

富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)

二 0 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： 中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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 .....	9
§4	管理人报告 .....	12
4.1	基金管理人及基金经理情况 .....	12
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	14
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	15
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明 .....	16
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	16
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	17
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	17
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 .....	17
§5	托管人报告 .....	18
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	18
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 .....	18
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 .....	18
§6	中期财务报告（未经审计） .....	19
6.1	资产负债表 .....	19
6.2	利润表 .....	20
6.3	净资产变动表 .....	21
6.4	报表附注 .....	22
§7	投资组合报告 .....	47
7.1	期末基金资产组合情况 .....	47

7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	47
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细.....	48
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	65
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	67
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.....	67
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.....	67
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.....	67
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.....	67
7.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	67
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	67
7.12	投资组合报告附注.....	68
§8	基金份额持有人信息.....	70
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	70
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	70
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	70
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.....	71
§9	开放式基金份额变动.....	72
§10	重大事件揭示.....	73
10.1	基金份额持有人大会决议.....	73
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.....	73
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	73
10.4	基金投资策略的改变.....	73
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	73
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.....	73
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	74
10.8	其他重大事件.....	76
§11	影响投资者决策的其他重要信息.....	77
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.....	77
§12	备查文件目录.....	78



## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)		
基金简称	富国中证 500 指数增强 (LOF)		
场内简称	500 增强 LOF		
基金主代码	161017		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2011 年 10 月 12 日		
基金管理人	富国基金管理有限公司		
基金托管人	中国农业银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	4,770,720,694.34 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	2011 年 10 月 21 日		
下属分级基金的基金简称	富国中证 500 指数增强 (LOF) A/B	富国中证 500 指数增强 (LOF) C	
下属分级基金场内简称	500 增强 LOF	—	
下属分级基金的交易代码	前端	后端	013332
	161017	161021	
报告期末下属分级基金的份额总额	4,197,984,590.52 份		572,736,103.82 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金以“指数化投资为主、主动性投资为辅”，主要策略为复制目标指数，即投资组合将以成份股在目标指数中的基准权重为基础，利用富国定量投资模型在有限范围内进行超配或低配选择。本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。本基金的标的指数、对目标指数的跟踪调整、存托凭证投资策略、债券投资策略、金融衍生工具投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	95%×中证 500 指数收益率+1%(指年收益率，评价时按期间折算)。
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其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。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	富国基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司	
信息披露负责人	姓名	赵瑛	任航
	联系电话	021-20361818	010-66060069
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话	95105686、4008880688	95599	
传真	021-20361616	010-68121816	
注册地址	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层	北京市东城区建国门内大街69号	
办公地址	上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9	
邮政编码	200120	100031	
法定代表人	裴长江	谷澍	

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金中期报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层 中国农业银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	A类：中国证券登记结算有限责任公司；C类：富国基金管理有限公司	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

##### (1) 富国中证 500 指数增强 (LOF) A/B

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	-247,151,737.21
本期利润	-367,302,765.40
加权平均基金份额本期利润	-0.1128
本期加权平均净值利润率	-5.39%
本期基金份额净值增长率	-3.45%
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	4,389,007,216.74
期末可供分配基金份额利润	1.0455
期末基金资产净值	8,586,991,807.26
期末基金份额净值	2.046
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	154.15%

##### (2) 富国中证 500 指数增强 (LOF) C

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	-26,911,170.95
本期利润	-49,831,022.15
加权平均基金份额本期利润	-0.1451
本期加权平均净值利润率	-7.00%
本期基金份额净值增长率	-3.55%
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	592,690,649.55
期末可供分配基金份额利润	1.0348
期末基金资产净值	1,165,426,753.37
期末基金份额净值	2.035
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	-19.57%

注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### (1) 富国中证 500 指数增强 (LOF) A/B

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-4.35%	0.90%	-6.48%	0.91%	2.13%	-0.01%
过去三个月	-3.35%	1.02%	-5.93%	1.09%	2.58%	-0.07%
过去六个月	-3.45%	1.44%	-8.01%	1.53%	4.56%	-0.09%
过去一年	-9.75%	1.15%	-15.88%	1.21%	6.13%	-0.06%
过去三年	-16.35%	1.10%	-23.79%	1.14%	7.44%	-0.04%
自基金合同生效起至今	154.15%	1.45%	47.81%	1.48%	106.34%	-0.03%

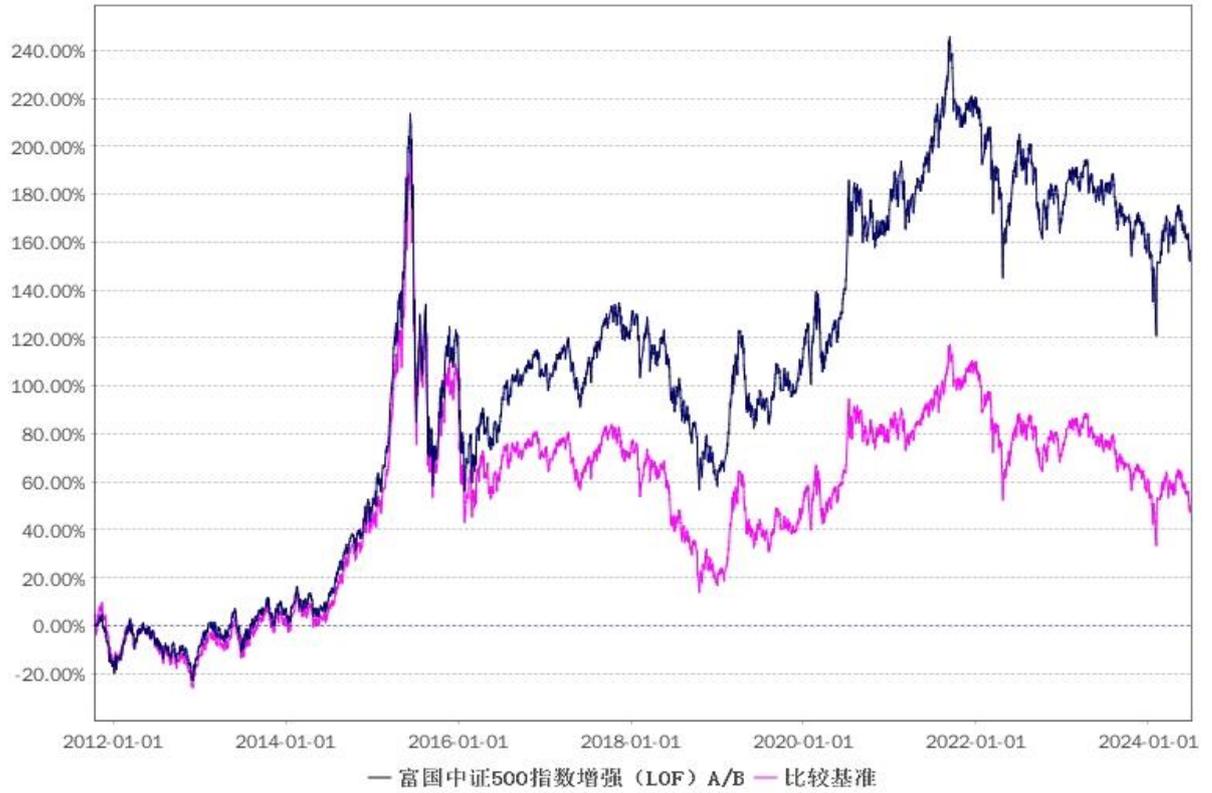
##### (2) 富国中证 500 指数增强 (LOF) C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-4.37%	0.89%	-6.48%	0.91%	2.11%	-0.02%
过去三个月	-3.42%	1.02%	-5.93%	1.09%	2.51%	-0.07%
过去六个月	-3.55%	1.44%	-8.01%	1.53%	4.46%	-0.09%
过去一年	-9.96%	1.15%	-15.88%	1.21%	5.92%	-0.06%
自基金分级生效日起至今	-19.57%	1.11%	-25.35%	1.14%	5.78%	-0.03%

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

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

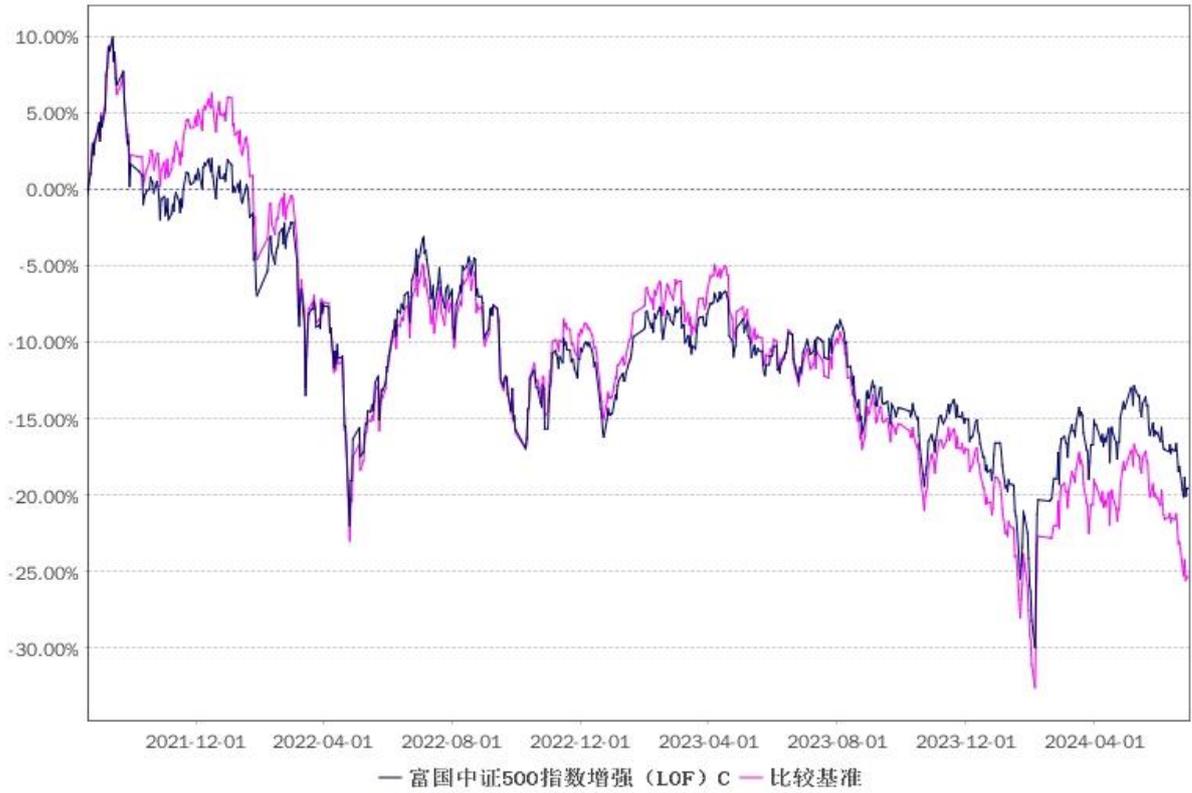
(1) 自基金合同生效以来富国中证 500 指数增强 (LOF) A/B 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2024 年 6 月 30 日。

