

富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)

二 0 二二年中期报告

2022 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： 2022 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 2022 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 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§2	基金简介	6
2.1	基金基本情况	6
2.2	基金产品说明	6
2.3	基金管理人和基金托管人	7
2.4	信息披露方式	7
2.5	其他相关资料	7
§3	主要财务指标、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	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	15
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	17
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	18
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	18
§5	托管人报告	19
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	19
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	19
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	19
§6	中期财务报告（未经审计）	20
6.1	资产负债表	20
6.2	利润表	21
6.3	净资产（基金净值）变动表	23
6.4	报表附注	24
§7	投资组合报告	52
7.1	期末基金资产组合情况	52

7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	52
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.....	53
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	68
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	69
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.....	70
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.....	70
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.....	70
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.....	70
7.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	70
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	70
7.12	投资组合报告附注.....	70
§8	基金份额持有人信息.....	72
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	72
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	72
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	72
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.....	72
§9	开放式基金份额变动.....	74
§10	重大事件揭示.....	75
10.1	基金份额持有人大会决议.....	75
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.....	75
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	75
10.4	基金投资策略的改变.....	75
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	75
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.....	75
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	76
10.8	其他重大事件.....	78
§11	影响投资者决策的其他重要信息.....	79
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.....	79
§12	备查文件目录.....	80

§ 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 (单位:份)	3,328,947,790.67		
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 A	富国中证 500 指数增强 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 (单位:份)	3,282,062,783.10		46,885,007.57

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	秦一楠
	联系电话	021-20361818	010-66060069
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		95105686、4008880688	95599
传真		021-20361616	010-63201816
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		200120	100031
法定代表人		裴长江	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

(1) 富国中证 500 指数增强 A

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022年01月01日至2022年06月30日)
本期已实现收益	-438,041,086.20
本期利润	-479,753,742.08
加权平均基金份额本期利润	-0.1495
本期加权平均净值利润率	-6.41%
本期基金份额净值增长率	-6.05%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年06月30日)
期末可供分配利润	4,671,841,585.64
期末可供分配基金份额利润	1.4234
期末基金资产净值	7,953,904,368.74
期末基金份额净值	2.423
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年06月30日)
基金份额累计净值增长率	200.98%

(2) 富国中证 500 指数增强 C

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022年01月01日至2022年06月30日)
本期已实现收益	-9,893,089.84
本期利润	12,034,876.65
加权平均基金份额本期利润	0.2285
本期加权平均净值利润率	10.06%
本期基金份额净值增长率	-6.17%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年06月30日)
期末可供分配利润	66,597,558.65
期末可供分配基金份额利润	1.4204
期末基金资产净值	113,482,566.22
期末基金份额净值	2.420
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年06月30日)
基金份额累计净值增长率	-4.35%

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 A

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	8.27%	1.04%	6.83%	1.05%	1.44%	-0.01%
过去三个月	4.17%	1.59%	2.24%	1.66%	1.93%	-0.07%
过去六个月	-6.05%	1.49%	-11.22%	1.55%	5.17%	-0.06%
过去一年	-0.94%	1.25%	-3.89%	1.26%	2.95%	-0.01%
过去三年	56.33%	1.28%	33.00%	1.28%	23.33%	0.00%
自基金合同生效起至今	200.98%	1.52%	86.40%	1.55%	114.58%	-0.03%

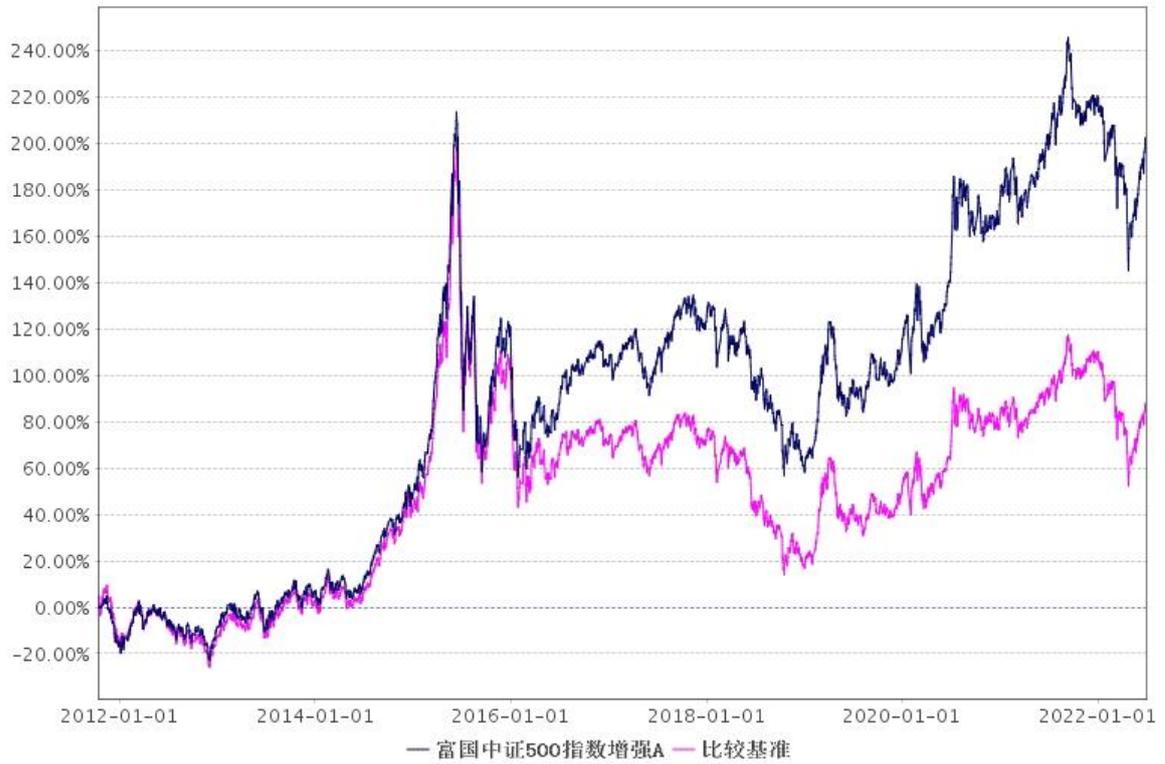
(2) 富国中证 500 指数增强 C

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	8.23%	1.05%	6.83%	1.05%	1.40%	0.00%
过去三个月	4.09%	1.59%	2.24%	1.66%	1.85%	-0.07%
过去六个月	-6.17%	1.49%	-11.22%	1.55%	5.05%	-0.06%
自基金分级生效日起至今	-4.35%	1.28%	-5.86%	1.30%	1.51%	-0.02%

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

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

(1) 自基金合同生效以来富国中证 500 指数增强 A 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2022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 2022 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

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国际信托股份有限公司。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 2022 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、富国中证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、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 267 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）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		
方旻	本基金基金经理	2014-11-19	—	12.4	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

					<p>化与海外投资部量化投资总监助理、量化投资部量化投资副总监；现任富国基金量化投资部量化投资总监兼高级定量基金经理。2014年4月至2014年11月任富国中证500指数增强型证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国沪深300增强证券投资基金基金经理助理，2014年11月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国沪深300增强证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金和富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理，2015年5月至2019年11月任富国创业板指数分级证券投资基金、富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金及富国中证银行指数型证券投资基金（原富国中证银行指数分级证券投资基金，于2019年5月10日更名）基金经理，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，2017年6月至2018年12月任富国新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理，2017年7月至2020年9月任富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）基金经理，2018年5月起任富国中证1000指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理，2018年7月至2020年9月任富国大盘价值量化精选混合型证券投资基金基金经理，2019年1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，2020年2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。具有基金从业资格。</p>
李笑薇	本基金基金经理	2011-10-12	—	19.2	<p>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</p>

					<p>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。2011 年 1 月至 2012 年 5 月任上证综指交易型开放式指数证券投资基金、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，2009 年 12 月至今任富国沪深 300 增强证券投资基金基金经理，2011 年 10 月至今任富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理。具有中国基金从业资格。</p>
徐幼华	本基金基金经理	2011-10-12	—	17.0	<p>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，兼任富国基金量化投资部资深定量基金经理。2011 年 5 月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金基金经理，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，2015 年 6 月至 2017 年 12 月任富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金基金经理，2016 年 11 月至 2020 年 1 月任富国中证医药主题指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理，2015 年 6 月至 2017 年 11 月任富国中证煤炭指数分级证券投资基金、富国中证体育产业指数分级证券投资基金基金经理，2017 年 3 月至 2020 年 1 月任富国中证娱乐主题指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理，2017 年 4 月至 2020 年 1 月任富国中证高端制造指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理，2018</p>

					<p>年5月起任富国港股通量化精选股票型证券投资基金、富国中证1000指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理，2018年7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，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。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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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13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

2022年伊始，随着美国加息预期升温，全球流动性面临收紧，市场风格出现切换，前期表现强势的成长赛道如新能源、锂电池、军工等板块均迎来大幅调整，稳增长板块表现较强。2月下旬，随着俄乌冲突加剧，布伦特原油价格持续走高，投资者对经济滞胀担忧加大，全球股市均出现较大幅度的调整。3月中旬，SEC将5家中国公司列入《外国公司问责法》的暂定清单，投资者对中概股从纳斯达克退市的担忧加剧，中概股和港股互联网公司均迎来一轮大幅回调，A股也出现外资大幅流出的情况。随着国务院金融稳定发展委员会召开专题会议研究当前经济形势和资本市场问题，对市场关切的问题如宏观经济运行、房地产、中概股、平台经济等均做出积极务实的回应，投资者信心获得提振，A股应声上涨。4月以来，随着上海疫情持续扩散，汽车、半导体等产业链生产受到较大冲击，市场对

