

# 富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

## 二〇二四年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人： 富国基金管理有限公司

基金托管人： 中国银行股份有限公司

送出日期： 2024 年 08 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§2	基金简介	6
2.1	基金基本情况	6
2.2	基金产品说明	6
2.3	基金管理人和基金托管人	6
2.4	信息披露方式	7
2.5	其他相关资料	7
§3	主要财务指标和基金净值表现	8
3.1	主要会计数据和财务指标	8
3.2	基金净值表现	8
§4	管理人报告	10
4.1	基金管理人及基金经理情况	10
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	13
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§5	托管人报告	15
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
§6	中期财务报告（未经审计）	16
6.1	资产负债表	16
6.2	利润表	17
6.3	净资产变动表	18
6.4	报表附注	19
§7	投资组合报告	45
7.1	期末基金资产组合情况	45

7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	45
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细.....	47
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	60
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	62
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.....	62
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.....	62
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.....	62
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.....	62
7.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	62
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	62
7.12	投资组合报告附注.....	63
§8	基金份额持有人信息.....	65
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	65
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	65
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	65
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	65
§9	开放式基金份额变动.....	66
§10	重大事件揭示.....	67
10.1	基金份额持有人大会决议.....	67
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.....	67
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	67
10.4	基金投资策略的改变.....	67
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	67
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.....	67
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	68
10.8	其他重大事件.....	70
§11	影响投资者决策的其他重要信息.....	71
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.....	71
§12	备查文件目录.....	72



## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	富国中证沪港深 500ETF
场内简称	AH500ETF
基金主代码	517100
交易代码	517100
基金运作方式	契约型，交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 02 月 09 日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	454,102,125.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2021 年 3 月 2 日

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富国基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	许俊
	联系电话	021-20361818	010-66596688
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		95105686、4008880688	95566
传真		021-20361616	010-66594942
注册地址		中国(上海)自由贸易试验	北京市西城区复兴门内大

	区世纪大道 1196 号世纪汇 办公楼二座 27-30 层	街 1 号
办公地址	上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	北京市西城区复兴门内大 街 1 号
邮政编码	200120	100818
法定代表人	裴长江	葛海蛟

#### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披 露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正 文的管理人互联网网 址	www.fullgoal.com.cn
基金中期报告备置地 点	基金管理人及基金托管人住所

#### 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024年01月01日至2024年06月30日)
本期已实现收益	-25,085,911.39
本期利润	8,060,230.70
加权平均基金份额本期利润	0.0188
本期加权平均净值利润率	2.73%
本期基金份额净值增长率	3.41%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年06月30日)
期末可供分配利润	-135,766,558.98
期末可供分配基金份额利润	-0.2990
期末基金资产净值	318,335,566.02
期末基金份额净值	0.7010
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年06月30日)
基金份额累计净值增长率	-29.90%

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

### 3.2 基金净值表现

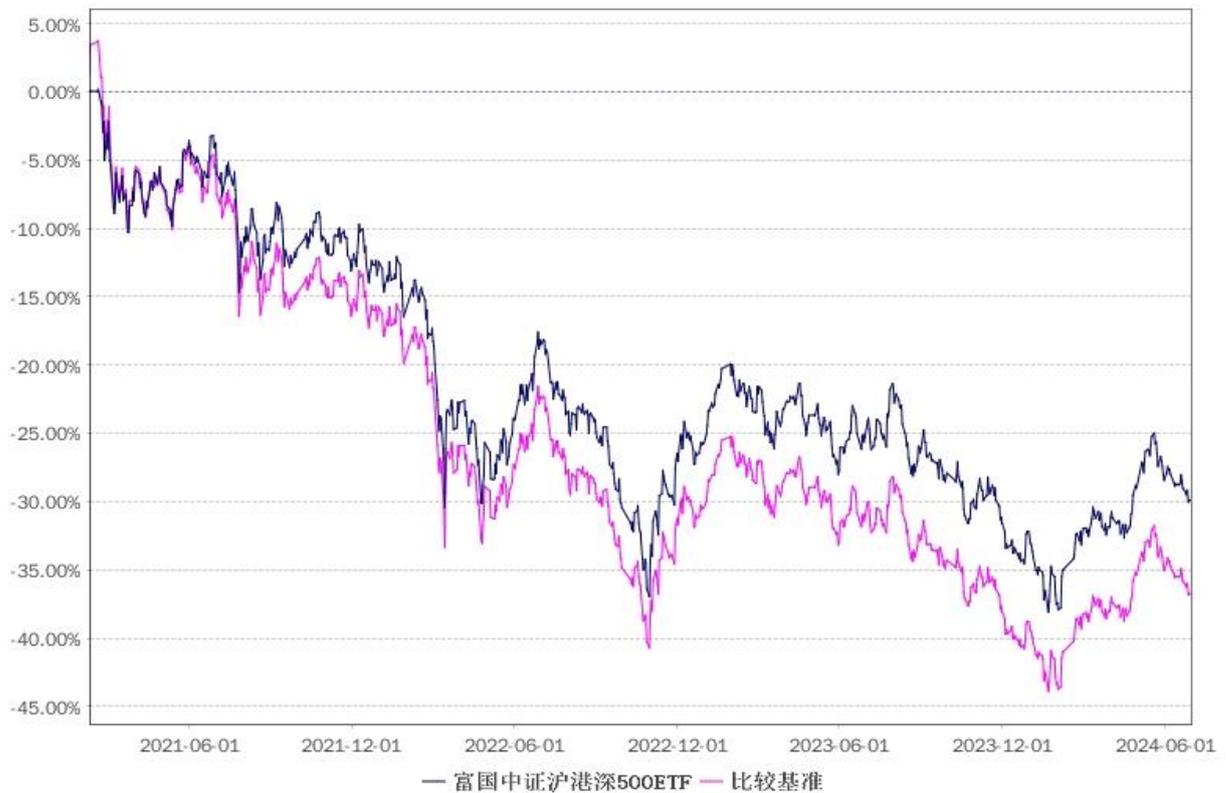
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-2.03%	0.55%	-2.60%	0.55%	0.57%	0.00%
过去三个月	2.88%	0.82%	2.13%	0.82%	0.75%	0.00%
过去六个月	3.41%	0.96%	3.37%	0.97%	0.04%	-0.01%
过去一年	-6.17%	0.95%	-8.18%	0.94%	2.01%	0.01%
过去三年	-27.06%	1.14%	-33.12%	1.12%	6.06%	0.02%

自基金合同生效起至今	-29.90%	1.14%	-36.73%	1.13%	6.83%	0.01%
------------	---------	-------	---------	-------	-------	-------

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2024年6月30日。

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

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

截至 2024 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 350 只公开募集证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
田希蒙	本基金现任基金经理	2023-03-03	—	7	硕士，自 2017 年 5 月加入富国基金管理有限公司，历任助理定量研究员、定量研究员、定量投资经理；现任富国基金量化投资部定量基金经理。自 2023 年 01 月起任富

					<p>国中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；自 2023 年 01 月起任富国中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2023 年 03 月起任富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2023 年 03 月起任富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；自 2023 年 04 月起任富国恒生港股通高股息低波动交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理；自 2023 年 06 月起任富国恒生港股通医疗保健交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2023 年 09 月起任富国恒生港股通高股息低波动交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；自 2023 年 10 月起任富国纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理；自 2023 年 11 月起任富国标普石油天然气勘探及生产精选行业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理；自 2023 年 12 月起任富国恒生港股通医疗保健交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；具有基金从业资格。</p>
--	--	--	--	--	--

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合规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险、力保基金资产的安全并谋求基金

资产长期稳定收益为目标，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

### **4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明**

#### **4.3.1 公平交易制度的执行情况**

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制，银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合，对同一投资标的采用相同投资策略的，必须通过交易系统采取同时、同价下达投资指令，确保公平对待其所管理的组合。事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1日、3日、5日）的季度公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统，对涉及公平性交易的投资行为进行分析评估，分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品，并重点分析同类组合（股票型、混合型、债券型）间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为，若发现异常交易行为，风险管理部视情况要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存，以备后查。本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，未出现违反公平交易制度的情况。

#### **4.3.2 异常交易行为的专项说明**

本报告期内未发现异常交易行为。

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报

告期内本组合与其他投资组合之间，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现 3 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**