2、本基金于 2011 年 10 月 12 日成立，建仓期 6 个月，从 2011 年 10 月 12 日起至 2012 年 4 月 11 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

(2) 自基金合同生效以来富国中证 500 指数增强 (LOF) C 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为2024年6月30日。

2、本基金自2021年8月19日起增加C类份额，相关数据按实际存续期计算。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

截至 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		
徐幼华	本基金现任基金经理	2011-10-12	—	19	硕士，曾任上海京华创业投资有限公司投资部经理助理；自 2006 年 7 月加入富国基金管理有限公司，历任助理数量研究员、研究员、基金经理助理、基金经理、量化与海

					外投资部量化投资副总监，量化与海外投资部量化投资总监；现任富国基金量化投资部副总经理，兼任富国基金资深定量基金经理。自2011年05月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金基金经理；自2011年10月起任富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理；自2018年05月起任富国港股通量化精选股票型证券投资基金基金经理；自2018年05月起任富国中证1000指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理；自2018年07月起任富国大盘价值量化精选混合型证券投资基金基金经理；自2018年12月起任富国MSCI中国A股国际通指数增强型证券投资基金基金经理；自2024年04月起任富国MSCI中国A50互联互通增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。
李笑薇	本基金现任基金经理	2011-10-12	—	22	博士，曾任摩根士丹利资本国际Barra公司(MSCIBARRA)高级研究员，巴克莱国际投资管理公司(BarclaysGlobal Investors)大中华主动股票投资总监、高级基金经理及高级研究员；自2009年6月加入富国基金管理有限公司，历任量化与海外投资部总经理、基金经理、公司总经理助理；现任富国基金副总经理，兼任富国基金资深定量基金经理。自2009年12月起任富国沪深300增强证券投资基金基金经理；自2011年10月起任富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理；具有基金从业资格。
方旻	本基金现任基金经理	2014-11-19	—	14	硕士，自2010年2月加入富国基金管理有限公司，历任定量研究员、基金经理助理、基金经理、量化与海外投资部量化投资总监助理、高级定量基金经理、量化投资部量化投资副总监、量化投资部量

					<p>化投资总监；现任富国基金量化投资部量化投资总监兼资深定量基金经理。自 2014 年 11 月起任富国沪深 300 增强证券投资基金基金经理；自 2014 年 11 月起任富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金经理；自 2014 年 11 月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金基金经理；自 2014 年 11 月起任上证综指交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2015 年 10 月起任富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；自 2018 年 05 月起任富国中证 1000 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金经理；自 2019 年 01 月起任富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金基金经理；自 2020 年 02 月起任富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金基金经理；自 2022 年 11 月起任富国中证 1000 优选股票型证券投资基金基金经理；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 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 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 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 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 24 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

2024 年开年以来，国内悲观预期加速释放，海外修正抢跑的降息预期，资金和情绪的负反馈导致市场调整加速。尽管月末超预期降准、地产政策优化以及资本市场政策密集出台使得权重股带领市场短暂反弹，但雪球敲入、私募强制平仓等消息面和资金面负反馈仍在持续。2 月，随着国内经济与政策预期得到重新修正，风险偏好改善驱动市场快速反弹。在海外 AI 技术迎来突破等信息刺激下，A 股迎来大幅反弹，月末沪指成功站上 3000 点。3 月，市场重新进入以景气和政策为驱动的修复期，指数围绕关键点位震荡。经过前期大幅上涨后，投资者关注点重回现实，市场在三月下旬做多动能减弱，沪指一度下挫至 3000 点以下，但月末在政策预期催化下回到 3000 点上。4 月末，美国一季度经济呈现“滞涨”态势，降息预期推后下非美货币普遍贬值，而国内基本面较为稳健，人民币汇率抗跌走出独立行情，中国资产在全球的配置性价比和逻辑开始凸显，引发外资回流。业绩期进入尾声后，内资风险偏好抬升，合力推动沪指突破 3100 点。6 月进入验证期，国内经济复苏再度放缓，PMI 回落枯荣线以下、信用扩张疲软、经济“供强需弱”特征延续。接连落空的预期验证放大悲观情绪，沪指连续调整至 3000 点以下。

总体来看，2024 年上半年上证综指下跌 0.25%，沪深 300 上涨 0.89%，创业板指下跌 10.99%，中证 500 指数下跌 8.96%。

在投资管理上，我们坚持采取量化策略进行投资和风险管理，积极获取超额收益率。

##### 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 A/B 级为 2.046 元，C 级为 2.035 元；份额累计净值 A/B 级为 2.415 元，C 级为 2.035 元；本报告期，本基金份额净值增长率 A/B 级为-3.45%，C 级为-3.55%，同期业绩比较基准收益率 A/B 级为-8.01%，C 级为-8.01%。

#### 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 年下半年，风险偏好有望迎来修复窗口。从国内来看，为完成两会政府工作报告中提出的经济增长目标，下半年相关财政政策及货币政策有望进一

步发力。从海外看，随着美国通胀数据和就业数据持续走弱，美联储开启降息的概率进一步提升，新兴市场资金有望迎来回流，有助于风险偏好的提升。

#### **4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明**

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

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

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

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

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—富国基金管理有限公司 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

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

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

## § 6 中期财务报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)

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	873,321,611.47	466,727,329.98
结算备付金	30,697,091.74	9,080,351.90
存出保证金	1,121,664.35	431,067.96
交易性金融资产	8,861,255,509.28	6,731,740,253.56
其中：股票投资	8,857,756,248.53	6,731,510,546.51
基金投资	—	—
债券投资	3,499,260.75	229,707.05
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	13,397,593.81	152,884.88
应收股利	—	—
应收申购款	4,343,069.73	13,655,126.97
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	9,784,136,540.38	7,221,787,015.25
<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	2,471,385.75	—
应付赎回款	8,930,004.04	7,538,210.31
应付管理人报酬	8,057,450.88	6,130,955.98
应付托管费	1,208,617.64	919,643.39

应付销售服务费	174,900.96	140,018.43
应付投资顾问费	—	—
应交税费	8.57	0.23
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	10,875,611.91	5,670,978.17
负债合计	31,717,979.75	20,399,806.51
<b>净资产：</b>		
实收基金	4,770,720,694.34	3,400,265,532.78
其他综合收益	—	—
未分配利润	4,981,697,866.29	3,801,121,675.96
净资产合计	9,752,418,560.63	7,201,387,208.74
负债和净资产总计	9,784,136,540.38	7,221,787,015.25

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.044 元，基金份额总额 4,770,720,694.34 份。其中：富国中证 500 指数增强（LOF）A/B 份额净值 2.046 元，份额总额 4,197,984,590.52 份；富国中证 500 指数增强（LOF）C 份额净值 2.035 元，份额总额 572,736,103.82 份。

## 6.2 利润表

会计主体：富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)

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>	-372,801,272.48	385,600,090.60
1.利息收入	2,491,584.92	2,099,596.60
其中：存款利息收入	2,491,584.92	2,099,596.60
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	—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）	-233,142,826.37	99,923,779.34
其中：股票投资收益	-345,825,225.84	14,465,380.41
基金投资收益	—	—
债券投资收益	54,450.82	969,917.36

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	112,627,948.65	84,488,481.57
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）	-143,070,879.39	282,046,918.71
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	920,848.36	1,529,795.95
<b>减：二、营业总支出</b>	<b>44,332,515.07</b>	<b>42,269,720.95</b>
1. 管理人报酬	37,326,084.84	35,994,030.99
2. 托管费	5,598,912.78	5,399,104.62
3. 销售服务费	709,439.97	201,945.27
4. 投资顾问费	—	—
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 信用减值损失	—	—
7. 税金及附加	1.15	2.99
8. 其他费用	698,076.33	674,637.08
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-417,133,787.55</b>	<b>343,330,369.65</b>
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-417,133,787.55</b>	<b>343,330,369.65</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>	<b>—</b>	<b>—</b>
<b>六、综合收益总额</b>	<b>-417,133,787.55</b>	<b>343,330,369.65</b>

### 6.3 净资产变动表

会计主体：富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)

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	3,400,265,532.78	3,801,121,675.96	7,201,387,208.74
二、本期期初净资产	3,400,265,532.78	3,801,121,675.96	7,201,387,208.74
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	1,370,455,161.56	1,180,576,190.33	2,551,031,351.89
(一)、综合收益总额	—	-417,133,787.55	-417,133,787.55
(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)	1,370,455,161.56	1,597,709,977.88	2,968,165,139.44

其中：1. 基金申购款	2,090,662,512.03	2,360,078,816.57	4,450,741,328.60
2. 基金赎回款	-720,207,350.47	-762,368,838.69	-1,482,576,189.16
(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	4,770,720,694.34	4,981,697,866.29	9,752,418,560.63
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	3,234,623,934.90	3,764,753,256.01	6,999,377,190.91
二、本期期初净资产	3,234,623,934.90	3,764,753,256.01	6,999,377,190.91
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	12,467,583.23	349,499,981.99	361,967,565.22
(一)、综合收益总额	—	343,330,369.65	343,330,369.65
(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）	12,467,583.23	6,169,612.34	18,637,195.57
其中：1.基金申购款	610,392,917.31	780,327,018.94	1,390,719,936.25
2.基金赎回款	-597,925,334.08	-774,157,406.60	-1,372,082,740.68
(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	3,247,091,518.13	4,114,253,238.00	7,361,344,756.13

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

陈戈

林志松

徐慧

基金管理人  
基金管理人

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 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) (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[2011]1095号《关于核准富国中证500指数增强型证券投资基金（LOF）募集的批复》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2011年10月12日正式生效，首次设立募集规模为455,487,249.88份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。根据基金管理人于2021年8月17日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下部分基金增加C类基金份额并相应修订基金合同及托管协议的公告》，自2021年8月19日起，本基金增加C类份额。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，A类基金份额的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，C类基金份额的注册登记机构为富国基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券、权证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的相关规定。其中，股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产的90%，投资于中证500指数成份股和备选成份股的资产（均含存托凭证）不低于股票资产的80%；保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，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。

本基金业绩比较基准为  $95\% \times \text{中证500指数收益率} + 1\%$ （指年收益率，评价时按期间折算）。

#### **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事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

### 4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置

试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

## 5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

## 6.4.7 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	873,321,611.47
等于：本金	873,155,271.74

加：应计利息	166,339.73
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	873,321,611.47