于经济增长的担忧持续加大，A股整体再次出现大幅调整。4月底，经过短期大幅调整后，A股投资性价比显现，同时政治局会议再次强调稳增长目标，市场信心有所恢复，A股迎来快速反弹。进入5月，稳增长政策进一步发力：国务院部署稳经济一揽子措施，涉及财政、金融、消费、投资等共6方面33项措施，努力推动经济回归正常轨道、确保运行在合理区间；央行召开全系统货币信贷形势分析会，部署落实稳定信贷增长工作措施，下调五年期以上LPR报价15bp。5月、6月国内政策环境明显改善，市场信心得到有效改善，汽车、光伏、半导体等前期受疫情影响较大的板块迎来大幅反弹，稳增长板块表现相对较弱。

总体来看，2022年上半年上证综指下跌6.63%，沪深300下跌9.22%，创业板指下跌15.41%，中证500指数下跌12.3%。

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2022年6月30日，本基金份额净值A/B级为2.423元，C级为2.420元；份额累计净值A/B级为2.792元，C级为2.420元；本报告期，本基金份额净值增长率A/B级为-6.05%，C级为-6.17%，同期业绩比较基准收益率A/B级为-11.22%，C级为-11.22%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，经过5、6月的快速上涨后，市场或将进入基本面验证期。从宏观层面来看，国内稳增长依旧稳步推进，但受美联储持续大幅加息的影响，全球或面临经济衰退预期的冲击。从资金面来看，随着复工复产的推进，前期在金融市场空转的资金或将部分流出，市场资金利率将有所提升。随着中报季来临，市场进入基本面验证期，预计波动加大，行业配置方面或需更加均衡一些。

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 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：2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2022 年 06 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	561,282,222.03	616,071,726.78
结算备付金	14,699,212.77	14,615,643.94
存出保证金	618,905.57	983,176.87
交易性金融资产	7,501,016,310.53	7,618,108,326.11
其中：股票投资	7,500,915,791.59	7,609,880,501.71
基金投资	—	—
债券投资	100,518.94	8,227,824.40
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	28,202,387.61	—
应收股利	—	—
应收申购款	20,304,902.17	10,088,434.22
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	143,865.62
资产总计	8,126,123,940.68	8,260,011,173.54
负债和净资产	本期末 2022 年 06 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付清算款	—	—
应付赎回款	42,332,510.17	17,954,212.04
应付管理人报酬	6,434,265.59	6,833,453.74
应付托管费	965,139.81	1,025,018.06

应付销售服务费	37,516.54	6,489.00
应付投资顾问费	—	—
应交税费	1.12	12.93
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	8,967,572.49	8,061,814.70
负债合计	58,737,005.72	33,881,000.47
净资产：		
实收基金	3,328,947,790.67	3,189,071,554.36
其他综合收益	—	—
未分配利润	4,738,439,144.29	5,037,058,618.71
净资产合计	8,067,386,934.96	8,226,130,173.07
负债和净资产总计	8,126,123,940.68	8,260,011,173.54

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.423 元，基金份额总额 3,328,947,790.67 份。其中：富国中证 500 指数增强 A 份额净值 2.423 元，份额总额 3,282,062,783.10 份；富国中证 500 指数增强 C 份额净值 2.420 元，份额总额 46,885,007.57 份。

比较数据已根据本年《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）》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年度末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年度末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

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：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日)	上年度可比期间 (2021 年 01 月 01 日 至 2021 年 06 月 30 日)
一、营业总收入	-423,559,291.90	616,382,128.47
1.利息收入	2,357,140.04	1,439,673.20

其中：存款利息收入	2,357,140.04	1,437,997.85
债券利息收入	—	1,675.35
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	—	—
证券出借利息收入	—	—
其他利息收入	—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）	-408,880,778.90	404,648,553.31
其中：股票投资收益	-497,998,958.21	355,894,491.52
基金投资收益	—	—
债券投资收益	1,267,692.40	1,394,805.04
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	87,850,486.91	47,359,256.75
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益	—	—
其他投资收益	—	—
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-19,784,689.39	206,543,110.56
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	2,749,036.35	3,750,791.40
减：二、营业总支出	44,159,573.53	37,318,162.44
1. 管理人报酬	37,688,115.10	24,205,125.90
2. 托管费	5,653,217.24	3,630,768.89
3. 销售服务费	115,213.57	—
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	1.31	1.48
8. 其他费用	703,026.31	9,482,266.17
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-467,718,865.43	579,063,966.03
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-467,718,865.43	579,063,966.03
五、其他综合收益的税后净额	—	—
六、综合收益总额	-467,718,865.43	579,063,966.03

注：比较数据已根据本年《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）》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（基金净值）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：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 (2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日)		
	实收基金	未分配 利润	净资产 合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	3,189,071,554.36	5,037,058,618.71	8,226,130,173.07
加：会计政策变更	—	—	—
二、本期期初净资产 (基金净值)	3,189,071,554.36	5,037,058,618.71	8,226,130,173.07
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	139,876,236.31	-298,619,474.42	-158,743,238.11
(一)、综合收益总额	—	-467,718,865.43	-467,718,865.43
(二)、本期基金份额交 易产生的基金净值变 动数(净值减少以“-” 号填列)	139,876,236.31	169,099,391.01	308,975,627.32
其中：1. 基金申购款	1,157,488,803.27	1,503,049,956.27	2,660,538,759.54
2. 基金赎回款	—	—	—
	1,017,612,566.96	1,333,950,565.26	2,351,563,132.22
(三)、本期向基金份额 持有人分配利润产生 的基金净值变动(净值 减少以“-”号填列)	—	—	—
(四)、其他综合收益结 转留存收益	—	—	—
四、本期期末净资产 (基金净值)	3,328,947,790.67	4,738,439,144.29	8,067,386,934.96
项目	上年度可比期间 (2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日)		
	实收基金	未分配 利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	2,302,352,158.75	2,766,707,349.51	5,069,059,508.26
加：会计政策变更	—	—	—
二、本期期初净资产 (基金净值)	2,302,352,158.75	2,766,707,349.51	5,069,059,508.26
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	113,358,309.94	727,330,704.76	840,689,014.70

(一)、综合收益总额	—	579,063,966.03	579,063,966.03
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	113,358,309.94	148,266,738.73	261,625,048.67
其中：1.基金申购款	1,347,351,048.38	1,728,719,106.36	3,076,070,154.74
2.基金赎回款	—	—	—
	1,233,992,738.44	1,580,452,367.63	2,814,445,106.07
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	—	—	—
(四)、其他综合收益结转留存收益	—	—	—
四、本期期末净资产 (基金净值)	2,415,710,468.69	3,494,038,054.27	5,909,748,522.96

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 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, 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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、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。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产

的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

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

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

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

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

以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

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

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

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

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

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

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

6.4.4.3 收入/(损失)的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对

于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日（2022年1月1日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币616,071,726.78元，自应收利息转入的重分类金额为人民币135,445.48元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币616,207,172.26元。

结算备付金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币14,615,643.94元，自应收利息转入的重分类金额为人民币7,234.81元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币14,622,878.75元。

存出保证金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币983,176.87元，自应收利息转入的重分类金额为人民币486.75元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币983,663.62元。

应收利息于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币143,865.62元，转出至银行存款的重分类金额为人民币135,445.48元，转出至

结算备付金的重分类金额为人民币 7,234.81 元,转出至存出保证金的重分类金额为人民币 486.75 元,转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 698.58 元。经上述重分类后,应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产:

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 7,618,108,326.11 元,自应收利息转入的重分类金额为人民币 698.58 元。经上述重分类后,交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 7,618,109,024.69 元。

除上述财务报表项目外,于首次执行日,新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日,新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1 印花税

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值

税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 (2022年06月30日)
活期存款	561,282,222.03
等于：本金	561,154,504.47
加：应计利息	127,717.56
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	561,282,222.03

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(2022年06月30日)				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	7,265,565,95 0.87	—	7,500,915,79 1.59	235,349,840. 72	
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—	
债券	交易所市场	100,500.00	18.94	100,518.94	—
	银行间市场	—	—	—	—
	合计	100,500.00	18.94	100,518.94	—
资产支持证券	—	—	—	—	
基金	—	—	—	—	
其他	—	—	—	—	
合计	7,265,666,45 0.87	18.94	7,501,016,31 0.53	235,349,840. 72	

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（2022年06月30日）
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	153,350.06
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	7,703,734.97
其中：交易所市场	7,703,734.97
银行间市场	—
应付利息	—
预提信息披露费	60,000.00
预提审计费	113,720.30
应付指数使用费	936,767.16
合计	8,967,572.49

6.4.7.7 实收基金

富国中证500指数增强A：

金额单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,177,163,202.38	3,177,163,202.38
本期申购	1,010,804,667.52	1,010,804,667.52
本期赎回（以“-”号填列）	-905,905,086.80	-905,905,086.80
本期末	3,282,062,783.10	3,282,062,783.10

富国中证500指数增强C：

金额单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	11,908,351.98	11,908,351.98
本期申购	146,684,135.75	146,684,135.75
本期赎回（以“-”号填列）	-111,707,480.16	-111,707,480.16
本期末	46,885,007.57	46,885,007.57

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 A:

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	5,057,545,476.56	-39,290,676.25	5,018,254,800.31
本期利润	-438,041,086.20	-41,712,655.88	-479,753,742.08
本期基金份额交易产生的变动数	150,394,270.89	-17,053,743.48	133,340,527.41
其中：基金申购款	1,552,394,080.32	-	1,323,189,883.02
基金赎回款	-	229,204,197.30	-
	1,401,999,809.43	212,150,453.82	1,189,849,355.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,769,898,661.25	-98,057,075.61	4,671,841,585.64