运作分析上，本基金紧密跟踪指数标的，及时反馈公司行为和公司事件，最小化组合和指数的跟踪误差，力争为投资者提供长期稳定收益。

投资策略上，2024 年上半年，AH 股市场面临多重挑战，导致表现不佳。首先，国内需求疲软，特别是消费数据明显下滑，这直接影响了公司盈利预期和整体市场基本面。其次，美联储的政策调整也对市场造成了重大影响，点阵图显示，今年对降息预期从之前的 3 次减少至仅 1 次，加剧了市场的不确定性和压力。

##### **4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.701 元；份额累计净值为 0.701 元；本报告期，本基金份额净值增长率为 3.41%，同期业绩比较基准收益率为 3.37%。

#### **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，我们对三季度市场表现持积极态度，主要基于两大关键预期差。首先，6 月份的数据显示，美国核心 CPI、房地产销售、PMI 指数和零售数据等多个经济指标开始出现下滑趋势。尽管市场曾多次警告经济增长可能放缓，但 7 月初公布的非农就业报告显示，前几个月的就业数据被下调 11 万人，表明之前的就业数据中存在一定程度的虚假繁荣。

最后，AH500 作为 A 股和港股的大盘指数，或有望在经济复苏的前期充分受益。同时港股部分更加受益于全球的降息周期，如果后面 9 月份出现降息，那么该指数将受益该过程。

#### **4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明**

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

成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

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

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 中期财务报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>		
货币资金	2,055,334.70	3,227,165.60
结算备付金	624,140.67	44,615.56
存出保证金	41,676.78	10,740.65
交易性金融资产	315,829,513.89	295,373,383.14
其中：股票投资	315,829,513.89	295,373,383.14
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	6,170.07	354,974.32
应收股利	681,505.74	16,520.38
应收申购款	—	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	2,274.08
资产总计	319,238,341.85	299,029,673.73
<b>负债和净资产</b>	<b>本期末</b> 2024 年 06 月 30 日	<b>上年度末</b> 2023 年 12 月 31 日
<b>负 债：</b>		
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	574,790.51	25.65
应付赎回款	—	—
应付管理人报酬	131,737.52	124,516.57
应付托管费	26,347.48	24,903.32
应付销售服务费	—	—
应付投资顾问费	—	—
应交税费	16.66	225.26

应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	169,883.66	191,201.29
负债合计	902,775.83	340,872.09
<b>净资产：</b>		
实收基金	454,102,125.00	440,602,125.00
其他综合收益	—	—
未分配利润	-135,766,558.98	-141,913,323.36
净资产合计	318,335,566.02	298,688,801.64
负债和净资产总计	319,238,341.85	299,029,673.73

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.7010 元，基金份额总额 454,102,125.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日)	上年度可比期间 (2023 年 01 月 01 日 至 2023 年 06 月 30 日)
<b>一、营业总收入</b>	<b>9,034,761.49</b>	<b>3,767,572.92</b>
1.利息收入	32,306.28	47,958.32
其中：存款利息收入	10,740.45	5,224.61
债券利息收入	—	—
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	—	—
其他利息收入	21,565.83	42,733.71
2.投资收益（损失以“-”填列）	-24,203,059.04	-8,921,079.83
其中：股票投资收益	-28,506,572.69	-13,326,110.71
基金投资收益	—	—
债券投资收益	—	16,993.70
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	4,303,513.65	4,388,037.18
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）	33,146,142.09	12,673,821.26
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	59,372.16	-33,126.83

减：二、营业总支出	974,530.79	1,195,855.81
1. 管理人报酬	732,032.26	916,330.11
2. 托管费	146,406.38	183,266.05
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	77.34	153.79
8. 其他费用	96,014.81	96,105.86
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	8,060,230.70	2,571,717.11
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	8,060,230.70	2,571,717.11
五、其他综合收益的税后净额	—	—
六、综合收益总额	8,060,230.70	2,571,717.11

### 6.3 净资产变动表

会计主体：富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 (2024 年 01 月 01 日至 2024 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	440,602,125.00	141,913,323.36	298,688,801.64
二、本期期初净资产	440,602,125.00	141,913,323.36	298,688,801.64
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	13,500,000.00	6,146,764.38	19,646,764.38
（一）、综合收益总额	—	8,060,230.70	8,060,230.70
（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）	13,500,000.00	-1,913,466.32	11,586,533.68
其中：1. 基金申购款	121,500,000.00	-37,279,345.08	84,220,654.92
2. 基金赎回款	—	35,365,878.76	-72,634,121.24
	108,000,000.00		
（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）、其他综合收益结转留存收益	—	—	—
四、本期期末净资产	454,102,125.00	—	318,335,566.02

		135,766,558.98	
项目	上年度可比期间 (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	494,602,125.00	127,440,744.59	367,161,380.41
二、本期期初净资产	494,602,125.00	127,440,744.59	367,161,380.41
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-36,000,000.00	11,474,824.73	-24,525,175.27
(一)、综合收益总额	—	2,571,717.11	2,571,717.11
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-36,000,000.00	8,903,107.62	-27,096,892.38
其中：1.基金申购款	9,000,000.00	-2,166,012.44	6,833,987.56
2.基金赎回款	-45,000,000.00	11,069,120.06	-33,930,879.94
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	—	—	—
(四)、其他综合收益结转留存收益	—	—	—
四、本期期末净资产	458,602,125.00	115,965,919.86	342,636,205.14

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

陈戈

林志松

徐慧

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)，系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可(2020)3527 号《关于准予富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人富国基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2021 年 2 月 9 日正式生效，首次设立募集规模为 787,102,125.00 份基金份额。本基金为交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国银

行股份有限公司。

本基金的投资范围主要为标的指数成份股、备选成份股（均含存托凭证）和其他股票。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会允许发行的股票、港股通标的股票）、存托凭证、债券（国债、央行票据、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、金融衍生工具（股指期货、国债期货）、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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

本基金的业绩比较基准为中证沪港深 500 指数收益率。

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号《年度报告和中期报告》》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成

果和净资产变动情况。

#### **6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明**

本基金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‰；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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 (2024年06月30日)
活期存款	2,055,334.70
等于：本金	2,055,168.20

加：应计利息	166.50
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	2,055,334.70

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（2024年06月30日）			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	400,251,705.04	—	315,829,513.89	84,422,191.15
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	400,251,705.04	—	315,829,513.89	84,422,191.15

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易。

#### 6.4.7.5 其他资产

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（2024年06月30日）
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	23,042.12
其中：交易所市场	23,042.12
银行间市场	—
应付利息	—
预提信息披露费	60,000.00
预提审计费	56,897.06
IOPV 计算发布费	29,944.48
合计	169,883.66

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	440,602,125.00	440,602,125.00
本期申购	121,500,000.00	121,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-108,000,000.00	-108,000,000.00
本期末	454,102,125.00	454,102,125.00

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	—	—	—
	55,691,700.95	86,221,622.41	141,913,323.36
本期期初	—	—	—
	55,691,700.95	86,221,622.41	141,913,323.36
本期利润	—	33,146,142.09	8,060,230.70
	25,085,911.39		
本期基金份额交易产生的变动数	-3,104,567.12	1,191,100.80	-1,913,466.32
其中：基金申购款	—	—	—
	20,134,991.22	17,144,353.86	-37,279,345.08

基金赎回款	17,030,424.10	18,335,454.66	35,365,878.76
本期已分配利润	—	—	—
本期末	83,882,179.46	51,884,379.52	135,766,558.98

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
活期存款利息收入	6,791.71
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	3,721.72
其他	227.02
合计	10,740.45

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
股票投资收益——买卖股票差价收入	-22,588,097.44
股票投资收益——赎回差价收入	-5,918,475.25
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	-28,506,572.69

##### 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
卖出股票成交总额	54,950,204.67
减：卖出股票成本总额	77,415,897.21
减：交易费用	122,404.90
买卖股票差价收入	-22,588,097.44

##### 6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
赎回基金份额对价总额	72,634,121.24
减：现金支付赎回款总额	44,617,144.24
减：赎回股票成本总额	33,935,452.25
减：交易费用	—
赎回差价收入	-5,918,475.25

