

富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）

二〇二二年中期报告

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	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	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	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（基金净值）变动表	22
6.4	报表附注	23
§7	投资组合报告	62
7.1	期末基金资产组合情况	62

7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	62
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.....	63
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	80
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	82
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.....	82
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	82
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.....	82
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.....	83
7.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	83
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	83
7.12	投资组合报告附注.....	83
§8	基金份额持有人信息.....	85
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	85
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	85
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	85
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.....	86
§9	开放式基金份额变动.....	87
§10	重大事件揭示.....	88
10.1	基金份额持有人大会决议.....	88
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.....	88
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	88
10.4	基金投资策略的改变.....	88
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	88
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.....	88
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	89
10.8	其他重大事件.....	91
§11	影响投资者决策的其他重要信息.....	92
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.....	92
§12	备查文件目录.....	93

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国中证 1000 指数增强型证券投资基金 (LOF)	
基金简称	富国中证 1000 指数增强 (LOF)	
场内简称	1000 增强 LOF	
基金主代码	161039	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 05 月 31 日	
基金管理人	富国基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额 (单位: 份)	1,424,795,337.13	
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	2018 年 6 月 20 日	
下属分级基金的基金简称	富国中证 1000 指数增强 A	富国中证 1000 指数增强 C
下属分级基金场内简称	1000 增强 LOF	—
下属分级基金的交易代码	161039	013331
报告期末下属分级基金的份额总额 (单位: 份)	1,229,965,516.48	194,829,820.65

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 1000 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。本基金在复制目标指数的基础上一定程度地调整个股，力求投资收益能够跟踪并适度超越目标指数。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 8%。本基金的股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生工具投资策略及参与转融通证券出借业务策略详见法律文件。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、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 1000 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	-152,392,649.20
本期利润	-87,193,799.24
加权平均基金份额本期利润	-0.0843
本期加权平均净值利润率	-4.48%
本期基金份额净值增长率	-5.62%
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	855,686,388.26
期末可供分配基金份额利润	0.6957
期末基金资产净值	2,476,117,415.15
期末基金份额净值	2.0132
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	101.32%

(2) 富国中证 1000 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	-26,524,587.51
本期利润	-38,648,960.65
加权平均基金份额本期利润	-0.1980
本期加权平均净值利润率	-10.43%
本期基金份额净值增长率	-5.72%
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	134,910,319.55
期末可供分配基金份额利润	0.6925
期末基金资产净值	391,548,021.51
期末基金份额净值	2.0097
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	-2.49%

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 1000 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	11.19%	1.27%	9.59%	1.24%	1.60%	0.03%
过去三个月	6.30%	1.88%	3.20%	1.95%	3.10%	-0.07%
过去六个月	-5.62%	1.70%	-11.98%	1.78%	6.36%	-0.08%
过去一年	3.71%	1.42%	-1.02%	1.51%	4.73%	-0.09%
过去三年	90.45%	1.38%	30.26%	1.44%	60.19%	-0.06%
自基金合同生效起至今	101.32%	1.38%	12.36%	1.51%	88.96%	-0.13%

(2) 富国中证 1000 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	11.17%	1.27%	9.59%	1.24%	1.58%	0.03%
过去三个月	6.24%	1.88%	3.20%	1.95%	3.04%	-0.07%
过去六个月	-5.72%	1.70%	-11.98%	1.78%	6.26%	-0.08%
自基金分级生效日起至今	-2.49%	1.46%	-5.89%	1.54%	3.40%	-0.08%

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

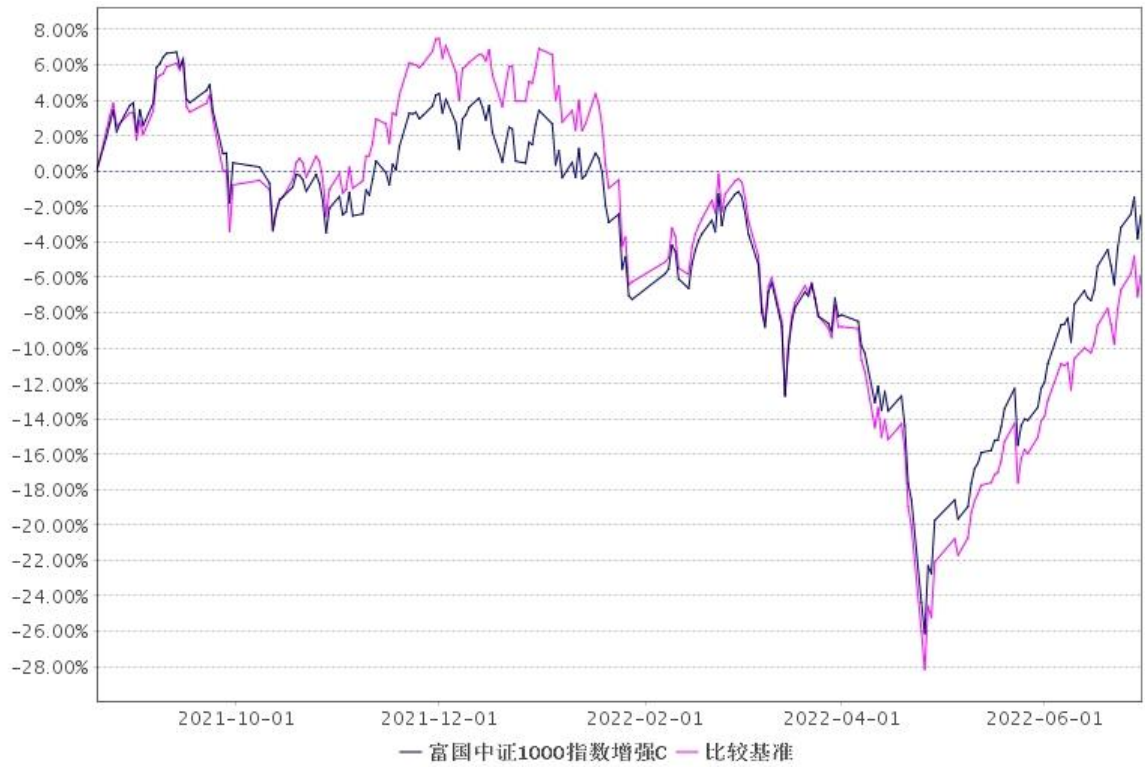
(1) 自基金合同生效以来富国中证 1000 指数增强 A 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为2022年6月30日。