注：本基金本报告期末未持有定期存款。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末（2024年06月30日）				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	9,347,952,21 8.23	—	8,857,756,24 8.53	— 490,195,969. 70	
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—	
债券	交易所市场	3,499,000.00	260.75	3,499,260.75	—
	银行间市场	—	—	—	—
	合计	3,499,000.00	260.75	3,499,260.75	—
资产支持证券	—	—	—	—	
基金	—	—	—	—	
其他	—	—	—	—	
合计	9,351,451,21 8.23	260.75	8,861,255,50 9.28	— 490,195,969. 70	

#### 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	22,191.01
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	10,094,389.77
其中：交易所市场	10,094,389.77
银行间市场	—
应付利息	—
预提信息披露费	60,000.00
预提审计费	101,813.78
应付指数使用费	597,217.35
合计	10,875,611.91

#### 6.4.7.7 实收基金

富国中证500指数增强（LOF）A/B：

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	3,016,318,242.03	3,016,318,242.03
本期申购	1,529,394,545.03	1,529,394,545.03
本期赎回（以“-”号填列）	-347,728,196.54	-347,728,196.54
本期末	4,197,984,590.52	4,197,984,590.52

富国中证500指数增强（LOF）C：

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	383,947,290.75	383,947,290.75
本期申购	561,267,967.00	561,267,967.00
本期赎回（以“-”号填列）	-372,479,153.93	-372,479,153.93
本期末	572,736,103.82	572,736,103.82

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

富国中证500指数增强（LOF）A/B：

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,027,185,097.91	- 652,211,409.76	3,374,973,688.15
本期期初	4,027,185,097.91	- 652,211,409.76	3,374,973,688.15
本期利润	-247,151,737.21	- 120,151,028.19	-367,302,765.40
本期基金份额交易产生的变动数	1,493,497,226.35	- 112,160,932.36	1,381,336,293.99
其中：基金申购款	1,938,217,883.61	- 190,189,811.21	1,748,028,072.40
基金赎回款	-444,720,657.26	78,028,878.85	-366,691,778.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,273,530,587.05	- 884,523,370.31	4,389,007,216.74

富国中证500指数增强（LOF）C：

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	509,072,000.02	-82,924,012.21	426,147,987.81
本期期初	509,072,000.02	-82,924,012.21	426,147,987.81
本期利润	-26,911,170.95	-22,919,851.20	-49,831,022.15
本期基金份额交易产生的变动数	231,064,162.24	-14,690,478.35	216,373,683.89
其中：基金申购款	705,606,062.98	-93,555,318.81	612,050,744.17
基金赎回款	- 474,541,900.74	78,864,840.46	-395,677,060.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	713,224,991.31	- 120,534,341.76	592,690,649.55

#### 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	2,044,265.67
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	99,079.58
其他	348,239.67
合计	2,491,584.92

#### 6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
卖出股票成交总额	9,615,519,816.29
减：卖出股票成本总额	9,939,078,799.61
减：交易费用	22,266,242.52
买卖股票差价收入	-345,825,225.84

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
债券投资收益——利息收入	314.98
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	54,135.84
合计	54,450.82

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	443,924.37
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	389,700.00
减：应计利息总额	70.79
减：交易费用	17.74
买卖债券差价收入	54,135.84

#### 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	112,627,948.65
其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	—
合计	112,627,948.65

#### 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	-143,070,879.39
股票投资	-143,070,879.39
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	-143,070,879.39

#### 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	916,228.86
基金转换费收入	4,619.50
合计	920,848.36

#### 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	33,813.78
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	—

银行费用	6,764.54
指数使用费	597,217.35
其他	280.66
合计	698,076.33

#### 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

根据本基金管理人于2024年8月23日发布的分红公告，本基金向2024年8月27日在本基金注册登记机构登记在册的富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)A级份额持有人按每10份基金份额派发红利2.37元，C份额持有人按每10份基金份额派发红利2.37元。

截至财务报表批准日，除上述利润分配事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大影响关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东、基金代销机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
富国鑫汇养老目标日期2045五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）	纳入基金管理人合并财务报表合并范围内的证券投资基金

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	1,473,295,066.24	6.75	3,463,804,398.40	15.99
申万宏源	1,428,868,484.76	6.55	3,541,589,589.52	16.34

#### 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

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	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
申万宏源	—	—	1,204,538.77	25.25

注：本基金本报告期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	1,084,205.31	6.75	1,084,205.31	10.74
申万宏源	1,051,496.17	6.55	1,051,496.17	10.42
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	2,498,452.99	15.98	1,406,304.45	18.10
申万宏源	2,555,299.60	16.35	1,599,064.24	20.58

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	37,326,084.84	35,994,030.99
其中：支付销售机构的客户维护费	11,360,215.90	12,078,680.85
应支付基金管理人的净管理费	25,965,868.94	23,915,350.14

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.00% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，按月支付。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（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	5,598,912.78	5,399,104.62

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富国中证500指数增强（LOF）A/B	富国中证500指数增强（LOF）C	合计
富国基金管理有限公司	—	444,680.93	444,680.93
海通证券股份有限公司	—	51.45	51.45
申万宏源证券有限公司	—	836.14	836.14
合计	—	445,568.52	445,568.52

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间（2023年01月01日至2023年06月30日）		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富国中证500指数增强（LOF）A/B	富国中证500指数增强（LOF）C	合计
富国基金管理有限公司	—	114,521.24	114,521.24
海通证券股份有限公司	—	42.24	42.24
申万宏源证券有限公司	—	68.33	68.33
合计	—	114,631.81	114,631.81

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费将专门用于本基金 C 类基金份额的销售与基金份额持有人服务。在通常情况下，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.20% 年费率计提。销售服务费计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

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

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

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

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

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

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

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）	
	富国中证500指数增强（LOF）A/B	富国中证500指数增强（LOF）C	富国中证500指数增强（LOF）A/B	富国中证500指数增强（LOF）C
基金合同生效日（2011年10月12日）持有的基金份额	20,003,333.00	—	20,003,333.00	—
期初持有的基金份额	12,657,866.18	—	12,657,866.18	395.26
期间申购/买入总份额	—	—	—	—
期间因拆分变动份额	—	—	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	—	—	—
期末持有的基金份额	12,657,866.18	—	12,657,866.18	395.26
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.30%	—	0.41%	0.00%

注：本基金管理人投资本基金按照公告的费率条款执行，不存在费率优惠的情况。

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

富国中证 500 指数增强 (LOF) C:

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 (%)
富国鑫汇养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)	3,042,228.40	0.53	3,042,228.40	0.79
富国鑫旺均衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)	—	—	2,489,573.07	0.65

#### 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
中国农业银行股份有限公司	873,321,611.47	2,044,265.67	547,427,445.91	1,943,426.82

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注: 本基金本报告期及上年度可比期间均未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

本基金无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

注: 本基金本报告期未进行利润分配。

#### 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
001359	平安电工	2024-03-19	6个月	新股限售	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	—
001379	腾达科技	2024-01-11	6个月	新股限售	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	—
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	—
001389	广合科技	2024-03-26	6个月	新股限售	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	—
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	—
301538	骏鼎达	2024-03-13	6个月	新股限售	55.82	91.24	107	5,972.74	9,762.68	—
301538	骏鼎达	2024-05-22	4个月	新股限售_转增	—	91.24	43	—	3,923.32	—
301539	宏鑫科技	2024-04-03	6个月	新股限售	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	—
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	—
301580	爱迪特	2024-06-19	6个月	新股限售	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	—
301587	中瑞股份	2024-03-27	6个月	新股限售	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	—
301588	美新科技	2024-03-06	6个月	新股限售	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	—
301591	肯特股份	2024-02-20	6个月	新股限售	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	—
601033	永兴股份	2024-01-11	6个月	新股限售	16.20	15.96	1,258	20,379.60	20,077.68	—
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	—
603285	键邦股份	2024-06-28	1个月内(含)	新股认购	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	—
603285	键邦股份	2024-06-28	6个月	新股限售	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	—
603312	西典新能	2024-01-04	6个月	新股限售	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	—
603341	龙旗科技	2024-02-23	6个月	新股限售	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	—
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	—
603381	永臻股份	2024-06-19	6个月	新股限售	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	—
688584	上海合晶	2024-02-01	6个月	新股限售	22.66	15.89	866	19,623.56	13,760.74	—
688692	达梦数据	2024-06-04	6个月	新股限售	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	—
688695	中创股份	2024-03-06	6个月	新股限售	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	—
688709	成都华微	2024-01-31	6个月	新股限售	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	—

#### 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位: 张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113685	升24转债	2024-06-14	1个月内(含)	认购新发证券	100.00	100.01	34,990	3,499,000.00	3,499,260.75	—

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### **6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

#### **6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

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

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的信用债。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末（2024年06月30日）	上年度末（2023年12月31日）
AAA	—	—
AAA 以下	3,499,260.75	229,707.05
未评级	—	—
合计	3,499,260.75	229,707.05

注：本表主要列示除短融和超短融之外的信用债，债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

#### 6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

#### **6.4.13.4 市场风险**

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

##### **6.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为货币资金、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	873,321,611.47	—	—	—	—	—	873,321,611.47
结算备付金	30,697,091.74	—	—	—	—	—	30,697,091.74
存出保证金	1,121,664.35	—	—	—	—	—	1,121,664.35
交易性金融资产	—	—	3,499,260.75	—	—	8,857,756,248.53	8,861,255,509.28
应收清算款	—	—	—	—	—	13,397,593.81	13,397,593.81
应收申购款	210,156.42	—	—	—	—	4,132,913.31	4,343,069.73
资产总计	905,350,523.98	—	3,499,260.75	—	—	8,875,286,755.65	9,784,136,540.38
负债							
应付清算款	—	—	—	—	—	2,471,385.75	2,471,385.75
应付赎回款	—	—	—	—	—	8,930,004.04	8,930,004.04
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	8,057,450.88	8,057,450.88
应付托管费	—	—	—	—	—	1,208,617.64	1,208,617.64
应付销售服务费	—	—	—	—	—	174,900.96	174,900.96
应交税费	—	—	—	—	—	8.57	8.57
其他负债	—	—	—	—	—	10,875,611.91	10,875,611.91
负债总计	—	—	—	—	—	31,717,979.75	31,717,979.75
利率敏感度缺口	905,350,523.98	—	3,499,260.75	—	—	8,843,568,775.90	9,752,418,560.63
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	466,727,329.98	—	—	—	—	—	466,727,329.98
结算备付金	9,080,351.90	—	—	—	—	—	9,080,351.90
存出保证金	431,067.96	—	—	—	—	—	431,067.96
交易性金融资产	—	—	229,707.05	—	—	6,731,510,546.51	6,731,740,253.56
应收清算款	—	—	—	—	—	152,884.88	152,884.88
应收申购款	168,281.93	—	—	—	—	13,486,845.04	13,655,126.97
资产总计	476,407,031.77	—	229,707.05	—	—	6,745,150,276.43	7,221,787,015.25
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	7,538,210.31	7,538,210.31
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	6,130,955.98	6,130,955.98
应付托管费	—	—	—	—	—	919,643.39	919,643.39
应付销售服务费	—	—	—	—	—	140,018.43	140,018.43
应交税费	—	—	—	—	—	0.23	0.23
其他负债	—	—	—	—	—	5,670,978.17	5,670,978.17
负债总计	—	—	—	—	—	20,399,806.51	20,399,806.51
利率敏感度缺口	476,407,031.77	—	229,707.05	—	—	6,724,750,469.92	7,201,387,208.74