#### 6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益——申购差价收入。

#### 6.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益——证券出借差价收入。

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无债券投资收益。

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无买卖债券差价收入。

#### 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（2024年01月01日至2024年06月30日）
股票投资产生的股利收益	4,303,513.65
其中：证券出借权益补偿收入	9,133.90
基金投资产生的股利收益	—
合计	4,303,513.65

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
1. 交易性金融资产	33,146,142.09

股票投资	33,146,142.09
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	33,146,142.09

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
基金赎回费收入	—
替代损益	59,372.16
合计	59,372.16

#### 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（2024年01月01日至2024年06月30日）
审计费用	18,897.06
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	2,554.98
其他	14,562.77
合计	96,014.81

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大影响关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东、基金代销机构
中国银行股份有限公司	基金托管人
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
富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的联接基金

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（2024年01月01日至2024年06月30日）		上年度可比期间（2023年01月01日至2023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	23,674,689.31	18.86	8,063,599.34	15.83
申万宏源	—	—	680,548.07	1.34

#### 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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
海通证券	7,883.11	27.82	5,273.66	22.89
关联方名称	上年度可比期间（2023年01月01日至2023年06月30日）			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
海通证券	2,596.63	14.62	2,061.69	14.16
申万宏源	490.90	2.76	328.99	2.26

注：1、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。

2、自2024年7月1日起，根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）	上年度可比期间（2023年01月01日至2023年06月30日）
当期发生的基金应支付的管理费	732,032.26	916,330.11
其中：支付销售机构的客户维护费	—	—
应支付基金管理人的净管理费	732,032.26	916,330.11

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日）	上年度可比期间（2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日）
当期发生的基金应支付的托管费	146,406.38	183,266.05

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

单位：人民币元

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

注：本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率从事

证券出借业务。

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

金额单位：人民币元

本期（2024年01月01日至2024年06月30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	48,944.00	1.00	1.00	13.49	—	—
上年度可比期间（2023年01月01日至2023年06月30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	1,887,171.00	3.10~5.67	3.51	1,939.13	380,120.00	159.94
申万宏源	266,904.00	3.78	3.78	308.69	113,223.00	47.08

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

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

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末（2024年06月30日）		上年度末（2023年12月31日）	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）
富国中证沪港深500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	108,395,000.00	23.87	113,440,900.00	25.75
海通证券股份有限公司	1,446,200.00	0.32	1,445,600.00	0.33

#### 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（2024年01月01日至2024年06月30日）		上年度可比期间（2023年01月01日至2023年06月30日）	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	2,055,334.70	6,791.71	3,971,571.48	4,302.46

#### 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

上年度可比期间（2023年01月01日至2023年06月30日）					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
海通证券股份有限公司	688531	日联科技	IPO网下申购	1,269	193,370.22
海通证券股份有限公司	688515	裕太微	IPO网下申购	1,853	171,328.38
申万宏源证券承销保荐有限责任公司	601916	浙商银行	配股	23,220	46,904.40

注：本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

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

本报告期末，本基金持有海通证券 95,547 股，占基金资产净值比例 0.26%。

上年度末，本基金持有海通证券 92,000 股，占基金资产净值比例 0.29%。

本报告期末，本基金持有申万宏源 89,200 股，占基金资产净值比例 0.12%。

上年度末，本基金持有申万宏源 85,900 股，占基金资产净值比例 0.13%。

本报告期末，本基金持有中国银行（601988.SH）208,600 股，占基金资产净值比例 0.30%。上年度末，本基金持有中国银行（601988.SH）200,800 股，占基金资产净值比例 0.27%。

本报告期末，本基金持有中国银行（3988.HK）827,000 股，占基金资产净值比例 0.91%。上年度末，本基金持有中国银行（3988.HK）796,000 股，占基金资产净值比例 0.72%。

本报告期末，本基金持有中银证券 16,500 股，占基金资产净值比例 0.05%。上年度末，本基金持有中银证券 15,800 股，占基金资产净值比例 0.05%。

本报告期末，本基金持有中银香港 42,000 股，占基金资产净值比例 0.29%。上年度末，本基金持有中银香港 41,000 股，占基金资产净值比例 0.26%。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2024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
001379	腾达科技	2024-01-11	6个月	新股限售	16.98	13.48	192	3,260.16	2,588.16	—
001387	雪祺电气	2024-01-04	6个月	新股限售	15.38	15.25	133	2,045.54	2,028.25	—
001387	雪祺电气	2024-06-03	2个月	新股限售_转增	—	15.25	40	—	610.00	—
301502	华阳智能	2024-01-26	6个月	新股限售	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	—
301566	达利凯普	2023-12-22	6个月	新股限售	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	—
603082	北自科技	2024-01-23	6个月	新股限售	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	—
603375	盛景微	2024-01-17	6个月	新股限售	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	—

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	--------	------	--------	--------------	--------	--------	----

02007	碧桂园	2024年04月 02日	重大事项停牌	0.05	—	—	124,000.00	598,033.51	6,200.00	—
-------	-----	-----------------	--------	------	---	---	------------	------------	----------	---

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2024 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 2024 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证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%，但标的指数成分券不受此限。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。由于国债、央行票据和政策性金融债的信用风险很低，故不进行列示。

#### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的信用债。

#### **6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资**

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。

#### **6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

#### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

### **6.4.13.3 流动性风险**

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

#### **6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放

申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金本报告期末无重大流动性风险。

#### **6.4.13.4 市场风险**

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

##### **6.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为货币资金、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（2024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							
货币资金	2,055,334.70	—	—	—	—	—	2,055,334.70
结算备付金	624,140.67	—	—	—	—	—	624,140.67
存出保证金	41,676.78	—	—	—	—	—	41,676.78
交易性金融资产	—	—	—	—	—	315,829,513.89	315,829,513.89
应收清算款	—	—	—	—	—	6,170.07	6,170.07
应收股利	—	—	—	—	—	681,505.74	681,505.74
资产总计	2,721,152.15	—	—	—	—	316,517,189.70	319,238,341.85
负债							
应付清算款	—	—	—	—	—	574,790.51	574,790.51
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	131,737.52	131,737.52
应付托管费	—	—	—	—	—	26,347.48	26,347.48
应交税费	—	—	—	—	—	16.66	16.66
其他负债	—	—	—	—	—	169,883.66	169,883.66
负债总计	—	—	—	—	—	902,775.83	902,775.83
利率敏感度缺口	2,721,152.15	—	—	—	—	315,614,413.87	318,335,566.02
上年度末（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	3,227,165.60	—	—	—	—	—	3,227,165.60
结算备付金	44,615.56	—	—	—	—	—	44,615.56

存出保证金	10,740.65	—	—	—	—	—	10,740.65
交易性金融资产	—	—	—	—	—	295,373,383.14	295,373,383.14
应收清算款	—	—	—	—	—	354,974.32	354,974.32
应收股利	—	—	—	—	—	16,520.38	16,520.38
其他资产	—	—	—	—	—	2,274.08	2,274.08
资产总计	3,282,521.81	—	—	—	—	295,747,151.92	299,029,673.73
负债							
应付清算款	—	—	—	—	—	25.65	25.65
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	124,516.57	124,516.57
应付托管费	—	—	—	—	—	24,903.32	24,903.32
应交税费	—	—	—	—	—	225.26	225.26
其他负债	—	—	—	—	—	191,201.29	191,201.29
负债总计	—	—	—	—	—	340,872.09	340,872.09
利率敏感度缺口	3,282,521.81	—	—	—	—	295,406,279.83	298,688,801.64

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末及上年度末均未持有债券资产（不含可转债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金可持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末（2024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	—	125,559,027.90	—	—	125,559,027.90
应收股利	—	681,505.74	—	—	681,505.74
资产合计	—	126,240,533.64	—	—	126,240,533.64
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	—	126,240,533.64	—	—	126,240,533.64
项目	上年度末（2023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	—	116,606,451.30	—	—	116,606,451.30
应收股利	—	16,520.38	—	—	16,520.38
资产合计	—	116,622,971.68	—	—	116,622,971.68
以外币计价的负债					
—	—	—	—	—	—
负债合计	—	—	—	—	—
资产负债表外汇风险敞口净额	—	116,622,971.68	—	—	116,622,971.68