2、本基金于2018年5月31日成立，建仓期6个月，从2018年5月31日起至2018年11月29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1000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	2018-05-31	—	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>
徐幼华	本基金基金经理	2018-05-31	—	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</p>

					<p>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

本报告期内，富国基金管理有限公司作为富国中证1000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1000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 7 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 级为 2.0132 元，C 级为 2.0097 元；份额累计净值 A 级为 2.0132 元，C 级为 2.0097 元；本报告期，本基金份额净值增长率 A 级为-5.62%，C 级为-5.72%，同期业绩比较基准收益率 A 级为-11.98%，C 级为-11.98%

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 1000 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	276,327,019.26	192,522,031.94
结算备付金	5,478,992.24	5,870,368.08
存出保证金	536,606.75	713,948.29
交易性金融资产	2,594,432,209.48	1,990,358,026.60
其中：股票投资	2,594,324,202.15	1,988,142,481.20
基金投资	—	—
债券投资	108,007.33	2,215,545.40
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	—	—
应收股利	108,806.78	—
应收申购款	3,763,513.79	2,140,451.29
递延所得税资产	—	—
其他资产	29,981.40	57,829.74
资产总计	2,880,677,129.70	2,191,662,655.94
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	45,125.70	—
应付赎回款	7,071,123.87	13,740,905.53
应付管理人报酬	2,065,891.19	1,864,167.74
应付托管费	309,883.69	279,625.18

应付销售服务费	54,939.25	65,310.72
应付投资顾问费	—	—
应交税费	9,437.80	8.65
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	3,455,291.54	3,571,184.04
负债合计	13,011,693.04	19,521,201.86
净资产：		
实收基金	1,424,795,337.13	1,018,427,188.78
其他综合收益	—	—
未分配利润	1,442,870,099.53	1,153,714,265.30
净资产合计	2,867,665,436.66	2,172,141,454.08
负债和净资产总计	2,880,677,129.70	2,191,662,655.94

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.0127 元，基金份额总额 1,424,795,337.13 份。其中：富国中证 1000 指数增强 A 份额净值 2.0132 元，份额总额 1,229,965,516.48 份；富国中证 1000 指数增强 C 份额净值 2.0097 元，份额总额 194,829,820.65 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 1000 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	-112,056,930.14	43,475,367.84
1.利息收入	1,414,094.95	88,281.15

其中：存款利息收入	761,715.37	81,201.86
债券利息收入	—	109.42
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	—	6,969.87
证券出借利息收入	652,379.58	—
其他利息收入	—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）	-167,513,955.38	17,620,051.38
其中：股票投资收益	-188,156,364.61	15,148,498.37
基金投资收益	—	—
债券投资收益	707,535.45	72,963.44
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	19,934,873.78	2,398,589.57
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）	53,074,476.82	25,528,599.90
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	968,453.47	238,435.41
减：二、营业总支出	13,785,829.75	2,099,377.61
1. 管理人报酬	11,425,570.71	1,184,579.63
2. 托管费	1,713,835.59	177,686.99
3. 销售服务费	365,967.14	—
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	2,350.45	0.32
8. 其他费用	278,105.86	737,110.67
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-125,842,759.89	41,375,990.23
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-125,842,759.89	41,375,990.23
五、其他综合收益的税后净额	—	—
六、综合收益总额	-125,842,759.89	41,375,990.23

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 1000 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)	1,018,427,188.78	1,153,714,265.30	2,172,141,454.08
加：会计政策变更	—	—	—
二、本期期初净资产 (基金净值)	1,018,427,188.78	1,153,714,265.30	2,172,141,454.08
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	406,368,148.35	289,155,834.23	695,523,982.58
(一)、综合收益总额	—	-125,842,759.89	-125,842,759.89
(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)	406,368,148.35	414,998,594.12	821,366,742.47
其中：1. 基金申购款	973,813,984.91	905,352,517.57	1,879,166,502.48
2. 基金赎回款	-567,445,836.56	-490,353,923.45	—
			1,057,799,760.01
(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)	1,424,795,337.13	1,442,870,099.53	2,867,665,436.66
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)	118,156,134.78	79,790,160.19	197,946,294.97
加：会计政策变更	—	—	—
二、本期期初净资产 (基金净值)	118,156,134.78	79,790,160.19	197,946,294.97
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	114,880,479.05	139,521,099.28	254,401,578.33