富国中证 500 指数增强 C:

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	18,950,917.09	-147,098.69	18,803,818.40
本期利润	-9,893,089.84	21,927,966.49	12,034,876.65
本期基金份额交易产生的变动数	58,947,342.45	-	35,758,863.60
其中：基金申购款	221,996,055.47	-	179,860,073.25
基金赎回款	-	42,135,982.22	-
	163,048,713.02	18,947,503.37	-144,101,209.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	68,005,169.70	-1,407,611.05	66,597,558.65

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年06月30日）
活期存款利息收入	2,223,193.02
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	77,238.61
其他	56,708.41
合计	2,357,140.04

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年06月30日）
卖出股票成交总额	6,764,345,849.26
减：卖出股票成本总额	7,241,627,985.95
减：交易费用	20,716,821.52
买卖股票差价收入	-497,998,958.21

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（2022年01月01日至2022年06月30日）
债券投资收益——利息收入	2,095.41
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	1,265,596.99
合计	1,267,692.40

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（2022年01月01日至2022年06月30日）
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	9,226,392.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	7,958,000.00
减：应计利息总额	2,785.89
减：交易费用	9.12
债券投资收益-差价收入	1,265,596.99

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。

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（2022年01月01日至2022年06月30日）
股票投资产生的股利收益	87,850,486.91
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	87,850,486.91

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2022年01月01日至2022年06月30日）
1. 交易性金融资产	-19,784,689.39
股票投资	-19,264,864.99
债券投资	-519,824.40
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	-19,784,689.39

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年06月30日）
基金赎回费收入	2,742,414.21
转换费收入	6,622.14
合计	2,749,036.35

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（2022年01月01日至2022年06月30日）
审计费用	33,720.30
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	—

银行费用	6,296.19
指数使用费	603,009.82
合计	703,026.31

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
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	基金托管人、基金代销机构
海通期货有限公司（“海通期货”）	基金管理人的股东控制的子公司、基金代销机构

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（2022年01月01日至2022年06月30日）		上年度可比期间（2021年01月01日至2021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	889,625,605.32	6.40	280,092,406.87	4.70
申万宏源	1,236,376,150.23	8.89	527,663,606.91	8.85

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 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（2022年01月01日至2022年06月30日）			
	佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
申万宏源	1,134,734.67	8.91	809,333.65	10.51
海通证券	814,480.73	6.40	450,262.45	5.84
关联方名称	上年度可比期间（2021年01月01日至2021年06月30日）			
	佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
申万宏源	481,178.48	8.85	367,584.27	9.95
海通证券	255,248.73	4.70	34,026.88	0.92

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年06月30日）	上年度可比期间（2021年01月01日至2021年06月30日）
当期发生的基金应支付的管理费	37,688,115.10	24,205,125.90
其中：支付销售机构的客户维护费	10,860,803.55	6,839,661.69

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（2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日）	上年度可比期间（2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日）
当期发生的基金应支付的托管费	5,653,217.24	3,630,768.89

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

金额单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期（2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日）		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富国中证 500 指数增强 A	富国中证 500 指数增强 C	合计
富国基金管理有限公司	—	59,335.83	59,335.83
海通期货股份有限公司	—	25.92	25.92
海通证券股份有限公司	—	2.19	2.19
合计	—	59,363.94	59,363.94

注：自 2021 年 8 月 19 日起，本基金增加收取销售服务费的 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费将专门用于本基金 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 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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（2022年01月01日至2022年06月30日）		上年度可比期间（2021年01月01日至2021年06月30日）	
	富国中证500指数增强A	富国中证500指数增强C	富国中证500指数增强A	富国中证500指数增强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	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	395.26	—	—
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.39%	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。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.5 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（2022年01月01日至2022年06月30日）		上年度可比期间（2021年01月01日至2021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	561,282,222.03	2,223,193.02	574,982,446.69	1,344,092.86

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 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（2022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
002382	蓝帆医疗	2022-01-07	6个月	大宗交易限售	14.75	9.49	423,840	6,251,640.00	4,022,241.60	—
002624	完美世界	2022-06-29	6个月	大宗交易限售	12.86	13.23	1,800,000	23,148,000.00	23,814,000.00	—
300834	星辉环材	2022-01-06	6个月	新股限售	55.57	30.03	635	35,286.95	19,069.05	—
301109	军信股份	2022-04-06	6个月	新股限售	34.81	16.14	1,225	42,642.25	19,771.50	—
301109	军信股份	2022-06-17	4个月	新股限售_转增	—	16.14	613	—	9,893.82	—
301120	新特电气	2022-04-11	6个月	新股限售	13.73	15.49	1,032	14,169.36	15,985.68	—
301123	奕东电子	2022-01-14	6个月	新股限售	37.23	25.39	656	24,422.88	16,655.84	—
301150	中一科技	2022-04-14	6个月	新股限售	163.56	82.76	269	43,997.64	22,262.44	—
301150	中一科技	2022-06-10	5个月	新股限售_转增	—	82.76	135	—	11,172.60	—
301158	德石股份	2022-01-07	6个月	新股限售	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02	—
301162	国能日新	2022-04-19	6个月	新股限售	45.13	54.11	334	15,073.42	18,072.74	—
301181	标榜股份	2022-02-11	6个月	新股限售	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63	—
301196	唯科科技	2022-01-04	6个月	新股限售	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92	—
301200	大族数控	2022-02-18	6个月	新股限售	76.56	51.92	857	65,611.92	44,495.44	—
301201	诚达药业	2022-01-12	6个月	新股限售	72.69	71.54	353	25,659.57	25,253.62	—
301206	三元生物	2022-01-26	6个月	新股限售	109.30	45.69	630	68,859.00	28,784.70	—
301206	三元生物	2022-06-17	2个月	新股限售_转增	—	45.69	315	—	14,392.35	—

301219	腾远钴业	2022-03-10	6 个月	新股限售	173.98	87.82	321	55,847.58	28,190.22	—
301219	腾远钴业	2022-05-24	4 个月	新股限售 转增	—	87.82	257	—	22,569.74	—
301235	华康医疗	2022-01-21	6 个月	新股限售	39.30	37.93	418	16,427.40	15,854.74	—
600155	华创阳安	2022-04-08	6 个月	大宗交易 限售	8.71	8.03	1,600,000	13,936,000.00	12,848,000.00	—
601778	晶科科技	2022-06-20	6 个月	大宗交易 限售	5.00	5.03	2,200,000	11,000,000.00	11,066,000.00	—
603866	桃李面包	2022-06-30	6 个月	大宗交易 限售	14.91	15.44	670,000	9,989,700.00	10,344,800.00	—
688048	长光华芯	2022-03-25	6 个月	新股限售	80.80	111.97	6,790	548,632.00	760,276.30	—
688170	德龙激光	2022-04-22	6 个月	新股限售	30.18	47.04	6,175	186,361.50	290,472.00	—
688209	英集芯	2022-04-12	6 个月	新股限售	24.23	27.58	6,822	165,297.06	188,150.76	—
688325	赛微微电	2022-04-15	6 个月	新股限售	74.55	53.89	4,039	301,107.45	217,661.71	—

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
127064	杭氧转债	2022-05-19	2 个月	认购新发 证券	100.00	100.02	1,005	100,500.00	100,518.94	—

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
002670	国盛金控	2022 年 06 月 01 日	筹划重大事项	9.60	2022 年 07 月 14 日	9.99	84,300.00	1,002,732.98	809,280.00	—

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 2022 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 2022 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，故不在下表进行列示。

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（2022年06月30日）	上年度末（2021年12月31日）
AAA	—	6,955,079.20
AAA 以下	100,518.94	1,272,745.20
未评级	—	—

合计	100,518.94	8,227,824.40
----	------------	--------------

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

6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，

其余均能及时变现。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

单位：人民币元

本期末（2022年06月30日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	561,282,222.03	—	—	—	—	—	561,282,222.03
结算备付金	14,699,212.77	—	—	—	—	—	14,699,212.77
存出保证金	618,905.57	—	—	—	—	—	618,905.57
交易性金融资产	—	—	100,518.94	—	—	7,500,915,791.59	7,501,016,310.53
应收清算款	—	—	—	—	—	28,202,387.61	28,202,387.61
应收申购款	324,319.74	—	—	—	—	19,980,582.43	20,304,902.17
资产总计	576,924,660.11	—	100,518.94	—	—	7,549,098,761.63	8,126,123,940.68
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	42,332,510.17	42,332,510.17
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	6,434,265.59	6,434,265.59
应付托管费	—	—	—	—	—	965,139.81	965,139.81
应付销售服务费	—	—	—	—	—	37,516.54	37,516.54
应交税费	—	—	—	—	—	1.12	1.12
其他负债	—	—	—	—	—	8,967,572.49	8,967,572.49
负债总计	—	—	—	—	—	58,737,005.72	58,737,005.72
利率敏感度缺口	576,924,660.11	—	100,518.94	—	—	7,490,361,755.91	8,067,386,934.96
上年度末（2021年12月31日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	616,071,726.78	—	—	—	—	—	616,071,726.78