#### 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

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券、权证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的相关规定。其中，股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产的90%，投资于中证500指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的资产不低于股票资产的80%。保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末（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	8,857,756,248.53	90.83	6,731,510,546.51	93.48
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	3,499,260.75	0.04	229,707.05	0.00
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—

衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	8,861,255,509.28	90.86	6,731,740,253.56	93.48

#### 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%	91,426,432.03	67,530,427.20
	2. 业绩比较基准减少1%	-91,426,432.03	-67,530,427.20

#### 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	上年度末
---------------	-----	------

	(2024年06月30日)	(2023年12月31日)
第一层次	8,857,529,976.99	6,725,470,538.53
第二层次	3,533,038.02	5,348,954.93
第三层次	192,494.27	920,760.10
合计	8,861,255,509.28	6,731,740,253.56

#### 6.4.14.2 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	8,857,756,248.53	90.53
	其中：股票	8,857,756,248.53	90.53
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	3,499,260.75	0.04
	其中：债券	3,499,260.75	0.04
	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	904,018,703.21	9.24
8	其他各项资产	18,862,327.89	0.19
9	合计	9,784,136,540.38	100.00

### 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	20,630,766.98	0.21
C	制造业	1,072,329,810.24	11.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,155,008.00	0.06
E	建筑业	6,818,170.00	0.07
F	批发和零售业	18,781,555.00	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	6,224,750.00	0.06
H	住宿和餐饮业	2,584,704.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	377,902,441.14	3.87
J	金融业	17,612,686.40	0.18
K	房地产业	12,010,180.40	0.12
L	租赁和商务服务业	9,748,376.60	0.10
M	科学研究和技术服务业	12,847,946.97	0.13

N	水利、环境和公共设施管理业	20,077.68	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	10,349,970.40	0.11
Q	卫生和社会工作	2,187,341.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	20,411,915.00	0.21
S	综合	—	—
	合计	1,596,615,699.81	16.37

### 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	20,426,295.00	0.21
B	采矿业	410,658,128.00	4.21
C	制造业	4,693,241,181.79	48.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	205,536,439.48	2.11
E	建筑业	15,188,244.00	0.16
F	批发和零售业	169,653,828.61	1.74
G	交通运输、仓储和邮政业	144,119,751.35	1.48
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	567,380,566.61	5.82
J	金融业	702,618,291.44	7.20
K	房地产业	163,329,627.36	1.67
L	租赁和商务服务业	10,042,474.00	0.10
M	科学研究和技术服务业	14,064,769.42	0.14
N	水利、环境和公共设施管理业	3,911,394.00	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	21,813,843.00	0.22
R	文化、体育和娱乐业	112,086,308.58	1.15
S	综合	7,069,406.08	0.07
	合计	7,261,140,548.72	74.45

### 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

#### 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	002078	太阳纸业	8,990,155	125,412,662.25	1.29
2	000630	铜陵有色	33,843,500	122,175,035.00	1.25
3	002128	电投能源	5,647,451	119,161,216.10	1.22

4	002152	广电运通	11,185,394	116,999,221.24	1.20
5	000683	远兴能源	14,981,905	103,524,963.55	1.06
6	600582	天地科技	14,627,970	100,786,713.30	1.03
7	600096	云天化	5,145,100	99,917,842.00	1.02
8	600497	驰宏锌锗	18,704,800	99,883,632.00	1.02
9	300017	网宿科技	12,050,652	95,200,150.80	0.98
10	000830	鲁西化工	8,078,523	93,630,081.57	0.96
11	002532	天山铝业	11,479,600	93,099,556.00	0.95
12	601058	赛轮轮胎	6,556,849	91,795,886.00	0.94
13	600901	江苏金租	18,170,735	91,762,211.75	0.94
14	002273	水晶光电	5,304,176	90,064,908.48	0.92
15	600380	健康元	7,746,013	86,522,965.21	0.89
16	300383	光环新网	10,224,520	86,397,194.00	0.89
17	002064	华峰化学	11,939,234	85,604,307.78	0.88
18	600517	国网英大	18,665,834	80,823,061.22	0.83
19	603228	景旺电子	2,469,649	78,534,838.20	0.81
20	000513	丽珠集团	2,084,896	77,578,980.16	0.80
21	600998	九州通	15,531,302	75,792,753.76	0.78
22	000887	中鼎股份	6,129,403	75,023,892.72	0.77
23	601231	环旭电子	4,626,700	74,258,535.00	0.76
24	600663	陆家嘴	8,248,036	72,747,677.52	0.75
25	601717	郑煤机	4,891,437	72,393,267.60	0.74
26	600521	华海药业	4,095,962	69,836,152.10	0.72
27	601108	财通证券	9,776,557	64,623,041.77	0.66
28	000559	万向钱潮	14,247,908	63,545,669.68	0.65
29	601555	东吴证券	10,618,319	62,648,082.10	0.64
30	600879	航天电子	7,985,623	62,048,290.71	0.64
31	600967	内蒙一机	8,528,409	61,404,544.80	0.63
32	600350	山东高速	6,744,000	59,684,400.00	0.61
33	601608	中信重工	15,330,900	58,410,729.00	0.60
34	002153	石基信息	10,133,912	58,067,315.76	0.60
35	300088	长信科技	12,234,850	57,503,795.00	0.59
36	300601	康泰生物	3,659,305	57,121,751.05	0.59
37	300502	新易盛	524,700	55,382,085.00	0.57
38	002385	大北农	14,276,800	54,965,680.00	0.56
39	002563	森马服饰	9,403,375	54,633,608.75	0.56
40	002065	东华软件	11,803,257	53,350,721.64	0.55
41	600988	赤峰黄金	3,253,400	53,160,556.00	0.55
42	600637	东方明珠	8,701,662	52,906,104.96	0.54
43	002531	天顺风能	5,913,827	52,869,613.38	0.54
44	002465	海格通信	4,908,800	50,855,168.00	0.52

45	300296	利亚德	11,134,589	50,105,650.50	0.51
46	600299	安迪苏	5,164,871	50,099,248.70	0.51
47	600925	苏能股份	9,398,950	47,464,697.50	0.49
48	600739	辽宁成大	5,400,211	45,199,766.07	0.46
49	000050	深天马A	6,147,449	44,753,428.72	0.46
50	601568	北元集团	11,951,810	44,341,215.10	0.45
51	002240	盛新锂能	3,273,700	43,933,054.00	0.45
52	601179	中国西电	5,423,117	43,601,860.68	0.45
53	000598	兴蓉环境	5,783,059	43,488,603.68	0.45
54	002019	亿帆医药	3,335,900	41,231,724.00	0.42
55	600642	申能股份	4,624,870	40,837,602.10	0.42
56	000750	国海证券	14,013,900	40,780,449.00	0.42
57	601077	渝农商行	8,061,400	40,468,228.00	0.41
58	600398	海澜之家	4,271,247	39,466,322.28	0.40
59	000423	东阿阿胶	621,700	38,918,420.00	0.40
60	600066	宇通客车	1,499,130	38,677,554.00	0.40
61	600737	中粮糖业	3,944,520	37,827,946.80	0.39
62	000728	国元证券	5,884,448	35,659,754.88	0.37
63	600481	双良节能	7,573,000	35,365,910.00	0.36
64	601098	中南传媒	2,842,631	35,305,477.02	0.36
65	600699	均胜电子	2,370,619	35,132,573.58	0.36
66	600909	华安证券	8,291,088	34,905,480.48	0.36
67	300136	信维通信	1,771,200	34,680,096.00	0.36
68	600848	上海临港	3,765,740	34,305,891.40	0.35
69	601216	君正集团	9,202,040	33,955,527.60	0.35
70	300001	特锐德	1,637,900	32,954,548.00	0.34
71	600580	卧龙电驱	2,698,068	32,781,526.20	0.34
72	600535	天士力	2,500,580	31,457,296.40	0.32
73	600839	四川长虹	7,004,400	31,449,756.00	0.32
74	603456	九洲药业	2,149,722	29,494,185.84	0.30
75	688063	派能科技	731,948	29,065,655.08	0.30
76	000039	中集集团	3,065,300	28,384,678.00	0.29
77	000883	湖北能源	4,722,000	28,379,220.00	0.29
78	000960	锡业股份	1,819,300	28,180,957.00	0.29
79	000060	中金岭南	6,645,800	28,178,192.00	0.29
80	300438	鹏辉能源	1,534,700	28,146,398.00	0.29
81	601990	南京证券	3,604,000	27,678,720.00	0.28
82	300394	天孚通信	313,020	27,677,228.40	0.28
83	688819	天能股份	1,159,148	27,657,271.28	0.28
84	601019	山东出版	2,339,112	27,648,303.84	0.28
85	600959	江苏有线	10,337,613	27,291,298.32	0.28

86	603185	弘元绿能	1,589,963	27,172,467.67	0.28
87	688169	石头科技	65,716	25,800,101.60	0.26
88	002984	森麒麟	1,070,960	25,799,426.40	0.26
89	300724	捷佳伟创	475,109	25,660,637.09	0.26
90	600062	华润双鹤	1,284,900	25,158,342.00	0.26
91	601577	长沙银行	3,059,705	25,028,386.90	0.26
92	000027	深圳能源	3,362,624	24,547,155.20	0.25
93	601198	东兴证券	3,082,100	24,533,516.00	0.25
94	002683	广东宏大	1,214,700	24,451,911.00	0.25
95	603305	旭升集团	2,269,500	23,965,920.00	0.25
96	000738	航发控制	1,189,945	23,882,196.15	0.24
97	601156	东航物流	1,165,300	23,713,855.00	0.24
98	603379	三美股份	602,200	23,570,108.00	0.24
99	603160	汇顶科技	341,300	23,464,375.00	0.24
100	000563	陕国投A	8,507,930	23,396,807.50	0.24
101	688567	孚能科技	2,437,099	23,396,150.40	0.24
102	001286	陕西能源	2,016,700	23,252,551.00	0.24
103	601233	桐昆股份	1,434,100	22,888,236.00	0.23
104	600416	湘电股份	2,302,200	22,883,868.00	0.23
105	002487	大金重工	985,532	22,548,972.16	0.23
106	002138	顺络电子	816,600	22,423,836.00	0.23
107	600271	航天信息	3,045,554	22,415,277.44	0.23
108	600873	梅花生物	2,226,900	22,313,538.00	0.23
109	688188	柏楚电子	120,761	22,286,442.55	0.23
110	600141	兴发集团	1,166,600	22,258,728.00	0.23
111	603338	浙江鼎力	361,600	21,847,872.00	0.22
112	600704	物产中大	5,021,500	21,793,310.00	0.22
113	002244	滨江集团	3,001,300	21,789,438.00	0.22
114	000932	华菱钢铁	4,857,182	21,517,316.26	0.22
115	600038	中直股份	520,800	21,410,088.00	0.22
116	688525	佰维存储	333,750	21,410,062.50	0.22
117	600390	五矿资本	5,276,124	21,368,302.20	0.22
118	300251	光线传媒	2,518,006	21,176,430.46	0.22
119	688516	奥特维	503,843	21,065,675.83	0.22
120	000519	中兵红箭	1,418,900	20,815,263.00	0.21
121	300207	欣旺达	1,349,300	20,468,881.00	0.21
122	300002	神州泰岳	2,490,500	20,222,860.00	0.21
123	002625	光启技术	1,156,000	20,056,600.00	0.21
124	600361	创新新材	4,956,348	19,974,082.44	0.20
125	002558	巨人网络	2,084,200	19,674,848.00	0.20
126	601598	中国外运	3,460,500	19,482,615.00	0.20