(一)、综合收益总额	—	41,375,990.23	41,375,990.23
(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)	114,880,479.05	98,145,109.05	213,025,588.10
其中：1.基金申购款	209,006,316.79	168,418,914.19	377,425,230.98
2.基金赎回款	-94,125,837.74	-70,273,805.14	-164,399,642.88
(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)	233,036,613.83	219,311,259.47	452,347,873.30

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

陈戈

林志松

徐慧

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

富国中证 1000 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[2018]30 号文《关于准予富国中证 1000 指数增强型证券投资基金 (LOF) 注册的批复》的核准, 由富国基金管理有限公司作为管理人向社会公开发行募集。基金合同于 2018 年 5 月 31 日正式生效, 首次设立募集规模为 512,114,043.76 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。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具, 包括中证 1000 指数的成份股、备选成份股、其他股票 (包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股

票)、存托凭证、国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、资产支持证券、质押及买断式回购、银行存款(包括银行定期存款、银行协议存款、银行通知存款等)、同业存单、衍生工具(股指期货、权证等)及法律法规或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)。本基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:本基金的股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产的 80%,其中投资于中证 1000 指数成份股和备选成份股的资产(均含存托凭证)不低于非现金基金资产的 80%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%;其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制,基金管理人在履行适当程序后,以变更后的比例为准,本基金的投资比例会做相应调整。

本基金的业绩比较基准为:中证 1000 指数收益率 \times 95%+银行人民币活期存款利率(税后) \times 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(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) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

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

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 192,522,031.94 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 39,599.51 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 192,561,631.45 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 5,870,368.08 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 2,905.87 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 5,873,273.95 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 713,948.29 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 353.43 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 714,301.72 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 57,829.74 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 39,599.51 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 2,905.87 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 353.43 元，转出至其他资产的重分类金额为人民币 14,909.45 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 61.48 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。

其他资产于 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 0.00 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 14,909.45 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，其他资产于 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 14,909.45 元。

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 1,990,358,026.60 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 61.48 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 1,990,358,088.08 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	276,327,019.26
等于：本金	276,275,768.85
加：应计利息	51,250.41
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	276,327,019.26

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	2,465,367,90 3.06	—	2,594,324,20 2.15	128,956,299. 09
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—
债券	交易所市场	108,000.00	108,007.33	—
	银行间市场	—	—	—
	合计	108,000.00	108,007.33	—
资产支持证券	—	—	—	—
基金	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	2,465,475,90 3.06	7.33	2,594,432,20 9.48	128,956,299. 09

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

单位：人民币元

项目	本期末（2022年06月30日）
应收利息	—
其他应收款	—
待摊费用	—

转融通证券出借利息	29,981.40
合计	29,981.40

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	21,520.09
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	3,032,544.63
其中：交易所市场	3,032,544.63
银行间市场	—
应付利息	—
预提信息披露费	60,000.00
预提审计费	57,273.08
应付指数使用费	283,953.74
合计	3,455,291.54

6.4.7.7实收基金

富国中证1000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	815,445,341.41	815,445,341.41
本期申购	817,409,809.12	817,409,809.12
本期赎回（以“-”号填列）	-402,889,634.05	-402,889,634.05
本期末	1,229,965,516.48	1,229,965,516.48

富国中证1000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	202,981,847.37	202,981,847.37
本期申购	156,404,175.79	156,404,175.79
本期赎回（以“-”号填列）	-164,556,202.51	-164,556,202.51
本期末	194,829,820.65	194,829,820.65

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1000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	680,674,772.84	243,341,775.22	924,016,548.06
本期利润	—	65,198,849.96	-87,193,799.24

	152,392,649.20		
本期基金份额交易产生的变动数	327,404,264.62	81,924,885.23	409,329,149.85
其中：基金申购款	627,955,305.37	136,722,189.73	764,677,495.10
基金赎回款	300,551,040.75	-54,797,304.50	-355,348,345.25
本期已分配利润	—	—	—
本期末	855,686,388.26	390,465,510.41	1,246,151,898.67

富国中证1000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	169,127,030.53	60,570,686.71	229,697,717.24
本期利润	-26,524,587.51	12,124,373.14	-38,648,960.65
本期基金份额交易产生的变动数	-7,692,123.47	13,361,567.74	5,669,444.27
其中：基金申购款	115,763,790.29	24,911,232.18	140,675,022.47
基金赎回款	123,455,913.76	11,549,664.44	-135,005,578.20
本期已分配利润	—	—	—
本期末	134,910,319.55	61,807,881.31	196,718,200.86

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	686,684.51
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	42,037.20
其他	32,993.66
合计	761,715.37

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年06月30日）
股票投资收益——买卖股票差价收入	-188,156,364.61
股票投资收益——证券出借差价收入	—
合计	-188,156,364.61

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年06月30日）
卖出股票成交总额	2,999,290,846.47
减：卖出股票成本总额	3,177,670,240.32
减：交易费用	9,776,970.76
买卖股票差价收入	-188,156,364.61

6.4.7.10.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期末无股票投资收益证券出借差价收入。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

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	1,077.90
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	706,457.55
合计	707,535.45

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	4,184,214.37
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	3,476,600.00
减：应计利息总额	1,147.23
减：交易费用	9.59
债券投资收益-差价收入	706,457.55

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	19,934,873.78
其中：证券出借权益补偿收入	813,370.46
基金投资产生的股利收益	—
合计	19,934,873.78

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	53,074,476.82
股票投资	53,115,022.22
债券投资	-40,545.40
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	53,074,476.82

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	967,311.96
转换费收入	1,141.51
合计	968,453.47