结算备付金	14,615,643.94	—	—	—	—	—	14,615,643.94
存出保证金	983,176.87	—	—	—	—	—	983,176.87
交易性金融资产	—	—	8,227,824.40	—	—	7,609,880,501.71	7,618,108,326.11
应收申购款	292,061.67	—	—	—	—	9,796,372.55	10,088,434.22
其他资产	—	—	—	—	—	143,865.62	143,865.62
资产总计	631,962,609.26	—	8,227,824.40	—	—	7,619,820,739.88	8,260,011,173.54
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	17,954,212.04	17,954,212.04
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	6,833,453.74	6,833,453.74
应付托管费	—	—	—	—	—	1,025,018.06	1,025,018.06
应付销售服务费	—	—	—	—	—	6,489.00	6,489.00
应交税费	—	—	—	—	—	12.93	12.93
其他负债	—	—	—	—	—	8,061,814.70	8,061,814.70
负债总计	—	—	—	—	—	33,881,000.47	33,881,000.47
利率敏感度缺口	631,962,609.26	—	8,227,824.40	—	—	7,585,939,739.41	8,226,130,173.07

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（2022年06月30日）		上年度末（2021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	7,500,915,791.59	92.98	7,609,880,501.71	92.51
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	100,518.94	0.00	8,227,824.40	0.10
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	7,501,016,310.53	92.98	7,618,108,326.11	92.61

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（2022年06月30日）	上年度末（2021年12月31日）
	1. 业绩比较基准增加1%	77,431,473.25	86,535,553.69
	2. 业绩比较基准减少1%	-77,431,473.25	-86,535,553.69

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
---------------	-----	------

	(2022年06月30日)	(2021年12月31日)
第一层次	7,436,216,731.17	7,412,890,053.02
第二层次	909,798.94	5,257,504.49
第三层次	63,889,780.42	199,960,768.60
合计	7,501,016,310.53	7,618,108,326.11

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	7,500,915,791.59	92.31
	其中：股票	7,500,915,791.59	92.31
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	100,518.94	0.00
	其中：债券	100,518.94	0.00
	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	575,981,434.80	7.09
8	其他各项资产	49,126,195.35	0.60
9	合计	8,126,123,940.68	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	519,538.00	0.01
B	采矿业	5,389,931.00	0.07
C	制造业	1,009,124,998.02	12.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,960,311.51	0.05
E	建筑业	21,604,269.81	0.27
F	批发和零售业	6,788,408.00	0.08
G	交通运输、仓储和邮政业	1,895,510.00	0.02
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	129,871,036.33	1.61
J	金融业	52,513,516.60	0.65
K	房地产业	15,175,101.00	0.19
L	租赁和商务服务业	12,907,918.00	0.16
M	科学研究和技术服务业	14,356,892.85	0.18

N	水利、环境和公共设施管理业	72,150.36	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	10,595,952.90	0.13
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	1,284,775,534.38	15.93

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	16,083,178.40	0.20
B	采矿业	265,281,252.98	3.29
C	制造业	3,445,238,648.03	42.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	248,665,771.54	3.08
E	建筑业	143,903,270.89	1.78
F	批发和零售业	187,856,978.54	2.33
G	交通运输、仓储和邮政业	278,920,650.08	3.46
H	住宿和餐饮业	4,443,217.60	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	544,744,819.98	6.75
J	金融业	506,992,172.03	6.28
K	房地产业	211,229,307.35	2.62
L	租赁和商务服务业	69,888,835.82	0.87
M	科学研究和技术服务业	56,952,730.00	0.71
N	水利、环境和公共设施管理业	30,800,835.17	0.38
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	67,666,073.80	0.84
R	文化、体育和娱乐业	109,141,283.00	1.35
S	综合	28,331,232.00	0.35
	合计	6,216,140,257.21	77.05

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	603613	国联股份	1,083,133	95,965,583.80	1.19
2	002156	通富微电	5,760,221	88,707,403.40	1.10
3	601615	明阳智能	2,620,927	88,587,332.60	1.10

4	300037	新宙邦	1,669,081	87,726,897.36	1.09
5	300769	德方纳米	210,727	86,119,910.36	1.07
6	600487	亨通光电	5,781,012	84,055,914.48	1.04
7	002180	纳思达	1,656,499	83,851,979.38	1.04
8	300073	当升科技	908,387	82,063,681.58	1.02
9	603456	九洲药业	1,560,216	80,663,167.20	1.00
10	600970	中材国际	8,120,181	78,684,553.89	0.98
11	002468	申通快递	6,327,498	75,423,776.16	0.93
12	600256	广汇能源	7,069,400	74,511,476.00	0.92
13	002497	雅化集团	2,201,000	71,862,650.00	0.89
14	600348	华阳股份	4,470,100	69,107,746.00	0.86
15	300244	迪安诊断	2,175,758	67,666,073.80	0.84
16	688777	中控技术	913,649	66,477,101.24	0.82
17	000898	鞍钢股份	20,071,430	64,630,004.60	0.80
18	300363	博腾股份	824,347	64,290,822.53	0.80
19	600141	兴发集团	1,449,900	63,781,101.00	0.79
20	000970	中科三环	3,373,280	63,350,198.40	0.79
21	002240	盛新锂能	1,028,900	62,104,404.00	0.77
22	002191	劲嘉股份	5,765,220	61,803,158.40	0.77
23	600392	盛和资源	2,667,841	60,293,206.60	0.75
24	601456	国联证券	4,751,341	58,298,954.07	0.72
25	002128	电投能源	4,067,880	58,252,041.60	0.72
26	601156	东航物流	2,894,050	57,302,190.00	0.71
27	600863	内蒙华电	15,454,223	56,407,913.95	0.70
28	300390	天华超净	638,500	55,804,900.00	0.69
29	002508	老板电器	1,547,514	55,756,929.42	0.69
30	600765	中航重机	1,680,640	54,082,995.20	0.67
31	000039	中集集团	3,845,000	53,253,250.00	0.66
32	603127	昭衍新药	466,100	53,042,180.00	0.66
33	688122	西部超导	565,100	52,102,220.00	0.65
34	600718	东软集团	4,509,200	51,900,892.00	0.64
35	002396	星网锐捷	2,268,027	51,348,131.28	0.64
36	688289	圣湘生物	1,688,200	49,987,602.00	0.62
37	600597	光明乳业	3,900,100	49,258,263.00	0.61
38	600233	圆通速递	2,415,302	49,248,007.78	0.61
39	300482	万孚生物	1,203,493	48,994,200.03	0.61
40	688099	晶晨股份	475,538	48,029,338.00	0.60
41	600380	健康元	3,822,524	47,208,171.40	0.59
42	600208	新潮中宝	17,019,734	46,974,465.84	0.58
43	000959	首钢股份	9,382,192	44,659,233.92	0.55
44	600155	华创阳安	5,222,563	43,567,334.24	0.54

45	000402	金融街	7,244,500	43,104,775.00	0.53
46	688521	芯原股份	860,993	42,533,054.20	0.53
47	600875	东方电气	2,550,194	41,950,691.30	0.52
48	600064	南京高科	3,789,032	41,679,352.00	0.52
49	600282	南钢股份	12,499,800	39,374,370.00	0.49
50	002185	华天科技	4,178,844	39,197,556.72	0.49
51	600859	王府井	1,502,949	39,046,615.02	0.48
52	601872	招商轮船	6,727,380	38,749,708.80	0.48
53	000750	国海证券	10,573,200	38,380,716.00	0.48
54	002048	宁波华翔	2,383,896	38,190,013.92	0.47
55	600879	航天电子	5,883,800	38,185,862.00	0.47
56	600728	佳都科技	5,811,988	37,545,442.48	0.47
57	000932	华菱钢铁	7,335,260	37,336,473.40	0.46
58	000930	中粮科技	4,113,684	37,187,703.36	0.46
59	000738	航发控制	1,272,817	35,766,157.70	0.44
60	000988	华工科技	1,543,126	35,754,229.42	0.44
61	000598	兴蓉环境	6,959,959	35,565,390.49	0.44
62	601555	东吴证券	4,985,682	34,550,776.26	0.43
63	600325	华发股份	4,402,294	33,325,365.58	0.41
64	000728	国元证券	5,268,708	32,771,363.76	0.41
65	002867	周大生	2,056,000	31,929,680.00	0.40
66	600642	申能股份	5,479,980	31,126,286.40	0.39
67	002557	洽洽食品	546,606	31,118,279.58	0.39
68	688006	杭可科技	443,195	31,050,241.70	0.38
69	002797	第一创业	4,839,700	31,022,477.00	0.38
70	000401	冀东水泥	2,896,000	30,465,920.00	0.38
71	300618	寒锐钴业	524,400	30,373,248.00	0.38
72	600967	内蒙一机	3,329,553	30,365,523.36	0.38
73	600499	科达制造	1,440,500	29,731,920.00	0.37
74	300182	捷成股份	5,198,000	28,589,000.00	0.35
75	000960	锡业股份	1,700,000	28,509,000.00	0.35
76	600782	新钢股份	5,644,320	28,447,372.80	0.35
77	603026	石大胜华	191,000	27,761,850.00	0.34
78	600546	山煤国际	1,423,600	27,703,256.00	0.34
79	603444	吉比特	70,873	27,498,724.00	0.34
80	000690	宝新能源	6,123,300	26,820,054.00	0.33
81	300070	碧水源	4,973,317	25,910,981.57	0.32
82	600039	四川路桥	2,454,600	25,846,938.00	0.32
83	600901	江苏租赁	5,010,365	25,703,172.45	0.32
84	601717	郑煤机	1,779,800	25,646,918.00	0.32
85	600673	东阳光	2,837,800	25,511,822.00	0.32