127	688213	思特威	397,460	19,276,810.00	0.20
128	000893	亚钾国际	1,173,900	18,970,224.00	0.19
129	002429	兆驰股份	3,925,300	18,880,693.00	0.19
130	600566	济川药业	593,702	18,826,290.42	0.19
131	600529	山东药玻	740,103	18,754,210.02	0.19
132	000998	隆平高科	1,888,000	18,559,040.00	0.19
133	002945	华林证券	1,852,500	18,487,950.00	0.19
134	688387	信科移动	3,637,185	18,331,412.40	0.19
135	688234	天岳先进	371,085	17,411,308.20	0.18
136	600143	金发科技	2,605,800	17,224,338.00	0.18
137	601000	唐山港	3,656,850	17,187,195.00	0.18
138	601168	西部矿业	949,600	17,045,320.00	0.17
139	600872	中炬高新	727,000	16,495,630.00	0.17
140	600863	内蒙华电	3,483,300	16,162,512.00	0.17
141	002223	鱼跃医疗	428,600	16,115,360.00	0.17
142	002203	海亮股份	2,013,831	16,070,371.38	0.16
143	688772	珠海冠宇	1,071,226	15,961,267.40	0.16
144	601155	新城控股	1,759,800	15,609,426.00	0.16
145	300390	天华新能	907,978	15,599,062.04	0.16
146	002517	恺英网络	1,616,200	15,434,710.00	0.16
147	600707	彩虹股份	2,260,700	15,395,367.00	0.16
148	002044	美年健康	3,991,200	15,086,736.00	0.15
149	002202	金风科技	2,212,500	14,868,000.00	0.15
150	002056	横店东磁	1,131,600	14,111,052.00	0.14
151	601666	平煤股份	1,259,600	14,107,520.00	0.14
152	300595	欧普康视	876,686	13,746,436.48	0.14
153	600377	宁沪高速	1,081,600	13,628,160.00	0.14
154	600079	人福医药	790,400	13,571,168.00	0.14
155	002739	万达电影	1,121,550	13,559,539.50	0.14
156	601158	重庆水务	2,765,500	13,274,400.00	0.14
157	600155	华创云信	2,241,972	13,250,054.52	0.14
158	600325	华发股份	2,021,800	13,141,700.00	0.13
159	300529	健帆生物	474,800	12,919,308.00	0.13
160	600316	洪都航空	772,326	12,843,781.38	0.13
161	603127	昭衍新药	958,846	12,723,886.42	0.13
162	600499	科达制造	1,467,500	12,371,025.00	0.13
163	000009	中国宝安	1,403,700	12,071,820.00	0.12
164	002195	岩山科技	4,769,470	11,971,369.70	0.12
165	603606	东方电缆	234,500	11,445,945.00	0.12
166	600764	中国海防	568,300	11,155,729.00	0.11
167	002831	裕同科技	429,700	10,996,023.00	0.11

168	002926	华西证券	1,667,100	10,986,189.00	0.11
169	688348	昱能科技	182,221	10,751,039.00	0.11
170	600348	华阳股份	1,048,700	10,445,052.00	0.11
171	000066	中国长城	1,136,100	9,940,875.00	0.10
172	002850	科达利	127,500	9,738,450.00	0.10
173	688779	五矿新能	2,099,829	9,722,208.27	0.10
174	000729	燕京啤酒	1,082,082	9,554,784.06	0.10
175	601106	中国一重	4,081,300	9,427,803.00	0.10
176	300763	锦浪科技	224,100	9,331,524.00	0.10
177	600369	西南证券	2,590,800	9,275,064.00	0.10
178	600862	中航高科	489,100	9,185,298.00	0.09
179	600166	福田汽车	4,034,400	9,077,400.00	0.09
180	600060	海信视像	364,300	9,012,782.00	0.09
181	300866	安克创新	124,413	8,859,449.73	0.09
182	002738	中矿资源	323,100	8,659,080.00	0.09
183	688276	百克生物	300,900	8,536,533.00	0.09
184	000825	太钢不锈	2,492,500	8,424,650.00	0.09
185	300212	易华录	499,500	8,406,585.00	0.09
186	601928	凤凰传媒	757,481	8,301,991.76	0.09
187	002268	电科网安	581,900	8,280,437.00	0.08
188	603596	伯特利	210,860	8,202,454.00	0.08
189	688538	和辉光电	4,083,019	8,084,377.62	0.08
190	300699	光威复材	324,180	8,049,389.40	0.08
191	000400	许继电气	233,421	8,032,016.61	0.08
192	600820	隧道股份	1,217,500	7,950,275.00	0.08
193	600765	中航重机	388,500	7,925,400.00	0.08
194	601958	金钼股份	721,600	7,511,856.00	0.08
195	000878	云南铜业	600,500	7,482,230.00	0.08
196	688617	惠泰医疗	16,333	7,449,481.30	0.08
197	002185	华天科技	907,136	7,393,158.40	0.08
198	688561	奇安信	312,700	7,385,974.00	0.08
199	601128	常熟银行	974,977	7,380,575.89	0.08
200	000623	吉林敖东	544,674	7,298,631.60	0.07
201	688349	三一重能	286,701	7,121,652.84	0.07
202	600673	东阳光	1,004,177	7,069,406.08	0.07
203	000987	越秀资本	1,382,933	6,859,347.68	0.07
204	603858	步长制药	452,476	6,855,011.40	0.07
205	600352	浙江龙盛	788,649	6,774,494.91	0.07
206	002340	格林美	1,060,000	6,752,200.00	0.07
207	603883	老百姓	366,793	6,734,319.48	0.07
208	601696	中银证券	735,700	6,680,156.00	0.07

209	600177	雅戈尔	924,424	6,581,898.88	0.07
210	603233	大参林	458,325	6,554,047.50	0.07
211	601615	明阳智能	692,900	6,540,976.00	0.07
212	002414	高德红外	1,108,500	6,529,065.00	0.07
213	688180	君实生物	223,761	6,500,257.05	0.07
214	300253	卫宁健康	1,077,908	6,359,657.20	0.07
215	600885	宏发股份	222,000	6,144,960.00	0.06
216	002939	长城证券	914,400	6,126,480.00	0.06
217	000937	冀中能源	888,232	5,951,154.40	0.06
218	688220	翱捷科技	155,471	5,823,943.66	0.06
219	603345	安井食品	78,300	5,818,473.00	0.06
220	002408	齐翔腾达	1,038,020	5,812,912.00	0.06
221	600549	厦门钨业	334,200	5,764,950.00	0.06
222	000031	大悦城	2,451,066	5,735,494.44	0.06
223	688425	铁建重工	1,543,760	5,681,036.80	0.06
224	301029	怡合达	288,300	5,667,978.00	0.06
225	600095	湘财股份	939,300	5,598,228.00	0.06
226	603688	石英股份	187,597	5,554,747.17	0.06
227	601665	齐鲁银行	1,128,613	5,541,489.83	0.06
228	603218	日月股份	535,486	5,499,441.22	0.06
229	002797	第一创业	1,076,872	5,481,278.48	0.06
230	300677	英科医疗	202,700	5,434,387.00	0.06
231	300009	安科生物	625,065	5,338,055.10	0.05
232	603087	甘李药业	115,100	5,331,432.00	0.05
233	002472	双环传动	241,500	5,317,830.00	0.05
234	002008	大族激光	242,100	5,035,680.00	0.05
235	603939	益丰药房	204,016	5,008,592.80	0.05
236	001203	大中矿业	520,700	5,003,927.00	0.05
237	000921	海信家电	149,600	4,823,104.00	0.05
238	000156	华数传媒	751,353	4,718,496.84	0.05
239	600927	永安期货	419,910	4,681,996.50	0.05
240	601212	白银有色	1,668,800	4,639,264.00	0.05
241	601298	青岛港	485,000	4,636,600.00	0.05
242	002653	海思科	151,000	4,635,700.00	0.05
243	601139	深圳燃气	692,100	4,623,228.00	0.05
244	002028	思源电气	67,800	4,535,820.00	0.05
245	603927	中科软	249,100	4,506,219.00	0.05
246	002439	启明星辰	256,100	4,420,286.00	0.05
247	002353	杰瑞股份	122,000	4,279,760.00	0.04
248	600498	烽火通信	268,055	4,262,074.50	0.04
249	000636	风华高科	321,200	4,194,872.00	0.04