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	27,273.08
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	8,023.68
指数使用费	182,809.10
合计	278,105.86

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
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东、基金代销机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
申万宏源证券承销保荐有限责任公司（“申万宏源承销保荐”）	基金管理人的股东控制的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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	644,509,290.02	9.60	11,721,533.68	2.90
申万宏源	686,819,487.83	10.23	51,654,832.98	12.78

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（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	—	—	172,488.40	38.06

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 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	628,489.81	10.23	294,243.84	9.70
海通证券	590,075.01	9.61	316,442.87	10.43
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	47,065.35	12.78	44,916.73	15.45
海通证券	10,682.09	2.90	4,353.04	1.50

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

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	11,425,570.71	1,184,579.63
其中：支付销售机构的客户维护费	2,259,434.19	263,533.24

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.0%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.0\% / \text{当年天数}$$

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	1,713,835.59	177,686.99

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，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1000指数 增强A	富国中证1000指数 增强C	合计
富国基金管理有限公司	—	195,422.90	195,422.90

海通证券股份有限公司	—	119.23	119.23
申万宏源证券有限公司	—	224.55	224.55
合计	—	195,766.68	195,766.68

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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

单位：人民币元

本期（2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日）				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
申万宏源	15,277,600.00	9,133.82	2,350,500.00	766.83

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（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1000指数增强A	富国中证1000指数增强C	富国中证1000指数增强A	富国中证1000指数增强C
基金合同生效日（2018年05月31日）持有的基金份额	—	—	—	—
期初持有的基金份额	14,851,583.18	485.18	8,014,588.01	—
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	14,851,583.18	485.18	8,014,588.01	—
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.21%	0.00%	3.44%	—

注：本基金管理人投资本基金按照公告的费率条款执行，不存在费率优惠的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期（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	276,327,019.26	686,684.51	40,816,170.54	77,179.23

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期（2022年01月01日至2022年06月30日）					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
申万宏源证券承销	688267	中触媒	IPO网下	3,390	142,751.21

保荐有限责任公司			申购		
海通证券股份有限公司	688062	迈威生物	IPO 网下申购	27,002	944,367.95
海通证券股份有限公司	688220	翱捷科技	IPO 网下申购	11,039	1,825,438.85

金额单位：人民币元

上年度可比期间（2021年01月01日至2021年06月30日）					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
海通证券股份有限公司	300981	中红医疗	IPO 网下申购	2,016	97,957.44
申万宏源证券承销保荐有限责任公司	300937	药易购	IPO 网下申购	2,434	29,816.50
海通证券股份有限公司	688217	睿昂基因	IPO 网下申购	1,040	19,252.58
海通证券股份有限公司	688685	迈信林	IPO 网下申购	2,612	23,678.04
海通证券股份有限公司	688682	霍莱沃	IPO 网下申购	946	43,467.38
海通证券股份有限公司	688092	爱科科技	IPO 网下申购	1,137	21,836.71
海通证券股份有限公司	688626	翔宇医疗	IPO 网下申购	2,035	58,941.94
海通证券股份有限公司	688329	艾隆科技	IPO 网下申购	1,846	31,186.42
海通证券股份有限公司	688665	四方光电	IPO 网下申购	1,687	50,066.20
海通证券股份有限公司	688687	凯因科技	IPO 网下申购	3,710	70,767.88

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（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
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	—
605111	新洁能	2022-02-24	6个月	大宗交易限售	161.12	120.06	32,000	5,155,840.00	3,841,920.00	—
605111	新洁能	2022-04-27	4个月	大宗交易限售_转增	—	120.06	12,800	—	1,536,768.00	—

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
123148	上能转债	2022-06-14	1个月	认购新发证券	100.00	100.01	629	62,900.00	62,907.03	—
123150	九强转债	2022-06-30	1个月	认购新发	100.00	100.00	451	45,100.00	45,100.30	—

				证券	0				
--	--	--	--	----	---	--	--	--	--

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 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值 单价	数量（单位： 股）	期末估值总额
1	000592	平潭发展	2022 年 07 月 07 日-2022 年 07 月 14 日	2.63	280,400	737,452.00
2	002413	雷科防务	2022 年 07 月 04 日-2022 年 07 月 14 日	5.55	258,100	1,432,455.00
3	300170	汉得信息	2022 年 07 月 04 日-2022 年 07 月 14 日	9.01	212,400	1,913,724.00
4	002517	恺英网络	2022 年 07 月 04 日-2022 年 07 月 07 日	5.58	209,700	1,170,126.00
5	002567	唐人神	2022 年 07 月 01 日-2022 年 07 月 14 日	8.51	205,100	1,745,401.00
6	600929	雪天盐业	2022 年 07 月 06 日-2022 年 07 月 14 日	9.28	203,900	1,892,192.00
7	000560	我爱我家	2022 年 07 月	2.88	194,700	560,736.00

			05日-2022 年07月14 日			
8	000933	神火股份	2022年07月 05日-2022 年07月11 日	13.08	189,500	2,478,660.00
9	002611	东方精工	2022年07月 07日-2022 年07月14 日	5.20	185,000	962,000.00
10	601588	北辰实业	2022年07月 06日-2022 年07月14 日	2.34	164,300	384,462.00
11	600100	同方股份	2022年07月 07日-2022 年07月14 日	4.45	153,600	683,520.00
12	002449	国星光电	2022年07月 06日-2022 年07月14 日	8.09	143,400	1,160,106.00
13	002243	力合科创	2022年07月 01日-2022 年07月14 日	9.65	142,400	1,374,160.00
14	300065	海兰信	2022年07月 01日-2022 年07月08 日	13.10	140,500	1,840,550.00
15	600308	华泰股份	2022年07月 07日-2022 年07月14 日	5.71	140,300	801,113.00
16	000761	本钢板材	2022年07月 07日	3.60	132,800	478,080.00
17	600662	外服控股	2022年07月 06日-2022 年07月14 日	6.75	127,700	861,975.00
18	603118	共进股份	2022年07月 14日	7.42	122,000	905,240.00
19	600531	豫光金铅	2022年07月	5.27	121,300	639,251.00