86	600170	上海建工	8,346,500	25,289,895.00	0.31
87	603198	迎驾贡酒	387,900	25,267,806.00	0.31
88	600177	雅戈尔	3,725,000	24,696,750.00	0.31
89	600373	中文传媒	2,444,900	24,424,551.00	0.30
90	002131	利欧股份	12,489,300	24,229,242.00	0.30
91	002624	完美世界	1,800,000	23,814,000.00	0.30
92	600705	中航产融	6,842,699	23,675,738.54	0.29
93	603866	桃李面包	1,472,486	23,625,943.30	0.29
94	601928	凤凰传媒	3,296,600	23,570,690.00	0.29
95	600737	中粮糖业	3,101,462	23,322,994.24	0.29
96	000685	中山公用	2,995,600	23,006,208.00	0.29
97	300212	易华录	1,304,600	22,700,040.00	0.28
98	000519	中兵红箭	768,985	22,415,912.75	0.28
99	600582	天地科技	4,689,200	22,414,376.00	0.28
100	002985	北摩高科	380,716	22,302,343.28	0.28
101	000027	深圳能源	3,452,300	22,129,243.00	0.27
102	600390	五矿资本	4,508,564	22,046,877.96	0.27
103	600623	华谊集团	2,639,000	21,903,700.00	0.27
104	002966	苏州银行	3,550,970	21,660,917.00	0.27
105	601128	常熟银行	2,813,400	21,494,376.00	0.27
106	603605	珀莱雅	129,378	21,370,658.04	0.26
107	600008	首创环保	7,316,423	21,217,626.70	0.26
108	600909	华安证券	4,662,080	21,212,464.00	0.26
109	601098	中南传媒	2,233,700	21,086,128.00	0.26
110	002756	永兴材料	132,800	20,213,488.00	0.25
111	600060	海信视像	1,614,099	20,176,237.50	0.25
112	601187	厦门银行	3,368,500	20,076,260.00	0.25
113	000785	居然之家	4,483,900	19,953,355.00	0.25
114	300418	昆仑万维	1,239,312	19,828,992.00	0.25
115	601005	重庆钢铁	10,315,100	19,701,841.00	0.24
116	601198	东兴证券	2,192,000	19,508,800.00	0.24
117	601869	长飞光纤	619,911	19,167,648.12	0.24
118	600985	淮北矿业	1,300,500	18,935,280.00	0.23
119	002506	协鑫集成	5,087,727	18,926,344.44	0.23
120	002673	西部证券	2,880,100	18,835,854.00	0.23
121	002010	传化智联	2,907,100	18,692,653.00	0.23
122	600704	物产中大	3,589,733	18,415,330.29	0.23
123	000778	新兴铸管	3,792,500	18,279,850.00	0.23
124	600153	建发股份	1,369,200	17,895,444.00	0.22
125	600079	人福医药	1,117,480	17,879,680.00	0.22
126	002444	巨星科技	935,000	17,615,400.00	0.22

127	603868	飞科电器	229,080	17,352,810.00	0.22
128	603719	良品铺子	603,896	17,289,542.48	0.21
129	688819	天能股份	491,900	17,009,902.00	0.21
130	000717	韶钢松山	4,740,000	16,590,000.00	0.21
131	600315	上海家化	372,600	15,928,650.00	0.20
132	600835	上海机电	1,147,000	15,748,310.00	0.20
133	600271	航天信息	1,428,000	15,622,320.00	0.19
134	002500	山西证券	2,700,270	15,499,549.80	0.19
135	600415	小商品城	2,688,056	14,972,471.92	0.19
136	600109	国金证券	1,625,949	14,633,541.00	0.18
137	002281	光迅科技	818,300	14,385,714.00	0.18
138	002244	滨江集团	1,646,700	14,243,955.00	0.18
139	600648	外高桥	1,046,075	14,226,620.00	0.18
140	600755	厦门国贸	1,872,200	14,041,500.00	0.17
141	002701	奥瑞金	2,693,200	14,004,640.00	0.17
142	601778	晶科科技	2,713,800	13,840,520.00	0.17
143	000830	鲁西化工	762,500	13,183,625.00	0.16
144	600867	通化东宝	1,269,400	13,125,596.00	0.16
145	600160	巨化股份	995,830	13,095,164.50	0.16
146	603379	三美股份	580,163	12,908,626.75	0.16
147	600118	中国卫星	632,256	12,695,700.48	0.16
148	002092	中泰化学	1,600,100	12,416,776.00	0.15
149	000630	铜陵有色	3,706,100	12,081,886.00	0.15
150	300009	安科生物	1,088,200	11,001,702.00	0.14
151	300869	康泰医学	377,773	10,675,864.98	0.13
152	002146	荣盛发展	3,323,900	10,071,417.00	0.12
153	300474	景嘉微	147,200	10,067,008.00	0.12
154	600732	爱旭股份	303,800	10,031,476.00	0.12
155	000050	深天马 A	1,004,500	10,014,865.00	0.12
156	000656	金科股份	3,448,200	9,861,852.00	0.12
157	603000	人民网	879,600	9,851,520.00	0.12
158	002946	新乳业	748,500	9,723,015.00	0.12
159	600497	驰宏锌锗	1,852,100	9,612,399.00	0.12
160	300285	国瓷材料	258,800	9,296,096.00	0.12
161	600820	隧道股份	1,495,300	9,151,236.00	0.11
162	601866	中远海发	3,035,900	9,107,700.00	0.11
163	000983	山西焦煤	664,600	8,898,994.00	0.11
164	002926	华西证券	1,111,500	8,714,160.00	0.11
165	002065	东华软件	1,368,900	8,651,448.00	0.11
166	600811	东方集团	2,989,900	8,461,417.00	0.10
167	000883	湖北能源	1,633,800	8,348,718.00	0.10

168	000807	云铝股份	837,084	8,270,389.92	0.10
169	002212	天融信	785,700	7,974,855.00	0.10
170	601860	紫金银行	2,763,700	7,931,819.00	0.10
171	601828	美凯龙	1,288,965	7,811,127.90	0.10
172	000156	华数传媒	978,000	7,794,660.00	0.10
173	002745	木林森	795,577	7,772,787.29	0.10
174	601992	金隅集团	2,801,300	7,759,601.00	0.10
175	000997	新大陆	566,200	7,479,502.00	0.09
176	600717	天津港	1,803,290	7,231,192.90	0.09
177	600801	华新水泥	363,200	7,086,032.00	0.09
178	601577	长沙银行	886,200	7,027,566.00	0.09
179	688321	微芯生物	276,100	6,954,959.00	0.09
180	600006	东风汽车	901,500	6,806,325.00	0.08
181	600096	云天化	203,700	6,412,476.00	0.08
182	600022	山东钢铁	3,680,000	6,403,200.00	0.08
183	601118	海南橡胶	1,339,100	6,400,898.00	0.08
184	000553	安道麦 A	527,200	6,384,392.00	0.08
185	600808	马钢股份	1,677,400	6,357,346.00	0.08
186	600739	辽宁成大	429,015	6,255,038.70	0.08
187	600259	广晟有色	122,100	6,184,365.00	0.08
188	000999	华润三九	136,100	6,124,500.00	0.08
189	300136	信维通信	353,800	5,961,530.00	0.07
190	002507	涪陵榨菜	171,600	5,923,632.00	0.07
191	002174	游族网络	593,600	5,799,472.00	0.07
192	002127	南极电商	1,084,700	5,792,298.00	0.07
193	601333	广深铁路	2,638,800	5,752,584.00	0.07
194	600764	中国海防	224,000	5,653,760.00	0.07
195	600298	安琪酵母	115,100	5,611,125.00	0.07
196	600350	山东高速	1,067,700	5,605,425.00	0.07
197	600528	中铁工业	685,600	5,519,080.00	0.07
198	002268	卫士通	127,800	5,483,898.00	0.07
199	000878	云南铜业	480,600	5,474,034.00	0.07
200	600566	济川药业	200,800	5,453,728.00	0.07
201	002372	伟星新材	223,945	5,383,637.80	0.07
202	600297	广汇汽车	2,022,500	5,278,725.00	0.07
203	300168	万达信息	552,500	5,215,600.00	0.06
204	001872	招商港口	333,900	5,208,840.00	0.06
205	000012	南玻 A	681,700	5,058,214.00	0.06
206	600038	中直股份	111,639	5,046,082.80	0.06
207	601991	大唐发电	2,061,500	5,009,445.00	0.06
208	300630	普利制药	141,207	4,963,426.05	0.06

209	002195	二三四五	2,200,000	4,950,000.00	0.06
210	002081	金螳螂	970,600	4,930,648.00	0.06
211	002004	华邦健康	879,800	4,909,284.00	0.06
212	603707	健友股份	173,502	4,892,756.40	0.06
213	000825	太钢不锈	884,900	4,822,705.00	0.06
214	601699	潞安环能	327,359	4,785,988.58	0.06
215	002384	东山精密	204,824	4,696,614.32	0.06
216	000089	深圳机场	604,600	4,667,512.00	0.06
217	002429	兆驰股份	1,205,300	4,628,352.00	0.06
218	000636	风华高科	243,600	4,577,244.00	0.06
219	600511	国药股份	170,319	4,561,142.82	0.06
220	002831	裕同科技	153,280	4,529,424.00	0.06
221	300257	开山股份	302,200	4,520,912.00	0.06
222	002138	顺络电子	165,503	4,509,956.75	0.06
223	000563	陕国投 A	1,437,800	4,485,936.00	0.06
224	300024	机器人	444,400	4,479,552.00	0.06
225	002382	蓝帆医疗	470,640	4,469,181.60	0.06
226	002373	千方科技	400,700	4,455,784.00	0.06
227	300463	迈克生物	216,948	4,445,264.52	0.06
228	600258	首旅酒店	179,162	4,443,217.60	0.06
229	002939	长城证券	433,100	4,400,296.00	0.05
230	300724	捷佳伟创	48,500	4,333,475.00	0.05
231	002110	三钢闽光	711,100	4,330,599.00	0.05
232	300017	网宿科技	803,000	4,304,080.00	0.05
233	300357	我武生物	82,600	4,297,678.00	0.05
234	002223	鱼跃医疗	165,950	4,258,277.00	0.05
235	600529	山东药玻	151,914	4,245,996.30	0.05
236	603056	德邦股份	311,900	4,188,817.00	0.05
237	300699	光威复材	71,000	4,179,770.00	0.05
238	002299	圣农发展	216,900	4,160,142.00	0.05
239	002409	雅克科技	74,800	4,152,148.00	0.05
240	001965	招商公路	533,000	4,066,790.00	0.05
241	002390	信邦制药	586,800	4,054,788.00	0.05
242	688002	睿创微纳	101,200	4,019,664.00	0.05
243	601598	中国外运	1,030,213	3,997,226.44	0.05
244	300088	长信科技	533,300	3,957,086.00	0.05
245	002572	索菲亚	141,126	3,880,965.00	0.05
246	600862	中航高科	138,035	3,878,783.50	0.05
247	600372	中航电子	198,068	3,840,538.52	0.05
248	600376	首开股份	773,100	3,795,921.00	0.05
249	002603	以岭药业	154,595	3,756,658.50	0.05