250	601228	广州港	1,366,827	4,168,822.35	0.04
251	600282	南钢股份	781,600	3,892,368.00	0.04
252	600329	达仁堂	118,000	3,822,020.00	0.04
253	600098	广州发展	581,300	3,720,320.00	0.04
254	002444	巨星科技	150,500	3,717,350.00	0.04
255	688520	神州细胞	93,696	3,686,937.60	0.04
256	603589	口子窖	91,900	3,601,561.00	0.04
257	002500	山西证券	765,400	3,597,380.00	0.04
258	000997	新大陆	256,062	3,561,822.42	0.04
259	601997	贵阳银行	664,262	3,500,660.74	0.04
260	601611	中国核建	432,700	3,500,543.00	0.04
261	603444	吉比特	19,600	3,488,996.00	0.04
262	603517	绝味食品	225,100	3,466,540.00	0.04
263	603882	金域医学	127,000	3,453,130.00	0.04
264	600500	中化国际	985,600	3,439,744.00	0.04
265	300285	国瓷材料	189,400	3,380,790.00	0.03
266	300003	乐普医疗	224,186	3,326,920.24	0.03
267	300861	美畅股份	171,800	3,324,330.00	0.03
268	003031	中瓷电子	71,340	3,298,761.60	0.03
269	603298	杭叉集团	163,841	3,217,837.24	0.03
270	688029	南微医学	51,589	3,175,818.84	0.03
271	601966	玲珑轮胎	171,200	3,144,944.00	0.03
272	603568	伟明环保	152,800	3,144,624.00	0.03
273	688114	华大智造	65,300	3,095,873.00	0.03
274	002865	钧达股份	77,459	2,972,876.42	0.03
275	688390	固德威	51,900	2,912,628.00	0.03
276	600977	中国电影	268,000	2,883,680.00	0.03
277	002508	老板电器	129,900	2,870,790.00	0.03
278	603712	七一二	152,400	2,772,156.00	0.03
279	002756	永兴材料	76,700	2,744,326.00	0.03
280	300765	新诺威	108,600	2,739,978.00	0.03
281	002261	拓维信息	246,400	2,727,648.00	0.03
282	600563	法拉电子	35,100	2,673,918.00	0.03
283	002430	杭氧股份	120,100	2,672,225.00	0.03
284	601636	旗滨集团	412,800	2,662,560.00	0.03
285	600755	厦门国贸	369,000	2,645,730.00	0.03
286	600801	华新水泥	190,000	2,612,500.00	0.03
287	000785	居然之家	1,074,600	2,611,278.00	0.03
288	603529	爱玛科技	92,350	2,523,925.50	0.03
289	000958	电投产融	686,200	2,511,492.00	0.03
290	000818	航锦科技	110,600	2,442,048.00	0.03

291	601828	美凯龙	957,400	2,441,370.00	0.03
292	002966	苏州银行	320,900	2,406,750.00	0.02
293	603156	养元饮品	112,200	2,386,494.00	0.02
294	603728	鸣志电器	59,200	2,381,616.00	0.02
295	000703	恒逸石化	334,200	2,369,478.00	0.02
296	002595	豪迈科技	61,900	2,362,723.00	0.02
297	300037	新宙邦	82,720	2,362,483.20	0.02
298	300058	蓝色光标	430,900	2,344,096.00	0.02
299	300487	蓝晓科技	55,300	2,309,328.00	0.02
300	002368	太极股份	101,400	2,286,570.00	0.02
301	600827	百联股份	309,100	2,281,158.00	0.02
302	600511	国药股份	74,000	2,278,460.00	0.02
303	000032	深桑达A	152,000	2,276,960.00	0.02
304	601991	大唐发电	738,500	2,222,885.00	0.02
305	600985	淮北矿业	132,100	2,211,354.00	0.02
306	000778	新兴铸管	629,500	2,190,660.00	0.02
307	300558	贝达药业	65,900	2,145,045.00	0.02
308	600373	中文传媒	144,400	2,142,896.00	0.02
309	300114	中航电测	47,000	2,126,750.00	0.02
310	600399	抚顺特钢	364,000	2,049,320.00	0.02
311	603000	人民网	99,600	1,991,004.00	0.02
312	603658	安图生物	43,000	1,981,010.00	0.02
313	002518	科士达	111,600	1,975,320.00	0.02
314	002294	信立泰	73,700	1,962,631.00	0.02
315	301267	华夏眼科	94,100	1,949,752.00	0.02
316	000959	首钢股份	710,500	1,932,560.00	0.02
317	601567	三星医疗	54,200	1,897,000.00	0.02
318	600598	北大荒	149,500	1,867,255.00	0.02
319	600928	西安银行	570,600	1,865,862.00	0.02
320	600109	国金证券	245,400	1,852,770.00	0.02
321	002497	雅化集团	202,600	1,807,192.00	0.02
322	300748	金力永磁	136,600	1,770,336.00	0.02
323	300803	指南针	48,500	1,765,885.00	0.02
324	603786	科博达	26,800	1,719,220.00	0.02
325	002409	雅克科技	26,700	1,679,697.00	0.02
326	600435	北方导航	193,200	1,665,384.00	0.02
327	002867	周大生	126,800	1,656,008.00	0.02
328	300395	菲利华	53,800	1,654,350.00	0.02
329	600859	王府井	139,700	1,640,078.00	0.02
330	300568	星源材质	199,600	1,636,720.00	0.02
331	000401	冀东水泥	392,477	1,593,456.62	0.02

332	600808	马钢股份	757,580	1,530,311.60	0.02
333	002025	航天电器	32,051	1,486,525.38	0.02
334	002262	恩华药业	62,600	1,486,124.00	0.02
335	600970	中材国际	121,100	1,460,466.00	0.01
336	600528	中铁工业	197,300	1,444,236.00	0.01
337	688301	奕瑞科技	12,040	1,387,369.20	0.01
338	600032	浙江新能	186,200	1,355,536.00	0.01
339	300676	华大基因	38,300	1,340,883.00	0.01
340	600763	通策医疗	24,500	1,324,225.00	0.01
341	300024	机器人	125,600	1,223,344.00	0.01
342	603826	坤彩科技	41,440	1,200,516.80	0.01
343	300682	朗新集团	140,900	1,199,059.00	0.01
344	000933	神火股份	57,400	1,161,202.00	0.01
345	002608	江苏国信	149,798	1,160,934.50	0.01
346	301236	软通动力	32,581	1,147,177.01	0.01
347	600118	中国卫星	51,000	1,133,730.00	0.01
348	603225	新风鸣	71,100	1,108,449.00	0.01
349	002155	湖南黄金	61,200	1,107,720.00	0.01
350	300474	景嘉微	17,400	1,100,202.00	0.01
351	688521	芯原股份	40,950	1,095,412.50	0.01
352	688107	安路科技	42,816	1,088,382.72	0.01
353	600131	国网信通	64,400	1,086,428.00	0.01
354	000723	美锦能源	227,600	1,083,376.00	0.01
355	300144	宋城演艺	133,000	1,067,990.00	0.01
356	600867	通化东宝	123,900	1,037,043.00	0.01
357	300604	长川科技	37,800	1,027,026.00	0.01
358	600315	上海家化	57,400	1,020,572.00	0.01
359	600126	杭钢股份	233,700	960,507.00	0.01
360	300357	我武生物	46,100	932,142.00	0.01
361	601866	中远海发	340,800	879,264.00	0.01
362	601162	天风证券	370,600	807,908.00	0.01
363	300070	碧水源	183,000	766,770.00	0.01
364	002557	洽洽食品	27,000	761,130.00	0.01
365	600968	海油发展	183,100	754,372.00	0.01
366	603056	德邦股份	56,400	738,840.00	0.01
367	002958	青农商行	270,300	724,404.00	0.01
368	600655	豫园股份	138,900	715,335.00	0.01
369	600546	山煤国际	40,400	590,648.00	0.01
370	300776	帝尔激光	10,965	503,951.40	0.01
371	002384	东山精密	22,260	460,782.00	0.00
372	002432	九安医疗	9,800	397,292.00	0.00

373	600884	杉杉股份	42,100	341,852.00	0.00
374	002791	坚朗五金	11,900	307,853.00	0.00
375	688536	思瑞浦	2,287	223,691.47	0.00
376	688006	杭可科技	5,000	87,250.00	0.00

**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	000725	京东方A	20,725,300	84,766,477.00	0.87
2	600050	中国联通	17,448,200	82,006,540.00	0.84
3	600941	中国移动	691,529	74,339,367.50	0.76
4	601728	中国电信	11,159,800	68,632,770.00	0.70
5	601766	中国中车	8,612,450	64,679,499.50	0.66
6	000100	TCL 科技	12,814,550	55,358,856.00	0.57
7	301011	华立科技	2,635,170	40,607,969.70	0.42
8	002422	科伦药业	1,237,490	37,533,071.70	0.38
9	688510	航亚科技	1,560,669	28,731,916.29	0.29
10	600219	南山铝业	6,550,700	24,958,167.00	0.26
11	600089	特变电工	1,733,380	24,041,980.60	0.25
12	601311	骆驼股份	2,825,761	22,662,603.22	0.23
13	600183	生益科技	1,050,700	22,127,742.00	0.23
14	603258	电魂网络	1,295,822	20,927,525.30	0.21
15	300378	鼎捷软件	1,196,401	19,465,444.27	0.20
16	002446	盛路通信	3,261,900	18,429,735.00	0.19
17	300122	智飞生物	646,400	18,118,592.00	0.19
18	300674	宇信科技	1,571,500	17,412,220.00	0.18
19	301308	江波龙	183,296	17,365,463.04	0.18
20	603119	浙江荣泰	914,574	16,206,251.28	0.17
21	002466	天齐锂业	540,000	16,151,400.00	0.17
22	000975	山金国际	974,162	15,869,098.98	0.16
23	603605	珀莱雅	142,827	15,852,368.73	0.16
24	688408	中信博	169,479	15,605,626.32	0.16
25	300783	三只松鼠	700,300	15,315,561.00	0.16
26	002847	盐津铺子	356,032	15,227,488.64	0.16
27	002371	北方华创	46,500	14,874,885.00	0.15
28	000902	新洋丰	1,203,600	14,286,732.00	0.15
29	002925	盈趣科技	1,096,005	13,886,383.35	0.14
30	688147	微导纳米	550,791	13,714,695.90	0.14
31	300433	蓝思科技	739,600	13,497,700.00	0.14
32	002334	英威腾	2,143,078	12,815,606.44	0.13

33	601369	陕鼓动力	1,522,300	12,208,846.00	0.13
34	002276	万马股份	1,581,400	11,338,638.00	0.12
35	003000	劲仔食品	938,400	11,307,720.00	0.12
36	600487	亨通光电	711,900	11,226,663.00	0.12
37	688798	艾为电子	185,100	10,480,362.00	0.11
38	000526	学大教育	168,019	10,349,970.40	0.11
39	600458	时代新材	1,008,000	10,180,800.00	0.10
40	000810	创维数字	1,155,300	9,912,474.00	0.10
41	603096	新经典	555,900	9,394,710.00	0.10
42	002555	三七互娱	696,400	9,088,020.00	0.09
43	000550	江铃汽车	400,500	8,694,855.00	0.09
44	000157	中联重科	1,105,100	8,487,168.00	0.09
45	002252	上海莱士	1,072,900	8,390,078.00	0.09
46	601801	皖新传媒	1,205,500	8,354,115.00	0.09
47	688439	振华风光	125,563	8,343,661.35	0.09
48	300316	晶盛机电	282,200	8,107,606.00	0.08
49	002139	拓邦股份	761,900	8,091,378.00	0.08
50	002550	千红制药	1,495,100	8,058,589.00	0.08
51	002601	龙佰集团	427,600	7,940,532.00	0.08
52	002706	良信股份	1,156,900	7,936,334.00	0.08
53	601137	博威合金	496,200	7,562,088.00	0.08
54	603520	司太立	792,600	7,561,404.00	0.08
55	300363	博腾股份	627,400	7,497,430.00	0.08
56	300559	佳发教育	748,800	7,166,016.00	0.07
57	000541	佛山照明	1,435,100	6,988,937.00	0.07
58	688095	福昕软件	152,560	6,988,773.60	0.07
59	688361	中科飞测	145,696	6,891,420.80	0.07
60	603019	中科曙光	164,100	6,810,150.00	0.07
61	301004	嘉益股份	74,835	6,809,985.00	0.07
62	002765	蓝黛科技	1,430,100	6,721,470.00	0.07
63	688369	致远互联	420,060	6,607,543.80	0.07
64	601800	中国交建	733,900	6,561,066.00	0.07
65	688031	星环科技	175,820	6,454,352.20	0.07
66	300857	协创数据	112,200	6,395,400.00	0.07
67	600161	天坛生物	256,993	6,270,629.20	0.06
68	688036	传音控股	81,700	6,253,318.00	0.06
69	688105	诺唯赞	310,867	6,220,448.67	0.06
70	600362	江西铜业	257,700	6,102,336.00	0.06
71	002777	久远银海	396,000	5,936,040.00	0.06
72	603195	公牛集团	76,819	5,924,281.28	0.06
73	600556	天下秀	1,601,700	5,830,188.00	0.06