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

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

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年06月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	港币相对人民币贬值 1%	-1,262,405.34	-1,166,229.72
	港币相对人民币升值 1%	1,262,405.34	1,166,229.72

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

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

本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

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

如法律法规对该比例要求有变更的，在履行适当程序后，以变更后的比例为

准，本基金的投资范围会做相应调整。

本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末（2024年06月30日）		上年度末（2023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	315,829,513.89	99.21	295,373,383.14	98.89
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	315,829,513.89	99.21	295,373,383.14	98.89

#### 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（2024年06月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	1. 业绩比较基准增加 1%	3,172,528.98	3,054,750.26
2. 业绩比较基准减少 1%	-3,172,528.98	-3,054,750.26	

#### 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 (2024年06月30日)	上年度末 (2023年12月31日)
第一层次	315,797,135.99	294,798,438.28
第二层次	15,974.72	—
第三层次	16,403.18	574,944.86
合计	315,829,513.89	295,373,383.14

##### 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	315,829,513.89	98.93
	其中：股票	315,829,513.89	98.93
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	2,679,475.37	0.84
8	其他各项资产	729,352.59	0.23
9	合计	319,238,341.85	100.00

注：本基金通过深港通交易机制投资的港股公允价值为 125,559,027.90 元，占资产净值比例为 39.44%。

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

##### 7.2.1.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	26,177.90	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	—	—

K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	26,177.90	0.01

### 7.2.1.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,219,732.00	0.70
B	采矿业	11,259,103.00	3.54
C	制造业	102,671,347.21	32.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,233,482.00	2.59
E	建筑业	3,993,127.00	1.25
F	批发和零售业	639,280.05	0.20
G	交通运输、仓储和邮政业	6,814,686.60	2.14
H	住宿和餐饮业	103,410.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,384,449.40	2.63
J	金融业	40,740,292.15	12.80
K	房地产业	1,718,708.00	0.54
L	租赁和商务服务业	1,393,400.98	0.44
M	科学研究和技术服务业	1,398,163.30	0.44
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	550,661.40	0.17
R	文化、体育和娱乐业	124,465.00	0.04
S	综合	—	—
	合计	190,244,308.09	59.76

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
金融	42,792,235.00	13.44
通信服务	29,562,972.40	9.29

非日常生活消费品	16,061,179.00	5.05
能源	7,599,413.00	2.39
工业	5,884,071.00	1.85
信息技术	5,587,229.00	1.76
房地产	5,438,924.00	1.71
公用事业	4,297,276.00	1.35
日常消费品	4,148,912.50	1.30
医疗保健	3,058,641.00	0.96
原材料	1,128,175.00	0.35
合计	125,559,027.90	39.44

注：1、以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

2、以上行业分类的统计中已包含深港通投资的股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	00700	腾讯控股	65,100	22,126,188.00	6.95
2	00005	汇丰控股	184,800	11,520,432.00	3.62
3	600519	贵州茅台	6,300	9,244,557.00	2.90
4	601318	中国平安	106,000	4,384,160.00	1.38
4	02318	中国平安	73,500	2,374,785.00	0.75
5	00939	建设银行	1,189,000	6,266,030.00	1.97
5	601939	建设银行	66,500	492,100.00	0.15
6	03690	美团-W	61,700	6,256,380.00	1.97
7	600036	招商银行	121,876	4,166,940.44	1.31
7	03968	招商银行	45,500	1,471,925.00	0.46
8	01398	工商银行	858,000	3,629,340.00	1.14
8	601398	工商银行	346,800	1,976,760.00	0.62
9	01299	友邦保险	110,800	5,359,396.00	1.68
10	00941	中国移动	60,500	4,251,940.00	1.34
10	600941	中国移动	8,900	956,750.00	0.30
11	300750	宁德时代	26,080	4,695,182.40	1.47
12	002594	比亚迪	9,000	2,252,250.00	0.71
12	01211	比亚迪股份	10,500	2,223,270.00	0.70
13	00883	中国海洋石油	176,000	3,597,440.00	1.13
13	600938	中国海油	20,600	679,800.00	0.21
14	03988	中国银行	827,000	2,902,770.00	0.91
14	601988	中国银行	208,600	963,732.00	0.30

15	601899	紫金矿业	163,000	2,863,910.00	0.90
15	02899	紫金矿业	56,000	842,240.00	0.26
16	600900	长江电力	120,800	3,493,536.00	1.10
17	000333	美的集团	48,100	3,102,450.00	0.97
18	601328	交通银行	271,900	2,031,093.00	0.64
18	03328	交通银行	173,000	967,070.00	0.30
19	00388	香港交易所	12,500	2,854,375.00	0.90
20	00857	中国石油股份	208,000	1,499,680.00	0.47
20	601857	中国石油	112,100	1,156,872.00	0.36
21	01810	小米集团—W	173,200	2,604,928.00	0.82
22	601166	兴业银行	143,900	2,535,518.00	0.80
23	601088	中国神华	32,500	1,442,025.00	0.45
23	01088	中国神华	32,500	1,066,325.00	0.33
24	000858	五粮液	19,200	2,458,368.00	0.77
25	601288	农业银行	315,900	1,377,324.00	0.43
25	01288	农业银行	305,000	930,250.00	0.29
26	00386	中国石油化工股份	242,000	1,118,040.00	0.35
26	600028	中国石化	143,800	908,816.00	0.29
27	600030	中信证券	96,635	1,761,656.05	0.55
27	06030	中信证券	20,500	215,250.00	0.07
28	002475	立讯精密	49,600	1,949,776.00	0.61
29	300760	迈瑞医疗	6,072	1,766,405.52	0.55
30	000651	格力电器	44,600	1,749,212.00	0.55
31	600690	海尔智家	37,400	1,061,412.00	0.33
31	06690	海尔智家	28,000	666,960.00	0.21
32	600276	恒瑞医药	44,060	1,694,547.60	0.53
33	688981	中芯国际	19,500	898,950.00	0.28
33	00981	中芯国际	47,000	734,610.00	0.23
34	600887	伊利股份	63,000	1,627,920.00	0.51
35	601728	中国电信	153,500	944,025.00	0.30
35	00728	中国电信	138,000	583,740.00	0.18
36	600309	万华化学	18,700	1,512,082.00	0.47
37	000725	京东方A	363,900	1,488,351.00	0.47
38	00669	创科实业	18,000	1,465,380.00	0.46
39	601601	中国太保	33,900	944,454.00	0.30
39	02601	中国太保	27,400	476,760.00	0.15
40	09633	农夫山泉	39,800	1,345,638.00	0.42
41	300059	东方财富	125,502	1,325,301.12	0.42

42	601816	京沪高铁	243,000	1,304,910.00	0.41
43	01024	快手-W	30,000	1,263,600.00	0.40
44	02628	中国人寿	74,000	745,920.00	0.23
44	601628	中国人寿	16,500	512,325.00	0.16
45	300308	中际旭创	8,800	1,213,344.00	0.38
46	002714	牧原股份	27,000	1,177,200.00	0.37
47	002415	海康威视	37,000	1,143,670.00	0.36
48	00002	中电控股	19,500	1,123,005.00	0.35
49	601668	中国建筑	207,300	1,100,763.00	0.35
50	601138	工业富联	39,400	1,079,560.00	0.34
51	600919	江苏银行	144,500	1,073,635.00	0.34
52	00016	新鸿基地产	17,000	1,048,050.00	0.33
53	000568	泸州老窖	7,300	1,047,477.00	0.33
54	300498	温氏股份	52,600	1,042,532.00	0.33
55	601985	中国核电	93,400	995,644.00	0.31
56	600809	山西汾酒	4,720	995,353.60	0.31
57	002371	北方华创	3,100	991,659.00	0.31
58	601225	陕西煤业	38,300	986,991.00	0.31
59	601919	中远海控	63,140	978,038.60	0.31
60	603259	药明康德	24,920	976,614.80	0.31
61	600406	国电南瑞	39,058	974,887.68	0.31
62	000001	平安银行	95,900	973,385.00	0.31
63	600031	三一重工	58,800	970,200.00	0.30
64	06160	百济神州	12,300	967,641.00	0.30
65	601658	邮储银行	109,900	557,193.00	0.18
65	01658	邮储银行	97,000	405,460.00	0.13
66	02020	安踏体育	14,000	958,300.00	0.30
67	600000	浦发银行	116,200	956,326.00	0.30
68	300124	汇川技术	18,450	946,485.00	0.30
69	000792	盐湖股份	53,800	938,810.00	0.29
70	02015	理想汽车-W	14,500	930,320.00	0.29
71	02388	中银香港	42,000	921,900.00	0.29
72	00001	长和	26,500	904,445.00	0.28
73	601766	中国中车	120,400	904,204.00	0.28
74	600150	中国船舶	22,000	895,620.00	0.28
75	300274	阳光电源	14,380	891,991.40	0.28
76	600050	中国联通	188,900	887,830.00	0.28
77	000063	中兴通讯	31,500	881,055.00	0.28
78	000338	潍柴动力	53,700	872,088.00	0.27
79	01109	华润置地	35,500	860,165.00	0.27