250	000990	诚志股份	341,380	3,738,111.00	0.05
251	600056	中国医药	250,040	3,705,592.80	0.05
252	601168	西部矿业	311,600	3,686,228.00	0.05
253	300251	光线传媒	388,200	3,676,254.00	0.05
254	001914	招商积余	198,584	3,568,554.48	0.04
255	300146	汤臣倍健	164,580	3,563,157.00	0.04
256	688188	柏楚电子	15,849	3,487,413.96	0.04
257	688256	寒武纪	53,100	3,435,570.00	0.04
258	300253	卫宁健康	385,600	3,385,568.00	0.04
259	300676	华大基因	46,800	3,355,560.00	0.04
260	002221	东华能源	357,700	3,330,187.00	0.04
261	002273	水晶光电	274,969	3,329,874.59	0.04
262	600998	九州通	275,900	3,285,969.00	0.04
263	000028	国药一致	109,257	3,254,766.03	0.04
264	600482	中国动力	207,000	3,251,970.00	0.04
265	000062	深圳华强	253,700	3,221,990.00	0.04
266	600885	宏发股份	76,580	3,204,873.00	0.04
267	600027	华电国际	812,400	3,192,732.00	0.04
268	600201	生物股份	348,200	3,189,512.00	0.04
269	000528	柳工	488,200	3,178,182.00	0.04
270	300296	利亚德	435,200	3,176,960.00	0.04
271	002002	鸿达兴业	848,100	3,146,451.00	0.04
272	000581	威孚高科	162,438	3,126,931.50	0.04
273	002653	海思科	193,600	3,118,896.00	0.04
274	603225	新凤鸣	269,517	3,110,226.18	0.04
275	002155	湖南黄金	255,100	3,096,914.00	0.04
276	002233	塔牌集团	347,974	3,079,569.90	0.04
277	600507	方大特钢	434,600	3,037,854.00	0.04
278	300383	光环新网	288,000	3,000,960.00	0.04
279	000961	中南建设	983,089	2,998,421.45	0.04
280	600398	海澜之家	624,600	2,966,850.00	0.04
281	002266	浙富控股	617,840	2,959,453.60	0.04
282	600120	浙江东方	734,700	2,946,147.00	0.04
283	000937	冀中能源	390,000	2,909,400.00	0.04
284	002124	天邦食品	432,320	2,905,190.40	0.04
285	600572	康恩贝	653,400	2,894,562.00	0.04
286	300026	红日药业	375,600	2,892,120.00	0.04
287	600195	中牧股份	233,000	2,856,580.00	0.04
288	600329	达仁堂	114,900	2,824,242.00	0.04
289	000009	中国宝安	209,000	2,819,410.00	0.03
290	000887	中鼎股份	153,700	2,803,488.00	0.03

291	600959	江苏有线	857,800	2,796,428.00	0.03
292	600787	中储股份	489,900	2,787,531.00	0.03
293	002683	广东宏大	98,400	2,738,472.00	0.03
294	603156	养元饮品	119,288	2,710,223.36	0.03
295	000415	渤海租赁	1,229,000	2,666,930.00	0.03
296	000623	吉林敖东	179,530	2,649,862.80	0.03
297	601228	广州港	715,400	2,625,518.00	0.03
298	600598	北大荒	177,300	2,616,948.00	0.03
299	002511	中顺洁柔	206,987	2,591,477.24	0.03
300	002203	海亮股份	218,800	2,527,140.00	0.03
301	600536	中国软件	61,230	2,485,325.70	0.03
302	600377	宁沪高速	287,800	2,466,446.00	0.03
303	002353	杰瑞股份	59,195	2,385,558.50	0.03
304	600062	华润双鹤	91,842	2,356,665.72	0.03
305	000987	越秀金控	315,765	2,219,827.95	0.03
306	603589	口子窖	37,123	2,175,779.03	0.03
307	000869	张裕 A	72,500	2,156,150.00	0.03
308	601003	柳钢股份	530,980	2,150,469.00	0.03
309	600500	中化国际	315,800	2,100,070.00	0.03
310	002416	爱施德	222,400	2,068,320.00	0.03
311	600517	国网英大	376,300	1,952,997.00	0.02
312	601200	上海环境	190,000	1,930,400.00	0.02
313	000709	河钢股份	826,900	1,868,794.00	0.02
314	600521	华海药业	79,100	1,795,570.00	0.02
315	001203	大中矿业	150,000	1,695,000.00	0.02
316	002936	郑州银行	599,300	1,612,117.00	0.02
317	002505	鹏都农牧	475,300	1,611,267.00	0.02
318	002030	达安基因	92,500	1,590,075.00	0.02
319	600409	三友化工	174,500	1,429,155.00	0.02
320	002705	新宝股份	64,900	1,427,151.00	0.02
321	002422	科伦药业	75,100	1,404,370.00	0.02
322	603939	益丰药房	26,000	1,373,580.00	0.02
323	000513	丽珠集团	35,400	1,281,834.00	0.02
324	600166	福田汽车	436,400	1,235,012.00	0.02
325	688088	虹软科技	38,040	1,201,683.60	0.01
326	600823	世茂股份	389,100	1,159,518.00	0.01
327	300072	海新能源	226,000	1,143,560.00	0.01
328	600157	永泰能源	703,700	1,118,883.00	0.01
329	002294	信立泰	38,600	1,084,660.00	0.01
330	000739	普洛药业	51,500	1,062,960.00	0.01
331	002249	大洋电机	172,600	1,059,764.00	0.01

332	002815	崇达技术	79,200	1,014,552.00	0.01
333	603858	步长制药	49,700	979,587.00	0.01
334	000686	东北证券	133,000	929,670.00	0.01
335	300001	特锐德	52,100	901,851.00	0.01
336	002019	亿帆医药	63,400	886,332.00	0.01
337	600871	石化油服	458,600	866,754.00	0.01
338	300115	长盈精密	84,000	866,040.00	0.01
339	300832	新产业	18,300	825,513.00	0.01
340	002670	国盛金控	84,300	809,280.00	0.01
341	300376	易事特	98,800	802,256.00	0.01
342	600917	重庆燃气	106,600	769,652.00	0.01
343	600535	天士力	69,400	729,394.00	0.01
344	600299	安迪苏	74,200	710,836.00	0.01
345	600216	浙江医药	51,800	707,070.00	0.01
346	688390	固德威	2,240	701,142.40	0.01
347	603233	大参林	21,440	671,072.00	0.01
348	002385	大北农	83,200	649,792.00	0.01
349	600928	西安银行	169,300	621,331.00	0.01
350	603883	老百姓	18,330	621,020.40	0.01
351	600563	法拉电子	3,000	615,480.00	0.01
352	600418	江淮汽车	34,800	597,168.00	0.01
353	003035	南网能源	87,400	554,990.00	0.01
354	603885	吉祥航空	27,300	491,127.00	0.01
355	600126	杭钢股份	94,100	481,792.00	0.01
356	002152	广电运通	50,900	471,843.00	0.01
357	600895	张江高科	35,800	445,710.00	0.01
358	002399	海普瑞	24,700	434,226.00	0.01
359	688029	南微医学	4,865	424,228.00	0.01
360	600906	财达证券	44,700	401,853.00	0.00
361	600699	均胜电子	20,700	325,197.00	0.00
362	601718	际华集团	98,800	306,280.00	0.00
363	603650	彤程新材	8,800	286,704.00	0.00
364	600516	方大炭素	30,500	231,800.00	0.00
365	603228	景旺电子	6,800	158,644.00	0.00
366	603927	中科软	6,100	142,252.00	0.00
367	600131	国网信通	9,000	121,050.00	0.00
368	600167	联美控股	15,100	113,099.00	0.00
369	688208	道通科技	203	6,682.76	0.00
370	002901	大博医疗	100	3,914.00	0.00
371	002925	盈趣科技	100	2,152.00	0.00
372	002532	天山铝业	100	653.00	0.00