			06日-2022 年07月14 日			
20	000612	焦作万方	2022年07月 04日-2022 年07月14 日	6.21	100,500	624,105.00
21	600864	哈投股份	2022年07月 11日	5.03	100,000	503,000.00
22	600063	皖维高新	2022年07月 07日-2022 年07月14 日	7.58	92,900	704,182.00
23	600491	龙元建设	2022年07月 04日-2022 年07月08 日	6.82	91,400	623,348.00
24	002261	拓维信息	2022年07月 06日-2022 年07月14 日	6.41	87,900	563,439.00
25	002091	江苏国泰	2022年07月 05日-2022 年07月06 日	10.75	86,400	928,800.00
26	601872	招商轮船	2022年07月 14日	5.76	81,000	466,560.00
27	002239	奥特佳	2022年07月 13日-2022 年07月14 日	3.05	80,400	245,220.00
28	300401	花园生物	2022年07月 04日	17.34	80,000	1,387,200.00
29	600742	一汽富维	2022年07月 08日-2022 年07月14 日	9.28	78,800	731,264.00
30	600873	梅花生物	2022年07月 06日	11.28	78,200	882,096.00
31	000090	天健集团	2022年07月 08日-2022 年07月14 日	6.89	75,600	520,884.00
32	000848	承德露露	2022年07月	9.68	75,200	727,936.00

			04日			
33	000918	嘉凯城	2022年07月07日-2022年07月14日	2.30	72,700	167,210.00
34	002733	雄韬股份	2022年07月08日-2022年07月13日	17.41	72,300	1,258,743.00
35	002436	兴森科技	2022年07月04日-2022年07月14日	11.27	68,500	771,995.00
36	000552	靖远煤电	2022年07月07日-2022年07月08日	4.31	68,200	293,942.00
37	600123	兰花科创	2022年07月05日-2022年07月12日	16.45	66,800	1,098,860.00
38	300900	广联航空	2022年07月05日-2022年07月14日	26.70	65,100	1,738,170.00
39	300130	新国都	2022年07月04日-2022年07月13日	12.26	63,800	782,188.00
40	300457	赢合科技	2022年07月04日-2022年07月12日	28.41	61,400	1,744,374.00
41	600641	万业企业	2022年07月06日-2022年07月14日	19.50	60,800	1,185,600.00
42	000969	安泰科技	2022年07月07日-2022年07月14日	8.92	58,500	521,820.00
43	603128	华贸物流	2022年07月07日-2022年07月14日	10.03	56,800	569,704.00

			日			
44	600330	天通股份	2022年07月04日-2022年07月11日	11.91	56,000	666,960.00
45	000034	神州数码	2022年07月04日-2022年07月05日	15.22	55,400	843,188.00
46	002130	沃尔核材	2022年07月07日-2022年07月14日	6.14	54,400	334,016.00
47	300101	振芯科技	2022年07月06日-2022年07月14日	20.64	51,100	1,054,704.00
48	002597	金禾实业	2022年07月04日	43.33	50,000	2,166,500.00
49	600089	特变电工	2022年07月04日	27.39	50,000	1,369,500.00
50	000921	海信家电	2022年07月07日-2022年07月14日	14.18	49,900	707,582.00
51	688033	天宜上佳	2022年07月07日-2022年07月14日	21.24	49,400	1,049,256.00
52	000035	中国天楹	2022年07月07日-2022年07月14日	5.25	48,400	254,100.00
53	300397	天和防务	2022年07月07日-2022年07月13日	10.41	48,000	499,680.00
54	000762	西藏矿业	2022年07月05日-2022年07月14日	55.93	43,700	2,444,141.00
55	600007	中国国贸	2022年07月12日-2022年07月14日	14.75	41,300	609,175.00

			日			
56	601606	长城军工	2022年07月07日-2022年07月14日	11.61	37,000	429,570.00
57	601949	中国出版	2022年07月07日-2022年07月14日	4.82	37,000	178,340.00
58	002498	汉缆股份	2022年07月07日-2022年07月14日	4.25	36,600	155,550.00
59	600710	苏美达	2022年07月07日-2022年07月14日	5.90	36,300	214,170.00
60	002285	世联行	2022年07月14日	3.26	36,000	117,360.00
61	002217	合力泰	2022年07月07日	3.13	35,400	110,802.00
62	600639	XD 浦东金	2022年07月08日-2022年07月14日	13.59	34,400	467,496.00
63	000915	华特达因	2022年07月08日-2022年07月11日	41.35	34,200	1,414,170.00
64	600970	中材国际	2022年07月05日	9.69	33,000	319,770.00
65	001696	宗申动力	2022年07月07日-2022年07月14日	6.33	31,500	199,395.00
66	000823	超声电子	2022年07月12日	10.34	30,000	310,200.00
67	000810	创维数字	2022年07月08日	16.21	30,000	486,300.00
68	000036	华联控股	2022年07月14日	4.32	28,700	123,984.00
69	600328	中盐化工	2022年07月12日	23.55	28,400	668,820.00
70	002468	申通快递	2022年07月	11.92	28,400	338,528.00