74	688009	中国通号	926,233	5,557,398.00	0.06
75	002609	捷顺科技	731,200	5,542,496.00	0.06
76	300687	赛意信息	396,400	5,517,888.00	0.06
77	688313	仕佳光子	558,500	5,316,920.00	0.05
78	002241	歌尔股份	270,600	5,279,406.00	0.05
79	002380	科远智慧	276,200	5,054,460.00	0.05
80	300562	乐心医疗	537,100	4,785,561.00	0.05
81	600482	中国动力	240,900	4,692,732.00	0.05
82	688568	中科星图	98,074	4,678,129.80	0.05
83	603569	长久物流	616,700	4,230,562.00	0.04
84	002745	木林森	510,500	4,114,630.00	0.04
85	001914	招商积余	387,800	3,885,756.00	0.04
86	300773	拉卡拉	311,600	3,873,188.00	0.04
87	300679	电连技术	95,500	3,841,965.00	0.04
88	300371	汇中股份	454,900	3,807,513.00	0.04
89	601328	交通银行	505,700	3,777,579.00	0.04
90	300492	华图山鼎	39,800	3,749,160.00	0.04
91	603866	桃李面包	737,428	3,738,759.96	0.04
92	000553	安道麦 A	814,739	3,698,915.06	0.04
93	002237	恒邦股份	318,400	3,664,784.00	0.04
94	600480	凌云股份	370,200	3,639,066.00	0.04
95	600007	中国国贸	161,500	3,546,540.00	0.04
96	601600	中国铝业	459,271	3,504,237.73	0.04
97	000338	潍柴动力	213,991	3,475,213.84	0.04
98	002594	比亚迪	13,800	3,453,450.00	0.04
99	300226	上海钢联	201,400	3,411,716.00	0.03
100	600795	国电电力	568,400	3,404,716.00	0.03
101	603583	捷昌驱动	165,140	3,365,553.20	0.03
102	002283	天润工业	781,700	3,353,493.00	0.03
103	601012	隆基绿能	236,200	3,311,524.00	0.03
104	603501	韦尔股份	33,100	3,289,147.00	0.03
105	688766	普冉股份	32,420	3,150,251.40	0.03
106	603337	杰克股份	119,600	3,147,872.00	0.03
107	300308	中际旭创	22,456	3,096,233.28	0.03
108	301291	明阳电气	101,800	3,059,090.00	0.03
109	300451	创业慧康	842,650	2,915,569.00	0.03
110	688023	安恒信息	69,740	2,790,297.40	0.03
111	688028	沃尔德	169,400	2,783,242.00	0.03
112	600900	长江电力	95,100	2,750,292.00	0.03
113	601512	中新集团	358,200	2,729,484.00	0.03
114	300059	东方财富	252,900	2,670,624.00	0.03

115	688680	海优新材	92,000	2,644,080.00	0.03
116	600926	杭州银行	200,200	2,612,610.00	0.03
117	601319	中国人保	506,300	2,607,445.00	0.03
118	601007	金陵饭店	406,400	2,584,704.00	0.03
119	600160	巨化股份	102,500	2,473,325.00	0.03
120	688007	光峰科技	152,900	2,461,690.00	0.03
121	600875	东方电气	132,594	2,446,359.30	0.03
122	600562	国睿科技	176,800	2,415,088.00	0.02
123	002212	天融信	495,600	2,413,572.00	0.02
124	688563	航材股份	45,500	2,406,040.00	0.02
125	603267	鸿远电子	69,800	2,380,180.00	0.02
126	600826	兰生股份	437,920	2,356,009.60	0.02
127	688076	诺泰生物	29,723	2,326,716.44	0.02
128	002544	普天科技	121,500	2,270,835.00	0.02
129	600522	中天科技	142,300	2,255,455.00	0.02
130	002475	立讯精密	56,800	2,232,808.00	0.02
131	300364	中文在线	102,900	2,220,582.00	0.02
132	301260	格力博	158,300	2,156,046.00	0.02
133	603309	维力医疗	195,000	2,146,950.00	0.02
134	603977	国泰集团	206,300	2,098,071.00	0.02
135	600519	贵州茅台	1,400	2,054,346.00	0.02
136	688078	龙软科技	87,474	2,014,526.22	0.02
137	600548	深高速	187,600	1,994,188.00	0.02
138	000063	中兴通讯	70,400	1,969,088.00	0.02
139	000837	秦川机床	267,500	1,968,800.00	0.02
140	002410	广联达	198,700	1,903,546.00	0.02
141	603809	豪能股份	222,900	1,801,032.00	0.02
142	688578	艾力斯	27,819	1,773,183.06	0.02
143	300872	天阳科技	133,300	1,766,225.00	0.02
144	002027	分众传媒	286,700	1,737,402.00	0.02
145	001270	铖昌科技	47,100	1,729,512.00	0.02
146	300636	同和药业	169,200	1,720,764.00	0.02
147	688278	特宝生物	31,600	1,692,180.00	0.02
148	000408	藏格矿业	70,100	1,687,307.00	0.02
149	301033	迈普医学	42,600	1,666,086.00	0.02
150	603579	荣泰健康	107,470	1,661,486.20	0.02
151	688253	英诺特	43,000	1,638,730.00	0.02
152	603439	贵州三力	128,400	1,638,384.00	0.02
153	600690	海尔智家	57,200	1,623,336.00	0.02
154	688222	成都先导	142,500	1,617,375.00	0.02
155	605155	西大门	176,552	1,615,450.80	0.02

156	605589	圣泉集团	78,800	1,598,852.00	0.02
157	300769	德方纳米	56,400	1,590,480.00	0.02
158	688506	百利天恒	8,700	1,578,180.00	0.02
159	301102	兆讯传媒	133,500	1,573,965.00	0.02
160	688235	百济神州	13,500	1,563,840.00	0.02
161	300573	兴齐眼药	9,480	1,554,720.00	0.02
162	601838	成都银行	102,000	1,549,380.00	0.02
163	688336	三生国健	75,800	1,542,530.00	0.02
164	600559	老白干酒	84,800	1,541,664.00	0.02
165	688016	心脉医疗	15,492	1,518,990.60	0.02
166	688352	硕中科技	130,700	1,491,287.00	0.02
167	688048	长光华芯	47,600	1,487,024.00	0.02
168	603303	得邦照明	129,240	1,483,675.20	0.02
169	002332	仙琚制药	129,500	1,477,595.00	0.02
170	688711	宏微科技	90,972	1,461,010.32	0.01
171	000999	华润三九	34,300	1,460,494.00	0.01
172	688223	晶科能源	205,000	1,455,500.00	0.01
173	688232	新点软件	69,500	1,370,540.00	0.01
174	603919	金徽酒	73,000	1,326,410.00	0.01
175	605007	五洲特纸	104,900	1,324,887.00	0.01
176	600489	中金黄金	87,690	1,297,812.00	0.01
177	600572	康恩贝	286,900	1,282,443.00	0.01
178	600732	爱旭股份	141,700	1,282,385.00	0.01
179	603212	赛伍技术	116,000	1,280,640.00	0.01
180	601607	上海医药	66,700	1,274,637.00	0.01
181	601865	福莱特	63,200	1,270,320.00	0.01
182	603619	中曼石油	54,200	1,269,364.00	0.01
183	600446	金证股份	127,100	1,262,103.00	0.01
184	002001	新 和 成	64,200	1,232,640.00	0.01
185	002600	领益智造	170,100	1,211,112.00	0.01
186	600557	康缘药业	74,800	1,174,360.00	0.01
187	601939	建设银行	158,200	1,170,680.00	0.01
188	600547	山东黄金	42,200	1,155,436.00	0.01
189	688136	科兴制药	68,400	1,146,384.00	0.01
190	002533	金杯电工	115,200	1,146,240.00	0.01
191	600383	金地集团	328,946	1,118,416.40	0.01
192	000516	国际医学	236,900	1,108,692.00	0.01
193	603214	爱婴室	98,100	1,107,549.00	0.01
194	002841	视源股份	35,400	1,045,362.00	0.01
195	002192	融捷股份	32,800	984,656.00	0.01
196	002020	京新药业	93,300	976,851.00	0.01

197	688315	诺禾致源	88,800	969,696.00	0.01
198	300294	博雅生物	29,300	966,900.00	0.01
199	688690	纳微科技	54,300	943,191.00	0.01
200	603806	福斯特	63,560	934,332.00	0.01
201	001309	德明利	10,800	933,120.00	0.01
202	688117	圣诺生物	38,000	932,520.00	0.01
203	300660	江苏雷利	35,700	911,064.00	0.01
204	600810	神马股份	144,900	898,380.00	0.01
205	301239	普瑞眼科	25,300	893,849.00	0.01
206	000567	海德股份	155,440	872,018.40	0.01
207	688733	壹石通	57,796	864,050.20	0.01
208	688728	格科微	70,200	850,122.00	0.01
209	603169	兰石重装	188,300	847,350.00	0.01
210	600779	水井坊	22,400	842,912.00	0.01
211	600363	联创光电	30,600	842,112.00	0.01
212	601688	华泰证券	67,800	840,042.00	0.01
213	300855	图南股份	31,600	835,504.00	0.01
214	688206	概伦电子	54,960	816,156.00	0.01
215	600019	宝钢股份	118,000	784,700.00	0.01
216	605166	聚合顺	73,400	769,966.00	0.01
217	002648	卫星化学	42,500	764,150.00	0.01
218	605116	奥锐特	30,000	750,900.00	0.01
219	002697	红旗连锁	156,600	725,058.00	0.01
220	688233	神工股份	37,331	719,368.37	0.01
221	301018	申菱环境	36,900	717,336.00	0.01
222	002032	苏泊尔	14,100	706,410.00	0.01
223	688609	九联科技	78,500	692,370.00	0.01
224	002938	鹏鼎控股	17,200	683,872.00	0.01
225	600415	小商品城	90,200	669,284.00	0.01
226	300638	广和通	39,000	666,900.00	0.01
227	601336	新华保险	21,900	657,657.00	0.01
228	600406	国电南瑞	26,000	648,960.00	0.01
229	688141	杰华特	39,300	635,088.00	0.01
230	601166	兴业银行	34,800	613,176.00	0.01
231	603518	锦泓集团	67,400	593,120.00	0.01
232	300760	迈瑞医疗	1,900	552,729.00	0.01
233	000682	东方电子	50,000	552,000.00	0.01
234	603355	莱克电气	25,000	540,000.00	0.01
235	300463	迈克生物	45,548	518,336.24	0.01
236	600760	中航沈飞	12,871	516,127.10	0.01
237	600312	平高电气	23,300	453,185.00	0.00