373	601000	唐山港	100	258.00	0.00
374	000975	银泰黄金	20	194.80	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	600873	梅花生物	4,938,800	55,709,664.00	0.69
2	000625	长安汽车	2,708,723	46,915,082.36	0.58
3	600481	双良节能	2,738,000	46,135,300.00	0.57
4	300457	赢合科技	1,503,851	42,724,406.91	0.53
5	002517	恺英网络	6,575,500	36,691,290.00	0.45
6	002821	凯莱英	120,700	34,882,300.00	0.43
7	600089	特变电工	1,271,300	34,820,907.00	0.43
8	002085	万丰奥威	6,028,000	32,370,360.00	0.40
9	688005	容百科技	244,277	31,619,214.88	0.39
10	600929	雪天盐业	3,348,618	31,075,175.04	0.39
11	688050	爱博医疗	132,448	29,694,841.60	0.37
12	002410	广联达	541,600	29,484,704.00	0.37
13	300346	南大光电	763,400	27,467,132.00	0.34
14	600438	通威股份	448,600	26,853,196.00	0.33
15	000877	天山股份	1,915,200	23,556,960.00	0.29
16	002460	赣锋锂业	149,750	22,267,825.00	0.28
17	002405	四维图新	1,466,600	22,101,662.00	0.27
18	688508	芯朋微	288,116	21,464,642.00	0.27
19	300803	指南针	338,620	19,904,083.60	0.25
20	601336	新华保险	602,900	19,407,351.00	0.24
21	600519	贵州茅台	9,400	19,223,000.00	0.24
22	688012	中微公司	157,800	18,423,150.00	0.23
23	300450	先导智能	284,700	17,987,346.00	0.22
24	603688	石英股份	123,864	16,425,605.04	0.20
25	600584	长电科技	602,500	16,267,500.00	0.20
26	002597	金禾实业	363,700	15,759,121.00	0.20
27	688123	聚辰股份	146,100	15,562,572.00	0.19
28	300130	新国都	1,224,457	15,011,842.82	0.19
29	300604	长川科技	316,886	14,307,402.90	0.18
30	002832	比音勒芬	514,200	12,957,840.00	0.16
31	600057	厦门象屿	1,454,900	12,788,571.00	0.16
32	603259	药明康德	121,289	12,612,843.11	0.16
33	300681	英搏尔	205,770	11,887,332.90	0.15
34	300196	长海股份	625,516	11,815,997.24	0.15

35	600219	南山铝业	2,983,600	11,009,484.00	0.14
36	688556	高测股份	135,942	10,970,519.40	0.14
37	300740	水羊股份	795,400	10,928,796.00	0.14
38	300271	华宇软件	1,428,052	10,738,951.04	0.13
39	300432	富临精工	481,950	10,602,900.00	0.13
40	603882	金城医学	128,358	10,595,952.90	0.13
41	002645	华宏科技	474,900	10,362,318.00	0.13
42	603392	万泰生物	63,132	9,804,399.60	0.12
43	300696	爱乐达	207,960	9,139,842.00	0.11
44	000090	天健集团	1,323,585	9,119,500.65	0.11
45	300065	海兰信	685,050	8,974,155.00	0.11
46	688981	中芯国际	191,467	8,648,564.39	0.11
47	603008	喜临门	227,600	8,352,920.00	0.10
48	601877	正泰电器	230,900	8,261,602.00	0.10
49	002080	中材科技	297,921	8,192,827.50	0.10
50	001979	招商蛇口	590,000	7,923,700.00	0.10
51	600745	闻泰科技	91,600	7,796,076.00	0.10
52	603365	水星家纺	518,000	7,759,640.00	0.10
53	601668	中国建筑	1,439,949	7,660,528.68	0.09
54	688518	联赢激光	221,700	7,535,583.00	0.09
55	300639	凯普生物	342,200	7,316,236.00	0.09
56	605358	立昂微	108,136	7,286,203.68	0.09
57	002035	华帝股份	1,165,560	6,783,559.20	0.08
58	000933	神火股份	505,200	6,608,016.00	0.08
59	300770	新媒股份	171,900	6,502,977.00	0.08
60	300481	濮阳惠成	270,700	6,361,450.00	0.08
61	002009	天奇股份	343,400	6,352,900.00	0.08
62	300911	亿田智能	81,500	6,263,275.00	0.08
63	688516	奥特维	21,200	5,659,340.00	0.07
64	601933	永辉超市	1,246,700	5,335,876.00	0.07
65	002709	天赐材料	85,838	5,327,106.28	0.07
66	601689	拓普集团	76,165	5,211,970.95	0.06
67	688499	利元亨	21,200	4,691,560.00	0.06
68	300661	圣邦股份	25,500	4,641,510.00	0.06
69	688778	厦钨新能	39,600	4,414,212.00	0.05
70	600926	杭州银行	290,800	4,356,184.00	0.05
71	002594	比亚迪	13,000	4,335,370.00	0.05
72	603678	火炬电子	92,500	4,329,925.00	0.05
73	300750	宁德时代	8,100	4,325,400.00	0.05
74	600884	杉杉股份	132,600	3,940,872.00	0.05
75	600048	保利发展	218,200	3,809,772.00	0.05

76	002129	TCL 中环	63,000	3,710,070.00	0.05
77	300896	爱美客	6,080	3,648,060.80	0.05
78	002283	天润工业	532,000	3,633,560.00	0.05
79	000848	承德露露	367,400	3,556,432.00	0.04
80	600733	北汽蓝谷	380,600	3,528,162.00	0.04
81	601166	兴业银行	173,900	3,460,610.00	0.04
82	300415	伊之密	185,900	3,388,957.00	0.04
83	601939	建设银行	555,400	3,365,724.00	0.04
84	300772	运达股份	130,720	3,325,516.80	0.04
85	600295	鄂尔多斯	183,520	3,312,536.00	0.04
86	300083	创世纪	277,500	3,191,250.00	0.04
87	000498	山东路桥	327,628	3,164,886.48	0.04
88	603236	移远通信	22,516	3,009,488.56	0.04
89	603113	金能科技	254,100	2,810,346.00	0.03
90	688330	宏力达	31,200	2,682,888.00	0.03
91	603986	兆易创新	18,600	2,645,106.00	0.03
92	600803	新奥股份	130,989	2,435,085.51	0.03
93	688016	心脉医疗	11,810	2,300,706.10	0.03
94	300171	东富龙	67,000	2,271,970.00	0.03
95	601899	紫金矿业	237,600	2,216,808.00	0.03
96	300035	中科电气	79,076	2,210,174.20	0.03
97	300476	胜宏科技	117,100	2,149,956.00	0.03
98	605006	山东玻纤	183,540	2,101,533.00	0.03
99	300398	飞凯材料	90,700	2,073,402.00	0.03
100	688116	天奈科技	12,200	2,067,656.00	0.03
101	300568	星源材质	67,449	1,958,718.96	0.02
102	301050	雷电微力	19,260	1,956,045.60	0.02
103	601882	海天精工	92,600	1,908,486.00	0.02
104	601339	百隆东方	373,300	1,896,364.00	0.02
105	600223	鲁商发展	177,700	1,862,296.00	0.02
106	002340	格林美	195,500	1,779,050.00	0.02
107	300347	泰格医药	15,100	1,728,195.00	0.02
108	300873	海晨股份	57,875	1,636,126.25	0.02
109	002585	双星新材	88,200	1,595,538.00	0.02
110	600330	天通股份	128,200	1,526,862.00	0.02
111	688085	三友医疗	70,504	1,526,411.60	0.02
112	300274	阳光电源	15,100	1,483,575.00	0.02
113	002747	埃斯顿	58,700	1,438,150.00	0.02
114	300358	楚天科技	78,600	1,398,294.00	0.02
115	603799	华友钴业	14,400	1,376,928.00	0.02
116	300573	兴齐眼药	8,800	1,349,216.00	0.02

117	603337	杰克股份	62,400	1,340,352.00	0.02
118	601238	广汽集团	86,200	1,313,688.00	0.02
119	002100	天康生物	134,900	1,311,228.00	0.02
120	603997	继峰股份	119,000	1,294,720.00	0.02
121	000758	中色股份	267,900	1,293,957.00	0.02
122	300041	回天新材	72,700	1,262,799.00	0.02
123	300638	广和通	43,955	1,164,367.95	0.01
124	300768	迪普科技	71,800	1,159,570.00	0.01
125	600795	国电电力	279,900	1,094,409.00	0.01
126	688599	天合光能	16,600	1,083,150.00	0.01
127	600997	开滦股份	139,100	1,059,942.00	0.01
128	603708	家家悦	68,400	974,016.00	0.01
129	601658	邮储银行	172,600	930,314.00	0.01
130	600872	中炬高新	26,400	913,704.00	0.01
131	603501	韦尔股份	5,100	882,453.00	0.01
132	603277	银都股份	40,000	844,400.00	0.01
133	300382	斯莱克	51,700	810,139.00	0.01
134	601390	中国中铁	131,000	804,340.00	0.01
135	002142	宁波银行	21,800	780,658.00	0.01
136	688048	长光华芯	6,790	760,276.30	0.01
137	600496	精工钢构	157,800	729,036.00	0.01
138	002438	江苏神通	49,000	722,750.00	0.01
139	600266	城建发展	175,500	716,040.00	0.01
140	002042	华孚时尚	181,700	686,826.00	0.01
141	688536	思瑞浦	1,184	664,922.56	0.01
142	601101	昊华能源	61,100	629,330.00	0.01
143	688700	东威科技	7,500	625,050.00	0.01
144	002841	视源股份	8,200	617,624.00	0.01
145	601618	中国中冶	171,700	600,950.00	0.01
146	601666	平煤股份	41,200	559,908.00	0.01
147	300496	中科创达	4,236	552,713.28	0.01
148	600649	城投控股	128,700	550,836.00	0.01
149	002245	蔚蓝锂芯	23,000	533,830.00	0.01
150	600547	山东黄金	28,500	528,960.00	0.01
151	300219	鸿利智汇	60,700	528,090.00	0.01
152	002714	牧原股份	9,400	519,538.00	0.01
153	002304	洋河股份	2,800	512,820.00	0.01
154	300438	鹏辉能源	8,300	510,035.00	0.01
155	688357	建龙微纳	4,400	494,736.00	0.01
156	688559	海目星	6,800	494,360.00	0.01
157	000906	浙商中拓	52,700	478,516.00	0.01