			14日			
71	688277	天智航	2022年07月04日-2022年07月07日	14.39	28,300	407,237.00
72	688066	航天宏图	2022年07月04日	78.80	25,700	2,025,160.00
73	600577	精达股份	2022年07月14日	5.55	25,000	138,750.00
74	000903	云内动力	2022年07月07日	3.03	24,500	74,235.00
75	000989	九芝堂	2022年07月14日	9.10	23,600	214,760.00
76	002176	江特电机	2022年07月06日	25.04	23,000	575,920.00
77	600850	电科数字	2022年07月07日-2022年07月14日	18.66	22,300	416,118.00
78	002662	京威股份	2022年07月07日	3.63	21,500	78,045.00
79	000910	大亚圣象	2022年07月07日-2022年07月14日	9.17	20,600	188,902.00
80	600565	迪马股份	2022年07月07日	2.32	19,300	44,776.00
81	000539	粤电力A	2022年07月14日	4.20	19,200	80,640.00
82	688586	江航装备	2022年07月04日-2022年07月06日	26.61	18,000	478,980.00
83	300770	新媒股份	2022年07月06日	37.83	17,800	673,374.00
84	301155	海力风电	2022年07月05日-2022年07月12日	91.00	17,000	1,547,000.00
85	688278	特宝生物	2022年07月01日	29.48	17,000	501,160.00
86	600888	新疆众和	2022年07月13日	9.20	15,800	145,360.00
87	300666	江丰电子	2022年07月	61.00	14,100	860,100.00

			04日-2022 年07月14 日			
88	300226	上海钢联	2022年07月 11日	22.65	13,800	312,570.00
89	600331	宏达股份	2022年07月 12日	3.35	13,700	45,895.00
90	600428	中远海特	2022年07月 13日	4.76	13,500	64,260.00
91	002182	云海金属	2022年07月 08日	25.08	13,000	326,040.00
92	600810	神马股份	2022年07月 14日	9.00	12,100	108,900.00
93	300476	胜宏科技	2022年07月 06日	18.36	11,800	216,648.00
94	688508	芯朋微	2022年07月 14日	74.50	11,600	864,200.00
95	300339	润和软件	2022年07月 07日	17.95	10,900	195,655.00
96	688556	高测股份	2022年07月 08日	80.70	10,200	823,140.00
97	688399	硕世生物	2022年07月 05日	114.02	10,000	1,140,200.00
98	000566	海南海药	2022年07月 07日	4.57	10,000	45,700.00
99	600389	江山股份	2022年07月 01日	60.73	10,000	607,300.00
100	002274	华昌化工	2022年07月 07日	9.74	10,000	97,400.00
101	300373	扬杰科技	2022年07月 07日-2022 年07月14 日	71.25	9,500	676,875.00
102	300346	南大光电	2022年07月 04日	35.98	7,100	255,458.00
103	300118	东方日升	2022年07月 07日	29.33	7,000	205,310.00
104	688516	奥特维	2022年07月 06日-2022 年07月08 日	266.95	6,000	1,601,700.00
105	688016	心脉医疗	2022年07月 01日	194.81	3,000	584,430.00
106	688037	芯源微	2022年07月	144.97	3,000	434,910.00

			07日			
107	300861	美畅股份	2022年07月12日	92.69	2,600	240,994.00
108	688200	华峰测控	2022年07月06日	356.40	2,200	784,080.00
109	688568	中科星图	2022年07月07日	67.76	1,900	128,744.00
110	300236	上海新阳	2022年07月07日	33.10	1,200	39,720.00
111	688315	诺禾致源	2022年07月08日	25.77	1,000	25,770.00
112	688356	键凯科技	2022年07月07日	241.81	1,000	241,810.00
113	300327	中颖电子	2022年07月04日	49.81	1,000	49,810.00
114	300398	飞凯材料	2022年07月04日	22.86	1,000	22,860.00
合计	-	-	-	-	6,795,600.00	77,185,996.00

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	—	2,070,000.00
AAA 以下	108,007.33	145,545.40
未评级	—	—
合计	108,007.33	2,215,545.40