80	002352	顺丰控股	24,100	860,129.00	0.27
81	601169	北京银行	146,500	855,560.00	0.27
82	601012	隆基绿能	60,016	841,424.32	0.26
83	603501	韦尔股份	8,465	841,167.05	0.26
84	09987	百胜中国	3,800	837,216.00	0.26
85	00027	银河娱乐	25,000	830,500.00	0.26
86	600837	海通证券	95,547	817,882.32	0.26
87	000100	TCL 科技	185,720	802,310.40	0.25
88	600016	民生银行	209,500	794,005.00	0.25
89	002230	科大讯飞	18,300	785,985.00	0.25
90	600660	福耀玻璃	15,900	761,610.00	0.24
91	300502	新易盛	7,000	738,850.00	0.23
92	02057	中通快递— W	4,800	719,328.00	0.23
93	002142	宁波银行	32,490	716,729.40	0.23
94	601229	上海银行	98,457	714,797.82	0.22
95	00992	联想集团	70,000	704,200.00	0.22
96	600089	特变电工	50,080	694,609.60	0.22
97	00011	恒生银行	7,400	678,062.00	0.21
98	00998	中信银行	103,000	470,710.00	0.15
98	601998	中信银行	30,300	203,010.00	0.06
99	601390	中国中铁	101,700	663,084.00	0.21
100	000625	长安汽车	49,228	661,132.04	0.21
101	600104	上汽集团	46,300	641,718.00	0.20
102	688041	海光信息	9,125	641,670.00	0.20
103	00168	青岛啤酒股 份	8,000	380,400.00	0.12
103	600600	青岛啤酒	3,500	254,695.00	0.08
104	601688	华泰证券	51,000	631,890.00	0.20
105	603986	兆易创新	6,600	631,092.00	0.20
106	01171	兖矿能源	31,200	317,928.00	0.10
106	600188	兖矿能源	13,600	309,128.00	0.10
107	601006	大秦铁路	87,000	622,920.00	0.20
108	600048	保利发展	71,100	622,836.00	0.20
109	02313	申洲国际	8,900	620,953.00	0.20
110	600905	三峡能源	141,600	617,376.00	0.19
111	002027	分众传媒	99,800	604,788.00	0.19
112	601211	国泰君安	44,600	604,330.00	0.19
113	00003	香港中华煤 气	111,250	602,975.00	0.19
114	02328	中国财险	68,000	601,800.00	0.19

115	600436	片仔癀	2,900	600,793.00	0.19
116	601600	中国铝业	78,600	599,718.00	0.19
117	603019	中科曙光	14,400	597,600.00	0.19
118	603993	洛阳钼业	70,000	595,000.00	0.19
119	688012	中微公司	4,200	593,292.00	0.19
120	601888	中国中免	9,402	587,530.98	0.18
121	600019	宝钢股份	87,400	581,210.00	0.18
122	601818	光大银行	181,900	576,623.00	0.18
123	603288	海天味业	16,605	572,374.35	0.18
124	01519	极兔速递— W	86,800	565,068.00	0.18
125	01113	长实集团	21,000	560,700.00	0.18
126	00006	电能实业	14,500	559,120.00	0.18
127	00267	中信股份	86,000	557,280.00	0.18
128	600585	海螺水泥	23,600	556,724.00	0.17
129	601989	中国重工	112,800	556,104.00	0.17
130	01801	信达生物	16,000	537,440.00	0.17
131	600886	国投电力	29,400	536,256.00	0.17
132	600795	国电电力	88,300	528,917.00	0.17
133	00688	中国海外发 展	42,500	525,300.00	0.17
134	688111	金山办公	2,300	523,250.00	0.16
135	600999	招商证券	36,700	510,497.00	0.16
136	601009	南京银行	49,000	509,110.00	0.16
137	688008	澜起科技	8,900	508,724.00	0.16
138	000938	紫光股份	22,600	505,110.00	0.16
139	000425	徐工机械	70,200	501,930.00	0.16
140	600438	通威股份	25,900	494,949.00	0.16
141	600547	山东黄金	17,900	490,102.00	0.15
142	002304	洋河股份	6,000	484,440.00	0.15
143	300014	亿纬锂能	12,100	483,032.00	0.15
144	002463	沪电股份	13,200	481,800.00	0.15
145	00175	吉利汽车	60,000	481,200.00	0.15
146	600893	航发动力	13,100	478,805.00	0.15
147	002179	中航光电	12,568	478,212.40	0.15
148	300015	爱尔眼科	46,245	477,248.40	0.15
149	601669	中国电建	85,200	476,268.00	0.15
150	000002	万 科A	67,400	467,082.00	0.15
151	01093	石药集团	82,000	465,760.00	0.15
152	002241	歌尔股份	23,600	460,436.00	0.14
153	600926	杭州银行	35,100	458,055.00	0.14

154	000538	云南白药	8,940	457,281.00	0.14
155	02688	新奥能源	7,700	452,221.00	0.14
156	600584	长电科技	14,100	447,111.00	0.14
157	02269	药明生物	42,000	442,260.00	0.14
158	600760	中航沈飞	10,912	437,571.20	0.14
159	600111	北方稀土	24,900	428,280.00	0.13
160	600522	中天科技	27,000	427,950.00	0.13
161	00788	中国铁塔	462,000	425,040.00	0.13
162	600489	中金黄金	28,700	424,760.00	0.13
163	002050	三花智控	22,200	423,576.00	0.13
164	600011	华能国际	43,400	417,508.00	0.13
165	00066	港铁公司	18,500	416,250.00	0.13
166	00288	万洲国际	88,000	412,720.00	0.13
167	601916	浙商银行	149,220	411,847.20	0.13
168	002252	上海莱士	52,600	411,332.00	0.13
169	002028	思源电气	6,100	408,090.00	0.13
170	600015	华夏银行	63,000	403,200.00	0.13
171	600009	上海机场	12,300	396,675.00	0.12
172	02319	蒙牛乳业	31,000	396,180.00	0.12
173	00836	华润电力	18,000	393,480.00	0.12
174	02331	李宁	25,500	393,210.00	0.12
175	600958	东方证券	51,736	393,193.60	0.12
176	00762	中国联通	60,000	392,400.00	0.12
177	600426	华鲁恒升	14,670	390,808.80	0.12
178	601186	中国铁建	45,500	389,935.00	0.12
179	002311	海大集团	8,200	385,810.00	0.12
180	300408	三环集团	13,200	385,308.00	0.12
181	000166	申万宏源	89,200	384,452.00	0.12
182	00291	华润啤酒	16,000	383,360.00	0.12
183	000157	中联重科	49,200	377,856.00	0.12
184	688256	寒武纪	1,900	377,473.00	0.12
185	600989	宝丰能源	21,700	376,061.00	0.12
186	601901	方正证券	48,300	373,359.00	0.12
187	688169	石头科技	950	372,970.00	0.12
188	000977	浪潮信息	10,100	367,337.00	0.12
189	601058	赛轮轮胎	26,000	364,000.00	0.11
190	003816	中国广核	77,900	360,677.00	0.11
191	600674	川投能源	19,200	360,000.00	0.11
192	300433	蓝思科技	19,700	359,525.00	0.11
193	000776	广发证券	29,200	355,364.00	0.11
194	002049	紫光国微	6,720	353,472.00	0.11