158	002038	双鹭药业	48,300	468,993.00	0.01
159	603396	金辰股份	5,100	464,253.00	0.01
160	603818	曲美家居	45,900	436,050.00	0.01
161	600903	贵州燃气	55,200	430,008.00	0.01
162	688388	嘉元科技	5,000	424,350.00	0.01
163	002651	利君股份	53,700	421,545.00	0.01
164	600449	宁夏建材	33,600	408,912.00	0.01
165	300775	三角防务	8,200	394,830.00	0.00
166	688300	联瑞新材	4,624	359,053.60	0.00
167	600702	舍得酒业	1,600	326,384.00	0.00
168	600383	金地集团	23,200	311,808.00	0.00
169	002920	德赛西威	2,100	310,800.00	0.00
170	688170	德龙激光	6,175	290,472.00	0.00
171	603881	数据港	10,200	273,870.00	0.00
172	601006	大秦铁路	39,300	258,987.00	0.00
173	300260	新莱应材	5,000	254,350.00	0.00
174	601868	中国能建	107,200	254,064.00	0.00
175	600586	金晶科技	30,100	227,255.00	0.00
176	688325	赛微微电	4,039	217,661.71	0.00
177	002424	贵州百灵	28,100	216,089.00	0.00
178	688209	英集芯	6,822	188,150.76	0.00
179	600908	无锡银行	32,600	183,538.00	0.00
180	601225	陕西煤业	7,600	160,968.00	0.00
181	002475	立讯精密	4,100	138,539.00	0.00
182	300487	蓝晓科技	2,200	134,200.00	0.00
183	002812	恩捷股份	500	125,225.00	0.00
184	601818	光大银行	41,200	124,012.00	0.00
185	300662	科锐国际	2,300	119,347.00	0.00
186	301219	腾远钴业	578	50,759.96	0.00
187	301200	大族数控	857	44,495.44	0.00
188	301206	三元生物	945	43,177.05	0.00
189	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
190	688565	力源科技	3,450	33,534.00	0.00
191	301150	中一科技	404	33,435.04	0.00
192	301109	军信股份	1,838	29,665.32	0.00
193	301201	诚达药业	353	25,253.62	0.00
194	300834	星辉环材	635	19,069.05	0.00
195	301162	国能日新	334	18,072.74	0.00
196	301123	奕东电子	656	16,655.84	0.00
197	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.00
198	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.00

199	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
200	300774	倍杰特	444	8,951.04	0.00
201	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
202	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
203	301036	双乐股份	205	4,608.40	0.00
204	600596	新安股份	60	1,299.00	0.00
205	601009	南京银行	100	1,042.00	0.00
206	002064	华峰化学	100	844.00	0.00
207	600461	洪城环境	100	809.00	0.00
208	000069	华侨城 A	100	649.00	0.00
209	603565	中谷物流	25	396.75	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	600970	中材国际	91,673,830.36	1.11
2	000898	鞍钢股份	88,631,174.70	1.08
3	300769	德方纳米	75,739,950.34	0.92
4	300073	当升科技	70,387,593.05	0.86
5	688777	中控技术	69,903,698.80	0.85
6	002497	雅化集团	68,543,440.05	0.83
7	002180	纳思达	67,492,964.97	0.82
8	688005	容百科技	62,056,963.05	0.75
9	600348	华阳股份	61,760,820.00	0.75
10	601156	东航物流	60,197,818.89	0.73
11	002240	盛新锂能	59,331,920.95	0.72
12	688521	芯原股份	58,790,964.38	0.71
13	600233	圆通速递	58,663,357.00	0.71
14	600208	新湖中宝	56,707,500.02	0.69
15	002508	老板电器	56,101,364.76	0.68
16	688289	圣湘生物	54,814,886.95	0.67
17	002468	申通快递	53,958,743.60	0.66
18	600546	山煤国际	53,919,180.73	0.66
19	601456	国联证券	53,746,604.18	0.65
20	002156	通富微电	52,079,725.00	0.63

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	000830	鲁西化工	93,342,229.88	1.13
2	601699	潞安环能	79,511,842.07	0.97
3	601689	拓普集团	75,570,155.02	0.92
4	601636	旗滨集团	71,073,960.44	0.86
5	000887	中鼎股份	65,250,013.00	0.79
6	300223	北京君正	65,224,138.37	0.79
7	600563	法拉电子	62,922,485.16	0.76
8	600056	中国医药	60,304,979.43	0.73
9	002572	索菲亚	59,031,102.22	0.72
10	601598	中国外运	58,786,995.00	0.71
11	600008	首创环保	58,575,947.90	0.71
12	000581	威孚高科	57,750,759.56	0.70
13	600546	山煤国际	55,750,109.31	0.68
14	002648	卫星化学	55,051,858.00	0.67
15	002396	星网锐捷	54,808,042.94	0.67
16	002244	滨江集团	54,215,905.81	0.66
17	000060	中金岭南	52,721,779.00	0.64
18	300750	宁德时代	50,249,764.92	0.61
19	605358	立昂微	49,763,496.18	0.60
20	603225	新凤鸣	47,726,928.94	0.58

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	7,151,928,140.82
卖出股票收入（成交）总额	6,764,345,849.26

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）	100,518.94	0.00
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	100,518.94	0.00

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	127064	杭氧转债	1,005	100,518.94	0.00

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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 申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	618,905.57
2	应收清算款	28,202,387.61
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	20,304,902.17
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	49,126,195.35

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 A	1,095,566	2,995.77	602,651,709.32	18.36	2,679,411,073.78	81.64
富国中证 500 指数增强 C	6,157	7,614.91	30,727,894.35	65.54	16,157,113.22	34.46
合计	1,101,723	3,021.58	633,379,603.67	19.03	2,695,568,187.00	80.97

8.2 期末上市基金前十名持有人

富国中证 500 指数增强 A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	王哲哲	1,240,074.00	1.60
2	陈永军	1,185,593.00	1.53
3	丁飞	788,200.00	1.02
4	合肥黄山大厦酒店管理集团有限公司	716,920.00	0.93
5	吴林萍	707,463.00	0.91
6	厦门市营嘉系统集成技术有限公司	515,158.00	0.67
7	陈阳	500,000.00	0.65
8	王伟东	468,186.00	0.61
9	白熠	467,169.00	0.60
10	胡建婷	466,670.00	0.60

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(%)
基金管理公司所有从业人员持有本基金	富国中证 500 指数增强 A	1,246,448.95	0.0380
	富国中证 500 指数增强 C	14,374.65	0.0307
	合计	1,260,823.60	0.0379

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 A	50~100
	富国中证 500 指数增强 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 A	0~10
	富国中证 500 指数增强 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 A	富国中证 500 指数增 强 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	3,177,163,202.38	11,908,351.98
本报告期基金总申购份额	1,010,804,667.52	146,684,135.75
减：本报告期基金总赎回份额	905,905,086.80	111,707,480.16
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	3,282,062,783.10	46,885,007.57

§ 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

2022年3月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部总裁。

2022年3月，中国农业银行总行决定王洪滨任托管业务部高级专家。

本报告期本基金管理人无重大人事变动。

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

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		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 (%)	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 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
安信证券	2	—	—	915,439.20	9.92	—	—	—	—	—	—	—
德邦证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
第一创业证券	2	996,093,530.60	7.17	—	—	—	—	—	—	913,311.02	7.17	—
东北证券	2	620,156,958.42	4.46	—	—	—	—	—	—	567,198.82	4.45	—
东方证券	2	174,505,415.81	1.26	—	—	—	—	—	—	159,036.59	1.25	—
国海证券	2	714,391,306.41	5.14	294,500.00	3.19	—	—	—	—	654,900.71	5.14	—
国联证券	1	720,630,561.54	5.18	—	—	—	—	—	—	662,727.80	5.20	—
国泰君安	2	2,855,641,592.07	20.54	5,512,504.70	59.75	—	—	—	—	2,615,177.02	20.54	—
海通证券	1	889,625,605.32	6.40	—	—	—	—	—	—	814,480.73	6.40	—
华菁证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
汇丰前海	2	192,832,448.03	1.39	—	—	—	—	—	—	175,726.26	1.38	—
开源证券	4	1,923,650,984.16	13.84	—	—	—	—	—	—	1,760,419.05	13.83	—
申万宏源	4	1,236,376,150.23	8.89	—	—	—	—	—	—	1,134,734.67	8.91	—
兴业证券	2	883,206,197.66	6.35	—	—	—	—	—	—	804,864.56	6.32	—

浙商证券	1	1,896,527,038.89	13.64	—	—	—	—	—	—	1,743,773.54	13.69	—
中泰证券	1	797,868,368.39	5.74	2,503,948.10	27.14	—	—	—	—	727,108.85	5.71	—
中信建投	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中信证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

注：我对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。本报告期本基金新增券商交易单元：开源证券（54421、014691）。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	富国基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具准则的公告	规定披露媒介	2022年01月01日
2	富国基金管理有限公司关于调整旗下基金长期停牌股票估值方法的公告	规定披露媒介	2022年04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

注：本基金本报告期无单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情况。

§ 12 备查文件目录

备查文件名称	备查文件存放地点	备查文件查阅方式
1、中国证监会批准设立富国中证 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 : http://www.fullgoal.com.cn 。