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，包括其他价格风险、利率风险和外汇风险。

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，并按照合同约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	276,327,019.26	—	—	—	—	—	276,327,019.26
结算备付金	5,478,992.24	—	—	—	—	—	5,478,992.24
存出保证金	536,606.75	—	—	—	—	—	536,606.75
交易性金融资产	—	—	108,007.33	—	—	2,594,324,202.15	2,594,432,209.48
应收股利	—	—	—	—	—	108,806.78	108,806.78
其他资产	—	—	—	—	—	29,981.40	29,981.40
应收申购款	242,944.79	—	—	—	—	3,520,569.00	3,763,513.79
资产总计	282,585,563.04	—	108,007.33	—	—	2,597,983,559.33	2,880,677,129.70
负债							
应付清算款	—	—	—	—	—	45,125.70	45,125.70
应付赎回款	—	—	—	—	—	7,071,123.87	7,071,123.87
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	2,065,891.19	2,065,891.19
应付托管费	—	—	—	—	—	309,883.69	309,883.69
应付销售服务费	—	—	—	—	—	54,939.25	54,939.25
应交税费	—	—	—	—	—	9,437.80	9,437.80
其他负债	—	—	—	—	—	3,455,291.54	3,455,291.54
负债总计	—	—	—	—	—	13,011,693.04	13,011,693.04
利率敏感度缺口	282,585,563.04	—	108,007.33	—	—	2,584,971,866.29	2,867,665,436.66
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	192,522,031.94	—	—	—	—	—	192,522,031.94
结算备付金	5,870,368.08	—	—	—	—	—	5,870,368.08
存出保证金	713,948.29	—	—	—	—	—	713,948.29
交易性金融资产	—	—	2,215,545.40	—	—	1,988,142,481.20	1,990,358,026.60
应收申购款	73,209.13	—	—	—	—	2,067,242.16	2,140,451.29
其他资产	—	—	—	—	—	57,829.74	57,829.74
资产总计	199,179,557.44	—	2,215,545.40	—	—	1,990,267,553.10	2,191,662,655.94
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	13,740,905.53	13,740,905.53
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	1,864,167.74	1,864,167.74
应付托管费	—	—	—	—	—	279,625.18	279,625.18
应付销售服务费	—	—	—	—	—	65,310.72	65,310.72
应交税费	—	—	—	—	—	8.65	8.65
其他负债	—	—	—	—	—	3,571,184.04	3,571,184.04
负债总计	—	—	—	—	—	19,521,201.86	19,521,201.86
利率敏感度缺口	199,179,557.44	—	2,215,545.40	—	—	1,970,746,351.24	2,172,141,454.08

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

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证 1000 指数的成份股、备选成份股、其他股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、质押及买断式回购、银行存款（包括银行定期存款、银行协议存款、银行通知存款等）、同业存单、衍生工具（股指期货、权证等）及法律法规或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）。

基金的投资组合比例为：本基金的股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中证 1000 指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的资产不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末（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	2,594,324,202.15	90.47	1,988,142,481.20	91.53
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	108,007.33	0.00	2,215,545.40	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	2,594,432,209.48	90.47	1,990,358,026.60	91.63

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%	27,104,693.12	20,333,098.47
2. 业绩比较基准减少 1%	-27,104,693.12	-20,333,098.47	

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 (2022年06月30日)	上年度末 (2021年12月31日)
第一层次	2,588,607,336.10	1,948,895,503.86
第二层次	108,007.33	2,075,504.49
第三层次	5,716,866.05	39,387,018.25
合计	2,594,432,209.48	1,990,358,026.60

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,594,324,202.15	90.06
	其中：股票	2,594,324,202.15	90.06
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	108,007.33	0.00
	其中：债券	108,007.33	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	281,806,011.50	9.78
8	其他各项资产	4,438,908.72	0.15
9	合计	2,880,677,129.70	100.00

注：本基金通过转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 77,185,996.00 元，占资产净值比例为 2.69%。

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	1,013,210.00	0.04
B	采矿业	14,049,992.00	0.49
C	制造业	335,620,237.32	11.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,849,052.00	0.38
E	建筑业	7,860,643.00	0.27
F	批发和零售业	6,531,072.00	0.23
G	交通运输、仓储和邮政业	24,209,423.00	0.84
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	33,524,717.81	1.17
J	金融业	292,992.00	0.01

K	房地产业	8,717,285.00	0.30
L	租赁和商务服务业	1,819,551.00	0.06
M	科学研究和技术服务业	1,697,798.74	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	29,665.32	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	4,341,560.00	0.15
R	文化、体育和娱乐业	1,319,873.00	0.05
S	综合	—	—
	合计	451,877,072.19	15.76

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	15,026,420.82	0.52
B	采矿业	40,484,550.25	1.41
C	制造业	1,531,603,623.51	53.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	26,732,917.05	0.93
E	建筑业	35,210,891.15	1.23
F	批发和零售业	45,518,237.82	1.59
G	交通运输、仓储和邮政业	35,113,629.50	1.22
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	181,214,177.12	6.32
J	金融业	46,461,116.40	1.62
K	房地产业	44,929,405.00	1.57
L	租赁和商务服务业	34,184,988.41	1.19
M	科学研究和技术服务业	16,261,977.67	0.57
N	水利、环境和公共设施管理业	59,724,139.00	2.08
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	1,994,653.72	0.07
R	文化、体育和娱乐业	27,986,402.54	0.98
S	综合	—	—
	合计	2,142,447,129.96	74.71