195	002001	新和成	18,328	351,897.60	0.11
196	01928	金沙中国有限公司	23,600	350,696.00	0.11
197	09868	小鹏汽车—W	13,000	350,610.00	0.11
198	688271	联影医疗	3,195	350,491.50	0.11
199	601377	兴业证券	68,430	346,255.80	0.11
200	688036	传音控股	4,480	342,899.20	0.11
201	01997	九龙仓置业	18,000	340,020.00	0.11
202	600115	中国东航	84,700	339,647.00	0.11
203	601111	中国国航	46,000	339,480.00	0.11
204	002422	科伦药业	11,100	336,663.00	0.11
205	300122	智飞生物	11,800	330,754.00	0.10
206	000768	中航西飞	13,700	329,211.00	0.10
207	09626	哔哩哔哩—W	2,820	326,612.40	0.10
208	02382	舜宇光学科 技	7,400	325,896.00	0.10
209	002340	格林美	50,900	324,233.00	0.10
210	601825	沪农商行	47,800	321,216.00	0.10
211	600160	巨化股份	13,300	320,929.00	0.10
212	000596	古井贡酒	1,500	316,605.00	0.10
213	001979	招商蛇口	36,000	316,440.00	0.10
214	002460	赣锋锂业	11,040	316,296.00	0.10
215	600010	包钢股份	224,700	314,580.00	0.10
216	600029	南方航空	53,400	314,526.00	0.10
217	601800	中国交建	35,000	312,900.00	0.10
218	01821	ESR	33,200	310,752.00	0.10
219	00135	昆仑能源	42,000	310,380.00	0.10
220	002601	龙佰集团	16,700	310,119.00	0.10
221	00083	信和置业	42,000	308,700.00	0.10
222	601633	长城汽车	12,200	308,660.00	0.10
223	601077	渝农商行	61,300	307,726.00	0.10
224	002466	天齐锂业	10,200	305,082.00	0.10
225	600256	广汇能源	45,400	304,180.00	0.10
226	002236	大华股份	19,600	303,016.00	0.10
227	00285	比亚迪电子	8,500	302,515.00	0.10
228	01038	长江基建集 团	7,500	301,875.00	0.09
229	002648	卫星化学	16,785	301,794.30	0.09
230	603799	华友钴业	13,480	298,312.40	0.09

231	601117	中国化学	36,200	298,288.00	0.09
232	000661	长春高新	3,200	293,664.00	0.09
233	000786	北新建材	9,900	293,634.00	0.09
234	002493	荣盛石化	30,100	290,766.00	0.09
235	600346	恒力石化	20,800	290,160.00	0.09
236	000983	山西焦煤	28,000	288,680.00	0.09
237	601838	成都银行	18,900	287,091.00	0.09
238	01378	中国宏桥	26,500	285,935.00	0.09
239	600372	中航机载	23,860	285,604.20	0.09
240	300782	卓胜微	3,640	282,973.60	0.09
241	300394	天孚通信	3,200	282,944.00	0.09
242	600023	浙能电力	39,700	282,267.00	0.09
243	601788	光大证券	19,300	282,166.00	0.09
244	06862	海底捞	22,000	281,820.00	0.09
245	603369	今世缘	6,100	281,820.00	0.09
246	688223	晶科能源	39,541	280,741.10	0.09
247	002384	东山精密	13,500	279,450.00	0.09
248	002129	TCL 中环	32,050	277,232.50	0.09
249	000807	云铝股份	20,500	276,955.00	0.09
250	600196	复星医药	12,500	276,750.00	0.09
251	00020	商汤-W	230,000	276,000.00	0.09
252	002938	鹏鼎控股	6,900	274,344.00	0.09
253	300418	昆仑万维	8,500	274,040.00	0.09
254	000630	铜陵有色	75,800	273,638.00	0.09
255	600845	宝信软件	8,558	273,256.94	0.09
256	601868	中国能建	128,400	272,208.00	0.09
257	601872	招商轮船	32,200	272,090.00	0.09
258	601360	三六零	35,300	271,104.00	0.09
259	01177	中国生物制药	111,000	270,840.00	0.09
260	601021	春秋航空	4,800	270,384.00	0.08
261	000975	山金国际	16,500	268,785.00	0.08
262	00012	恒基地产	14,000	267,680.00	0.08
263	600233	圆通速递	17,100	267,615.00	0.08
264	601233	桐昆股份	16,700	266,532.00	0.08
265	600161	天坛生物	10,900	265,960.00	0.08
266	600219	南山铝业	69,500	264,795.00	0.08
267	00960	龙湖集团	27,000	264,060.00	0.08
268	300661	圣邦股份	3,185	263,654.30	0.08
269	600570	恒生电子	14,908	263,275.28	0.08
270	600176	中国巨石	23,690	261,774.50	0.08

271	002180	纳思达	9,800	258,916.00	0.08
272	605499	东鹏饮料	1,200	258,900.00	0.08
273	300347	泰格医药	5,300	257,580.00	0.08
274	002625	光启技术	14,800	256,780.00	0.08
275	601100	恒立液压	5,500	256,190.00	0.08
276	600085	同仁堂	6,700	256,007.00	0.08
277	600741	华域汽车	15,600	255,528.00	0.08
278	601995	中金公司	8,600	254,646.00	0.08
279	01308	海丰国际	13,000	251,550.00	0.08
280	601336	新华保险	8,300	249,249.00	0.08
281	002736	国信证券	28,500	247,665.00	0.08
282	603392	万泰生物	3,748	246,918.24	0.08
283	002271	东方雨虹	20,000	246,800.00	0.08
284	601066	中信建投	12,800	246,272.00	0.08
285	600096	云天化	12,600	244,692.00	0.08
286	600183	生益科技	11,600	244,296.00	0.08
287	600362	江西铜业	10,300	243,904.00	0.08
288	06618	京东健康	12,550	243,344.50	0.08
289	000895	双汇发展	10,200	242,454.00	0.08
290	000963	华东医药	8,700	241,947.00	0.08
291	601689	拓普集团	4,500	241,245.00	0.08
292	300896	爱美客	1,400	240,940.00	0.08
293	00004	九龙仓集团	12,000	240,360.00	0.08
294	600745	闻泰科技	8,500	240,125.00	0.08
295	001965	招商公路	20,200	239,572.00	0.08
296	002920	德赛西威	2,700	235,143.00	0.07
297	688777	中控技术	6,225	234,682.50	0.07
298	00268	金蝶国际	35,000	233,800.00	0.07
299	601555	东吴证券	39,590	233,581.00	0.07
300	600027	华电国际	33,600	233,184.00	0.07
301	601881	中国银河	21,400	232,404.00	0.07
302	600885	宏发股份	8,200	226,976.00	0.07
303	03800	协鑫科技	213,000	225,780.00	0.07
304	688126	沪硅产业	16,300	225,103.00	0.07
305	01193	华润燃气	9,000	224,640.00	0.07
306	601898	中煤能源	18,000	224,640.00	0.07
307	000999	华润三九	5,260	223,970.80	0.07
308	00019	太古股份公 司A	3,500	220,395.00	0.07
309	601618	中国中冶	70,700	219,170.00	0.07
310	603605	珀莱雅	1,960	217,540.40	0.07

