艺 | 3,105,102.00 | 0.12 | 转融通流通受限 |
| 9 | 600029 | 南方航空 | 2,829,312.00 | 0.11 | 转融通流通受限 |
| 10 | 601021 | 春秋航空 | 2,073,260.00 | 0.08 | 转融通流通受限 |

#### 8.12.5.2 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 | 688563 | 航材股份 | 90,795.49 | 0.00 | 新股限售 |
| 2 | 688548 | 广钢气体 | 51,612.00 | 0.00 | 新股限售 |
| 3 | 603296 | 华勤技术 | 46,105.75 | 0.00 | 新股限售 |
| 4 | 301348 | 蓝箭电子 | 27,321.41 | 0.00 | 新股限售 |
| 5 | 688702 | 盛科通信 | 26,450.82 | 0.00 | 新股限售 |

**8.12.6 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。

## §9 基金份额持有人信息

**9.1 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 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比例（%） | 持有份额 | 占总份额比例（%） |
| 68,932 | 54,381.72 | 1,131,560,473.00 | 30.19 | 2,617,080,490.00 | 69.81 |

**9.2 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 | 华夏基金－中央汇金资产管理有限责任公司－华夏基金－汇金资管单一资产管理计划 | 126,675,336.00 | 3.38 |
| 2 | 天安人寿保险股份有限公司－分红产品 | 121,258,600.00 | 3.23 |
| 3 | 交银人寿保险有限公司－传统2 | 107,000,000.00 | 2.85 |
| 4 | 天安人寿保险股份有限公司－传统产品 | 46,151,000.00 | 1.23 |
| 5 | 华贵人寿保险股份有限公司－分红险2 | 43,567,400.00 | 1.16 |
| 6 | 中国平安人寿保险股份有限公 | 41,210,900.00 | 1.10 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 司－分红－个险分红 | | |
| 7 | 国任财产保险股份有限公司－传统险 3 | 41,000,000.00 | 1.09 |
| 8 | 交银人寿保险有限公司－分红 1 | 32,999,960.00 | 0.88 |
| 9 | 李妙法 | 32,416,200.00 | 0.86 |
| 10 | 漳州市国有资本运营集团有限公司 | 30,200,000.00 | 0.81 |

**9.3 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 | — | — |

**9.4 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 |

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日(2021 年 07 月 15 日)基金份额总额 | 291,640,963.00 |
| 报告期期初基金份额总额 | 1,723,640,963.00 |
| 本报告期基金总申购份额 | 5,993,500,000.00 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 3,968,500,000.00 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | — |
| 本报告期期末基金份额总额 | 3,748,640,963.00 |

## §11 重大事件揭示

**11.1 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。

**11.2 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**

本基金管理人于 2023 年 11 月 23 日发布公告，李强先生自 2023 年 11 月 22 日起担任首席信息官，同日起林志松先生不再兼任首席信息官。

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。

## 11.3 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。

## 11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

## 11.5 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。本基金本年度支付给审计机构安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 5.5 万元人民币，其已提供审计服务的连续年限为 21 年。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 11.6.1 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。

### 11.6.2 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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 11.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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 | 227,403,972.34 | 2.77 | 164,018.03 | 14.43 | — |
| 诚通证券 | 2 | 818,850.00 | 0.01 | 590.59 | 0.05 | — |
| 东方证券 | 2 | 46,595,548.97 | 0.57 | 34,274.14 | 3.02 | — |
| 东吴证券 | 2 | 385,579,728.26 | 4.70 | 283,169.92 | 24.91 | — |
| 方正证券 | 1 | 181,450.73 | 0.00 | 133.54 | 0.01 | — |
| 广发证券 | 2 | 238,308,528.83 | 2.90 | 173,805.85 | 15.29 | — |
| 国盛证券 | 2 | 2,792,270.14 | 0.03 | 2,014.41 | 0.18 | — |
| 海通证券 | 2 | 8,429,226.11 | 0.10 | 6,137.54 | 0.54 | — |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 华泰证券 | 2 | 5,754,934.48 | 0.07 | 4,191.81 | 0.37 | — |
| 华西证券 | 2 | 6,888,663,885.11 | 83.90 | 171,427.95 | 15.08 | — |
| 民生证券 | 3 | 14,395,211.93 | 0.18 | 10,458.31 | 0.92 | — |
| 申港证券 | 2 | — | — | — | — | — |
| 申万宏源 | 2 | 5,014,930.82 | 0.06 | 3,632.02 | 0.32 | — |
| 太平洋证券 | 2 | 134,895,045.62 | 1.64 | 99,514.73 | 8.75 | — |
| 银河证券 | 2 | 155,358,710.43 | 1.89 | 113,916.90 | 10.02 | — |
| 浙商证券 | 2 | 92,884,123.49 | 1.13 | 66,997.62 | 5.89 | — |
| 中金公司 | 2 | 3,164,811.74 | 0.04 | 2,287.07 | 0.20 | — |
| 中信建投 | 2 | 133,638.57 | 0.00 | 98.35 | 0.01 | — |
| 中信证券 | 2 | — | — | — | — | — |

注：我公司对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。本报告期内本基金租用券商交易单元无变更。

### 11.7.2 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 | — | — | — | — | — | — |
| 方正证券 | — | — | — | — | — | — |
| 广发证券 | — | — | — | — | — | — |
| 国盛证券 | — | — | — | — | — | — |
| 海通证券 | — | — | — | — | — | — |
| 华泰证券 | — | — | — | — | — | — |
| 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 | — | — | — | — | — | — |

## 11.8 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 |
| 3 | 富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告 | 规定披露媒介 | 2023年04月11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08月09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08月24日 |
| 6 | 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09月14日 |
| 7 | 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10月10日 |
| 8 | 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11月22日 |
| 9 | 富国基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告 | 规定披露媒介 | 2023年11月23日 |

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

| |
|---|
| 本报告期内，经基金管理人董事会七届一次会议审议通过并按规定备案，李强先生自 2023 年 11 月 22 日起担任首席信息官，同日起林志松先生不再兼任首席信息官。具体可参见基金管理人于 2023 年 11 月 23 日发布的《富国基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。 |

## §13 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旅游主题交易型开放式指数证券投资基金的文件<br>2、富国中证旅游主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同<br>3、富国中证旅游主题交易型开放式指数证券投资基金托管协议<br>4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件<br>5、富国中证旅游主题交易型开放式指数证券投资基金财务报表及报表附注<br>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。 |