238	601900	南方传媒	35,600	442,508.00	0.00
239	688581	安杰思	7,840	383,611.20	0.00
240	000002	万科A	55,300	383,229.00	0.00
241	002291	遥望科技	85,700	368,510.00	0.00
242	000811	冰轮环境	37,900	365,735.00	0.00
243	603368	柳药集团	20,500	358,750.00	0.00
244	600989	宝丰能源	18,975	328,836.75	0.00
245	603916	苏博特	44,500	298,595.00	0.00
246	688707	振华新材	30,348	295,589.52	0.00
247	600346	恒力石化	21,100	294,345.00	0.00
248	600641	万业企业	24,100	283,175.00	0.00
249	688133	泰坦科技	17,826	281,294.28	0.00
250	601500	通用股份	47,160	251,834.40	0.00
251	600919	江苏银行	32,500	241,475.00	0.00
252	688768	容知日新	9,432	220,803.12	0.00
253	002123	梦网科技	30,000	210,900.00	0.00
254	300997	欢乐家	17,500	206,850.00	0.00
255	300244	迪安诊断	15,400	184,800.00	0.00
256	002129	TCL中环	20,400	176,460.00	0.00
257	688800	瑞可达	6,156	172,860.48	0.00
258	603678	火炬电子	7,000	172,830.00	0.00
259	605499	东鹏饮料	800	172,600.00	0.00
260	600104	上汽集团	12,000	166,320.00	0.00
261	601886	江河集团	32,200	157,136.00	0.00
262	600718	东软集团	17,300	143,071.00	0.00
263	300366	创意信息	16,400	118,736.00	0.00
264	002761	浙江建投	12,800	99,968.00	0.00
265	300181	佐力药业	5,300	80,136.00	0.00
266	688484	南芯科技	2,100	77,910.00	0.00
267	605088	冠盛股份	3,300	68,772.00	0.00
268	300369	绿盟科技	12,800	65,408.00	0.00
269	600266	城建发展	17,000	63,580.00	0.00
270	603725	天安新材	9,200	57,132.00	0.00
271	603993	洛阳钼业	6,400	54,400.00	0.00
272	603590	康辰药业	1,800	45,972.00	0.00
273	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
274	688496	清越科技	3,168	29,272.32	0.00
275	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
276	601033	永兴股份	1,258	20,077.68	0.00
277	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
278	002284	亚太股份	2,400	16,224.00	0.00

279	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
280	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
281	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
282	688033	天宜上佳	2,200	13,200.00	0.00
283	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
284	688238	和元生物	2,154	9,973.02	0.00
285	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
286	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
287	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
288	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
289	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
290	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
291	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
292	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
293	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
294	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
295	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
296	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
297	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
298	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
299	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
300	603918	金桥信息	100	1,045.00	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	600839	四川长虹	146,885,252.00	2.04
2	300017	网宿科技	121,987,215.00	1.69
3	000830	鲁西化工	107,447,110.64	1.49
4	002078	太阳纸业	101,689,991.59	1.41
5	601555	东吴证券	100,998,426.00	1.40
6	601058	赛轮轮胎	99,685,834.33	1.38
7	000683	远兴能源	98,815,792.75	1.37
8	600096	云天化	94,094,622.86	1.31
9	601766	中国中车	91,727,704.00	1.27
10	002422	科伦药业	91,304,696.17	1.27
11	600941	中国移动	88,837,588.10	1.23
12	002532	天山铝业	87,825,113.00	1.22
13	002064	华峰化学	86,324,088.48	1.20
14	002273	水晶光电	86,321,648.00	1.20

15	600663	陆家嘴	83,597,582.68	1.16
16	600580	卧龙电驱	81,556,072.32	1.13
17	000887	中鼎股份	81,203,049.53	1.13
18	601179	中国西电	78,188,733.57	1.09
19	600050	中国联通	77,793,402.44	1.08
20	600521	华海药业	77,750,250.00	1.08

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600839	四川长虹	129,046,813.20	1.79
2	002422	科伦药业	124,362,957.76	1.73
3	600489	中金黄金	107,904,650.00	1.50
4	002600	领益智造	95,682,366.00	1.33
5	600066	宇通客车	95,512,855.65	1.33
6	600580	卧龙电驱	84,482,436.00	1.17
7	601600	中国铝业	84,450,709.00	1.17
8	000878	云南铜业	78,286,438.61	1.09
9	000338	潍柴动力	77,390,708.00	1.07
10	000009	中国宝安	74,983,819.53	1.04
11	002185	华天科技	71,470,390.34	0.99
12	300017	网宿科技	68,071,365.98	0.95
13	601179	中国西电	66,193,462.00	0.92
14	000021	深科技	62,187,047.24	0.86
15	000975	山金国际	60,198,934.00	0.84
16	688223	晶科能源	59,643,203.15	0.83
17	002028	思源电气	58,938,698.03	0.82
18	600418	江淮汽车	58,375,279.73	0.81
19	601168	西部矿业	55,696,664.00	0.77
20	605358	立昂微	55,414,259.24	0.77

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	12,208,395,381.02
卖出股票收入（成交）总额	9,615,519,816.29

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交

金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	3,499,260.75	0.04
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	3,499,260.75	0.04

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113685	升24转债	34,990	3,499,260.75	0.04

## 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

本基金根据基金合同的约定，不允许投资股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，鲁西化工集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到聊城高新技术产业开发区管理委员会的处罚。

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

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

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

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,121,664.35
2	应收清算款	13,397,593.81
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	4,343,069.73
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	18,862,327.89

#### 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**

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中未持有流通受限股票。

#### **7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
富国中证 500 指数增强 (LOF) A/B	568,233	7,387.79	1,629,071,063.57	38.81	2,568,913,526.95	61.19
富国中证 500 指数增强 (LOF) C	15,218	37,635.44	518,412,765.63	90.52	54,323,338.19	9.48
合计	583,451	8,176.73	2,147,483,829.20	45.01	2,623,236,865.14	54.99

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

富国中证 500 指数增强 (LOF) A/B

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	合肥黄山大厦酒店管理集团有限公司	748,920.00	1.18
2	吴林萍	707,463.00	1.11
3	范伟	600,000.00	0.94
4	丁飞	597,700.00	0.94
5	厦门市营嘉系统集成技术有限公司	583,358.00	0.92
6	陈阳	500,000.00	0.79
7	董理	404,400.00	0.64
8	孙选艳	401,718.00	0.63
9	唐文萍	382,700.00	0.60
10	李宏伟	362,575.00	0.57

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	富国中证 500 指数增强 (LOF) A/B	1,459,099.93	0.0348
	富国中证 500 指数增强 (LOF) C	80,359.49	0.0140
	合计	1,539,459.42	0.0323

#### 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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资 和研究部门负责人持有本开放式 基金	富国中证 500 指数 增强 (LOF) A/B	50~100
	富国中证 500 指数 增强 (LOF) C	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基 金	富国中证 500 指数 增强 (LOF) A/B	0~10
	富国中证 500 指数 增强 (LOF) C	0
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	富国中证 500 指数增强 (LOF) A/B	富国中证 500 指数增强 (LOF) C
基金合同生效日(2011 年 10 月 12 日)基金份额总额	455,487,249.88	—
报告期期初基金份额总额	3,016,318,242.03	383,947,290.75
本报告期基金总申购份额	1,529,394,545.03	561,267,967.00
减：本报告期基金总赎回份额	347,728,196.54	372,479,153.93
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	4,197,984,590.52	572,736,103.82

## § 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：无

## 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 (%)	
德邦证券	1	—	—	—	—	—
东北证券	2	96,013.51	0.00	70.65	0.00	—
东方证券	4	1,729,488,251.10	7.93	1,272,741.60	7.93	—
国海证券	2	7,827,313,180.05	35.87	5,760,101.76	35.87	—
国联证券	1	1,015,009,768.79	4.65	746,984.83	4.65	—
国泰君安	2	762,550,158.95	3.49	561,160.76	3.49	—
国投证券	2	246,436,375.84	1.13	181,358.15	1.13	—
海通证券	1	1,473,295,066.24	6.75	1,084,205.31	6.75	—
华兴证券	1	—	—	—	—	—
汇丰前海	2	—	—	—	—	—
开源证券	4	493,691,303.19	2.26	363,306.85	2.26	—
申万宏源	4	1,428,868,484.76	6.55	1,051,496.17	6.55	—
兴业证券	2	972,584,637.39	4.46	715,731.80	4.46	—
浙商证券	1	333,649,107.09	1.53	245,536.44	1.53	—
中泰证券	1	1,232,923,610.69	5.65	907,291.12	5.65	—
中信建投	2	—	—	—	—	—
中信证券	3	4,306,521,062.75	19.73	3,169,095.22	19.73	—

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)

德邦证券	—	—	—	—	—	—
东北证券	—	—	—	—	—	—
东方证券	249,275.03	56.15	—	—	—	—
国海证券	—	—	—	—	—	—
国联证券	—	—	—	—	—	—
国泰君安	—	—	—	—	—	—
国投证券	—	—	—	—	—	—
海通证券	—	—	—	—	—	—
华兴证券	—	—	—	—	—	—
汇丰前海	—	—	—	—	—	—
开源证券	—	—	—	—	—	—
申万宏源	—	—	—	—	—	—
兴业证券	—	—	—	—	—	—
浙商证券	—	—	—	—	—	—
中泰证券	194,649.34	43.85	—	—	—	—
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	关于富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	规定披露媒介	2024年06月14日
2	关于富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)恢复大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	规定披露媒介	2024年06月27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
机构	1	2024-05-28 至 2024-06-30	—	973,770 ,682.86	4,737, 091.43	969,033,591 .43	20.31%
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 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 的文件 2、富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金合同 3、富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 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 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 财务报表及报表附注 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告	中国(上海)自由贸易试验区 世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	投资者对本报告书如有疑问, 可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。咨询电话: 95105686、4008880688 (全国统一, 免长途话费) 公司 网 址 : <a href="http://www.fullgoal.com.cn">http://www.fullgoal.com.cn</a> 。