311	601699	潞安环能	11,800	213,934.00	0.07
312	600026	中远海能	13,700	213,857.00	0.07
313	600515	海南机场	67,900	213,206.00	0.07
314	601108	财通证券	32,080	212,048.80	0.07
315	002916	深南电路	2,000	211,540.00	0.07
316	600482	中国动力	10,800	210,384.00	0.07
317	601607	上海医药	11,000	210,210.00	0.07
318	300832	新产业	3,100	209,064.00	0.07
319	000301	东方盛虹	26,200	208,814.00	0.07
320	600765	中航重机	10,200	208,080.00	0.07
321	300033	同花顺	2,000	207,400.00	0.07
322	601878	浙商证券	19,200	205,824.00	0.06
323	000876	新希望	22,500	205,650.00	0.06
324	002459	晶澳科技	18,332	205,318.40	0.06
325	00384	中国燃气	32,000	204,480.00	0.06
326	600039	四川路桥	25,900	204,351.00	0.06
327	600875	东方电气	11,000	202,950.00	0.06
328	002602	世纪华通	59,100	202,713.00	0.06
329	600332	白云山	6,900	202,377.00	0.06
330	002555	三七互娱	15,500	202,275.00	0.06
331	601877	正泰电器	10,600	202,036.00	0.06
332	600588	用友网络	20,200	202,000.00	0.06
333	600415	小商品城	27,100	201,082.00	0.06
334	002074	国轩高科	10,500	201,075.00	0.06
335	002709	天赐材料	11,400	200,184.00	0.06
336	002600	领益智造	27,700	197,224.00	0.06
337	03998	波司登	44,000	195,360.00	0.06
338	00868	信义玻璃	25,000	195,250.00	0.06
339	603606	东方电缆	4,000	195,240.00	0.06
340	688396	华润微	5,200	194,688.00	0.06
341	03888	金山软件	9,400	193,452.00	0.06
342	600025	华能水电	17,900	192,962.00	0.06
343	300003	乐普医疗	13,000	192,920.00	0.06
344	000408	藏格矿业	7,900	190,153.00	0.06
345	600803	新奥股份	9,100	189,280.00	0.06
346	00322	康师傅控股	22,000	188,980.00	0.06
347	300316	晶盛机电	6,500	186,745.00	0.06
348	002812	恩捷股份	5,900	186,735.00	0.06
349	688599	天合光能	10,983	185,832.36	0.06
350	601727	上海电气	50,100	185,370.00	0.06
351	300628	亿联网络	5,020	184,585.40	0.06

352	002202	金风科技	27,400	184,128.00	0.06
353	00241	阿里健康	64,000	183,040.00	0.06
354	300223	北京君正	3,300	182,952.00	0.06
355	300142	沃森生物	16,000	182,080.00	0.06
356	000932	华菱钢铁	40,900	181,187.00	0.06
357	300450	先导智能	10,860	180,601.80	0.06
358	00968	信义光能	50,000	179,500.00	0.06
359	03692	翰森制药	12,000	178,680.00	0.06
360	03311	中国建筑国际	18,000	175,140.00	0.06
361	06186	中国飞鹤	53,000	174,370.00	0.05
362	600460	士兰微	9,900	173,349.00	0.05
363	600298	安琪酵母	6,200	173,166.00	0.05
364	09896	名创优品	5,000	170,900.00	0.05
365	002007	华兰生物	10,800	170,532.00	0.05
366	601615	明阳智能	18,000	169,920.00	0.05
367	601238	广汽集团	21,900	169,506.00	0.05
368	688122	西部超导	4,420	169,374.40	0.05
369	000066	中国长城	19,200	168,000.00	0.05
370	605117	德业股份	2,240	166,521.60	0.05
371	688072	拓荆科技	1,384	166,232.24	0.05
372	300496	中科创达	3,600	164,124.00	0.05
373	300999	金龙鱼	6,000	164,100.00	0.05
374	300759	康龙化成	8,825	163,968.50	0.05
375	603260	合盛硅业	3,500	163,485.00	0.05
376	601319	中国人保	31,500	162,225.00	0.05
377	301269	华大九天	2,100	161,805.00	0.05
378	01209	华润万象生活	6,800	160,412.00	0.05
379	600018	上港集团	27,600	159,528.00	0.05
380	000733	振华科技	3,800	157,814.00	0.05
381	000783	长江证券	32,600	157,458.00	0.05
382	600918	中泰证券	27,500	155,925.00	0.05
383	688009	中国通号	25,785	154,710.00	0.05
384	603816	顾家家居	4,790	154,669.10	0.05
385	300413	芒果超媒	7,400	154,660.00	0.05
386	300751	迈为股份	1,280	152,934.40	0.05
387	002821	凯莱英	2,320	152,656.00	0.05
388	01044	恒安国际	7,000	152,040.00	0.05
389	300037	新宙邦	5,300	151,368.00	0.05
390	603806	福斯特	10,291	151,277.70	0.05

391	603939	益丰药房	6,111	150,025.05	0.05
392	601696	中银证券	16,500	149,820.00	0.05
393	01929	周大福	19,400	149,574.00	0.05
394	603345	安井食品	2,000	148,620.00	0.05
395	603659	璞泰来	10,514	148,562.82	0.05
396	02618	京东物流	19,400	148,410.00	0.05
397	03808	中国重汽	8,000	148,240.00	0.05
398	688180	君实生物	5,100	148,155.00	0.05
399	06969	思摩尔国际	17,000	146,880.00	0.05
400	00881	中升控股	14,000	145,880.00	0.05
401	603195	公牛集团	1,885	145,371.20	0.05
402	688506	百利天恒	800	145,120.00	0.05
403	600061	国投资本	25,400	143,510.00	0.05
404	300919	中伟股份	4,600	142,554.00	0.04
405	01876	百威亚太	16,900	141,960.00	0.04
406	002064	华峰化学	19,700	141,249.00	0.04
407	601799	星宇股份	1,252	140,274.08	0.04
408	600132	重庆啤酒	2,300	139,610.00	0.04
409	000617	中油资本	25,000	138,000.00	0.04
410	603589	口子窖	3,500	137,165.00	0.04
411	601865	福莱特	6,800	136,680.00	0.04
412	601059	信达证券	9,600	136,416.00	0.04
413	300146	汤臣倍健	10,000	135,500.00	0.04
414	000708	中信特钢	9,900	134,343.00	0.04
415	601966	玲珑轮胎	7,300	134,101.00	0.04
416	603198	迎驾贡酒	2,300	132,250.00	0.04
417	688047	龙芯中科	1,500	131,895.00	0.04
418	601018	宁波港	38,400	130,560.00	0.04
419	01972	太古地产	11,400	129,390.00	0.04
420	688303	大全能源	6,300	128,457.00	0.04
421	688187	时代电气	2,600	128,388.00	0.04
422	00144	招商局港口	12,000	127,320.00	0.04
423	002603	以岭药业	8,300	127,239.00	0.04
424	300454	深信服	2,500	126,325.00	0.04
425	002410	广联达	13,100	125,498.00	0.04
426	00270	粤海投资	30,000	125,100.00	0.04
427	600702	舍得酒业	2,200	124,674.00	0.04
428	300442	润泽科技	5,200	124,540.00	0.04
429	300144	宋城演艺	15,500	124,465.00	0.04
430	601216	君正集团	33,300	122,877.00	0.04
431	000723	美锦能源	25,600	121,856.00	0.04

432	002841	视源股份	4,100	121,073.00	0.04
433	00316	东方海外国 际	1,000	115,640.00	0.04
434	000629	钒钛股份	46,100	115,250.00	0.04
435	603899	晨光股份	3,600	112,608.00	0.04
436	601136	首创证券	5,400	110,484.00	0.03
437	06110	滔搏	29,000	109,910.00	0.03
438	01585	雅迪控股	12,000	108,120.00	0.03
439	601231	环旭电子	6,700	107,535.00	0.03
440	002939	长城证券	16,000	107,200.00	0.03
441	01548	金斯瑞生物 科技	14,000	106,260.00	0.03
442	603486	科沃斯	2,200	103,796.00	0.03
443	300601	康泰生物	6,640	103,650.40	0.03
444	600754	锦江酒店	4,500	103,410.00	0.03
445	00101	恒隆地产	17,000	103,360.00	0.03
446	688363	华熙生物	1,800	101,826.00	0.03
447	601808	中海油服	5,900	101,480.00	0.03
448	300763	锦浪科技	2,400	99,936.00	0.03
449	002414	高德红外	16,931	99,723.59	0.03
450	000069	华侨城A	48,600	99,144.00	0.03
451	600732	爱旭股份	10,860	98,283.00	0.03
452	603290	斯达半导	1,120	96,443.20	0.03
453	603833	欧派家居	1,800	96,408.00	0.03
454	00293	国泰航空	13,000	94,770.00	0.03
455	000877	天山股份	17,300	93,420.00	0.03
456	00017	新世界发展	14,000	93,380.00	0.03
457	688728	格科微	7,600	92,036.00	0.03
458	002568	百润股份	5,380	90,545.40	0.03
459	601698	中国卫通	6,400	90,176.00	0.03
460	01066	威高股份	26,400	89,760.00	0.03
461	002080	中材科技	6,700	86,430.00	0.03
462	300979	华利集团	1,400	85,190.00	0.03
463	002032	苏泊尔	1,600	80,160.00	0.03
464	300957	贝泰妮	1,600	77,312.00	0.02
465	603688	石英股份	2,600	76,986.00	0.02
466	688082	盛美上海	900	76,059.00	0.02
467	603737	三棵树	2,040	73,990.80	0.02
468	000987	越秀资本	14,910	73,953.60	0.02
469	603882	金域医学	2,700	73,413.00	0.02
470	688561	奇安信	2,700	63,774.00	0.02

471	600377	宁沪高速	4,800	60,480.00	0.02
472	600606	绿地控股	41,600	56,160.00	0.02
473	001872	招商港口	2,300	44,275.00	0.01
474	601061	中信金属	5,400	37,098.00	0.01
475	002945	华林证券	2,600	25,948.00	0.01
476	001289	龙源电力	1,500	25,875.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
2	02007	碧桂园	124,000	6,200.00	0.00
3	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
4	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
5	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
6	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
7	001379	腾达科技	192	2,588.16	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	00700	腾讯控股	5,449,704.92	1.82
2	00005	汇丰控股	3,099,749.69	1.04
3	01299	友邦保险	1,660,934.23	0.56
4	00941	中国移动	1,579,450.73	0.53
4	600941	中国移动	30,501.00	0.01
5	03690	美团-W	1,578,927.63	0.53
6	00939	建设银行	1,546,881.13	0.52
6	601939	建设银行	12,682.00	0.00
7	300750	宁德时代	1,487,493.00	0.50
8	01398	工商银行	922,083.62	0.31
8	601398	工商银行	81,844.00	0.03
9	02057	中通快递-W	963,084.25	0.32
10	300502	新易盛	932,097.00	0.31
11	300760	迈瑞医疗	900,548.00	0.30
12	000333	美的集团	896,957.00	0.30
13	02888	渣打集团	856,576.36	0.29
14	600900	长江电力	850,083.00	0.28
15	000858	五粮液	818,797.00	0.27

16	00883	中国海洋石油	781,833.29	0.26
16	600938	中国海油	31,111.00	0.01
17	01519	极兔速递-W	805,728.35	0.27
18	002594	比亚迪	559,871.00	0.19
18	01211	比亚迪股份	191,935.49	0.06
19	02318	中国平安	609,454.48	0.20
19	601318	中国平安	123,575.00	0.04
20	03988	中国银行	707,376.14	0.24
20	601988	中国银行	18,472.00	0.01

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	00700	腾讯控股	4,448,185.13	1.49
2	00005	汇丰控股	2,979,935.48	1.00
3	00941	中国移动	2,753,717.63	0.92
4	02888	渣打集团	2,541,017.06	0.85
5	01299	友邦保险	1,512,205.09	0.51
6	300750	宁德时代	1,269,010.00	0.42
7	00939	建设银行	1,241,730.88	0.42
8	03690	美团-W	1,187,683.46	0.40
9	000333	美的集团	793,884.00	0.27
10	002594	比亚迪	482,190.51	0.16
10	01211	比亚迪股份	275,299.04	0.09
11	01398	工商银行	752,863.51	0.25
11	601398	工商银行	1,626.00	0.00
12	300760	迈瑞医疗	751,067.00	0.25
13	000858	五粮液	709,324.00	0.24
14	00388	香港交易所	614,334.20	0.21
15	00883	中国海洋石油	607,391.28	0.20
16	03988	中国银行	557,533.66	0.19
17	600028	中国石化	328,344.00	0.11
17	00386	中国石油化工股份	218,035.86	0.07
18	01810	小米集团-W	541,147.68	0.18
19	02318	中国平安	457,509.98	0.15
19	601318	中国平安	20,762.00	0.01

20	300124	汇川技术	476,328.00	0.16
----	--------	------	------------	------

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	70,695,282.44
卖出股票收入（成交）总额	54,950,204.67

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将基于谨慎原则运用股指期货、国债期货相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以控制并降低投资组合风险、提高投资效率，降低跟踪误差，从而更好地实现本基金的投资目标。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金将基于谨慎原则运用股指期货、国债期货相关金融衍生工具对基金投

投资组合进行管理，以控制并降低投资组合风险、提高投资效率，降低跟踪误差，从而更好地实现本基金的投资目标。本基金将充分考虑国债期货流动性和风险收益特征，在风险可控的基础上，以套期保值为目的，参与国债期货的投资，以降低跟踪误差。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局深圳市分局、国家金融监督管理总局深圳监管局、国家金融监督管理总局的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

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

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

### 7.12.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	41,676.78
2	应收清算款	6,170.07
3	应收股利	681,505.74
4	应收利息	—

5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	729,352.59

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未持有流通受限的股票。

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	301566	达利凯普	9,774.72	0.00	新股限售
2	02007	碧桂园	6,200.00	0.00	筹划重大事项
3	301502	华阳智能	5,220.54	0.00	新股限售
4	603082	北自科技	3,155.43	0.00	新股限售
5	603375	盛景微	2,800.80	0.00	新股限售

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
6,011	75,545.19	193,426,947.00	42.60	260,675,178.00	57.40	108,395,000.00	23.87

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

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	BARCLAYS BANK PLC	66,823,448.00	14.72
2	郑州尚之居物业服务有限公司	3,642,100.00	0.80
3	徐亚英	3,500,000.00	0.77
4	薛宏飞	3,500,000.00	0.77
5	北京中洲禾源投资咨询有限公司	3,000,000.00	0.66
6	欧小清	2,937,600.00	0.65
7	枞阳县投资发展有限公司	2,300,000.00	0.51
8	中信建投证券股份有限公司	2,219,561.00	0.49
9	马磊	2,100,000.00	0.46
10	庞彪	1,900,000.00	0.42
11	富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	108,395,000.00	23.87

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

---

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2021年02月09日)基金份额总额	787,102,125.00
报告期期初基金份额总额	440,602,125.00
本报告期基金总申购份额	121,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	108,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	454,102,125.00

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	富国基金管理有限公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2024-02-02
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
受到的具体措施类型	责令改正
受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定及制度未严格执行。
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已完成整改。
其他	—
措施 2	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	督察长
受到稽查或处罚等措施的时间	2024-02-02
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
受到的具体措施类型	出具警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定及制度未严格执行。
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已完成整改。
其他	—

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
长江证券	3	4,936,096.03	3.93	3,632.36	12.82	—
诚通证券	2	—	—	—	—	—
东方证券	2	1,083,764.04	0.86	797.55	2.82	—
东吴证券	2	3,344,589.34	2.66	2,461.17	8.69	—
方正证券	1	—	—	—	—	—
广发证券	2	4,941,465.31	3.94	3,636.11	12.83	—
国盛证券	2	7,454,342.49	5.94	5,485.83	19.36	—
海通证券	2	23,674,689.31	18.86	7,883.11	27.82	—
华泰证券	2	1,677,881.00	1.34	1,234.76	4.36	—
华西证券	2	—	—	—	—	—
民生证券	3	2,509,319.13	2.00	1,846.55	6.52	—
申港证券	2	75,691,492.90	60.31	1,214.38	4.29	—
申万宏源	2	—	—	—	—	—
太平洋证券	2	—	—	—	—	—
银河证券	2	148,789.00	0.12	109.49	0.39	—
浙商证券	2	—	—	—	—	—
中金公司	2	13,794.64	0.01	10.17	0.04	—
中信建投	2	27,747.95	0.02	20.45	0.07	—
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。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易
------	------	--------	------

	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
长江证券	—	—	—	—	—	—
诚通证券	—	—	—	—	—	—
东方证券	—	—	—	—	—	—
东吴证券	—	—	—	—	—	—
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	—	—	—	—	—	—

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	富国基金管理有限公司关于旗下部分基金 2024 年非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告	规定披露媒介	2024年01月02日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	2024-01-01 至 2024-06-30	113,440,900.00	—	5,045,900.00	108,395,000.00	23.87%
产品特有风险							
<p>本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。</p>							

## § 12 备查文件目录

备查文件名称	备查文件存放地点	备查文件查阅方式
1、中国证监会批准设立富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金的文件 2、富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同 3、富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议 4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件 5、富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金财务报表及报表附注 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告	中国(上海)自由贸易试验区 世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费） 公司地址： <a href="http://www.fullgoal.com.cn">http://www.fullgoal.com.cn</a> 。