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	600873	梅花生物	2,945,400	33,224,112.00	1.16
2	300457	赢合科技	1,072,000	30,455,520.00	1.06
3	002405	四维图新	1,858,300	28,004,581.00	0.98
4	300432	富临精工	1,129,250	24,843,500.00	0.87
5	688388	嘉元科技	283,831	24,088,736.97	0.84
6	688050	爱博医疗	93,336	20,925,931.20	0.73
7	300803	指南针	345,900	20,332,002.00	0.71
8	300604	长川科技	448,030	20,228,554.50	0.71
9	300476	胜宏科技	1,087,000	19,957,320.00	0.70
10	600481	双良节能	1,173,400	19,771,790.00	0.69
11	300224	正海磁材	1,268,700	19,411,110.00	0.68
12	300346	南大光电	516,980	18,600,940.40	0.65
13	000933	神火股份	1,396,400	18,264,912.00	0.64
14	002585	双星新材	990,600	17,919,954.00	0.62
15	300568	星源材质	614,983	17,859,106.32	0.62
16	002597	金禾实业	411,100	17,812,963.00	0.62
17	688508	芯朋微	237,597	17,700,976.50	0.62
18	600929	雪天盐业	1,859,969	17,260,512.32	0.60
19	002832	比音勒芬	684,685	17,254,062.00	0.60
20	300653	正海生物	305,400	17,102,400.00	0.60
21	603236	移远通信	127,179	16,998,745.14	0.59
22	300130	新国都	1,385,660	16,988,191.60	0.59
23	002545	东方铁塔	1,492,600	16,985,788.00	0.59
24	603599	广信股份	600,480	16,903,512.00	0.59
25	600531	豫光金铅	3,130,000	16,495,100.00	0.58
26	300393	中来股份	943,700	16,042,900.00	0.56
27	300170	汉得信息	1,758,300	15,842,283.00	0.55
28	300696	爱乐达	360,388	15,839,052.60	0.55
29	600057	厦门象屿	1,799,620	15,818,659.80	0.55
30	300401	花园生物	911,700	15,808,878.00	0.55
31	603008	喜临门	421,788	15,479,619.60	0.54
32	688116	天奈科技	90,795	15,387,936.60	0.54
33	688066	航天宏图	193,611	15,256,546.80	0.53
34	600389	江山股份	249,700	15,164,281.00	0.53
35	002738	中矿资源	161,500	14,956,515.00	0.52
36	300222	科大智能	1,824,448	14,705,050.88	0.51
37	688516	奥特维	54,584	14,571,198.80	0.51
38	600710	苏美达	2,436,247	14,373,857.30	0.50
39	002085	万丰奥威	2,636,000	14,155,320.00	0.49
40	300770	新媒股份	368,000	13,921,440.00	0.49
41	000762	西藏矿业	247,900	13,865,047.00	0.48

42	002539	云图控股	864,700	13,826,553.00	0.48
43	002035	华帝股份	2,358,415	13,725,975.30	0.48
44	300398	飞凯材料	600,200	13,720,572.00	0.48
45	688016	心脉医疗	68,953	13,432,733.93	0.47
46	000969	安泰科技	1,492,012	13,308,747.04	0.46
47	603688	石英股份	98,742	13,094,176.62	0.46
48	300861	美畅股份	140,400	13,013,676.00	0.45
49	300118	东方日升	438,600	12,864,138.00	0.45
50	000090	天健集团	1,842,785	12,696,788.65	0.44
51	688037	芯源微	87,400	12,670,378.00	0.44
52	300900	广联航空	473,200	12,634,440.00	0.44
53	300065	海兰信	952,725	12,480,697.50	0.44
54	603529	爱玛科技	233,240	12,217,111.20	0.43
55	300772	运达股份	475,300	12,091,632.00	0.42
56	300639	凯普生物	549,367	11,745,466.46	0.41
57	300083	创世纪	1,020,700	11,738,050.00	0.41
58	002645	华宏科技	534,500	11,662,790.00	0.41
59	300768	迪普科技	721,300	11,648,995.00	0.41
60	000560	我爱我家	3,979,600	11,461,248.00	0.40
61	002567	唐人神	1,343,000	11,428,930.00	0.40
62	002243	力合科创	1,161,900	11,212,335.00	0.39
63	601330	绿色动力	1,422,900	11,141,307.00	0.39
64	600211	西藏药业	268,262	11,135,555.62	0.39
65	300355	蒙草生态	2,802,900	11,043,426.00	0.39
66	000034	神州数码	724,477	11,026,539.94	0.38
67	000915	华特达因	264,300	10,928,805.00	0.38
68	000612	焦作万方	1,753,037	10,886,359.77	0.38
69	600123	兰花科创	648,700	10,671,115.00	0.37
70	688298	东方生物	92,970	10,612,525.50	0.37
71	300382	斯莱克	675,200	10,580,384.00	0.37
72	000498	山东路桥	1,073,500	10,370,010.00	0.36
73	300397	天和防务	994,500	10,352,745.00	0.36
74	300867	圣元环保	486,200	10,171,304.00	0.35
75	002034	旺能环境	489,200	10,043,276.00	0.35
76	601949	中国出版	2,070,066	9,977,718.12	0.35
77	300101	振芯科技	471,745	9,736,816.80	0.34
78	601619	嘉泽新能	2,372,100	9,725,610.00	0.34
79	600330	天通股份	812,784	9,680,257.44	0.34
80	002662	京威股份	2,665,700	9,676,491.00	0.34
81	600641	万业企业	489,600	9,547,200.00	0.33
82	002895	川恒股份	281,943	9,532,492.83	0.33

83	300378	鼎捷软件	574,200	9,457,074.00	0.33
84	002413	雷科防务	1,697,500	9,421,125.00	0.33
85	300423	昇辉科技	868,700	9,399,334.00	0.33
86	300709	精研科技	314,412	9,303,451.08	0.32
87	688202	美迪西	27,007	9,171,847.27	0.32
88	002043	兔宝宝	777,200	9,015,520.00	0.31
89	300438	鹏辉能源	145,400	8,934,830.00	0.31
90	301155	海力风电	96,300	8,763,300.00	0.31
91	000893	亚钾国际	248,600	8,554,326.00	0.30
92	603876	鼎胜新材	185,600	8,389,120.00	0.29
93	600662	外服控股	1,241,100	8,377,425.00	0.29
94	603766	隆鑫通用	1,804,000	8,316,440.00	0.29
95	300373	扬杰科技	114,500	8,158,125.00	0.28
96	600864	哈投股份	1,610,200	8,099,306.00	0.28
97	300171	东富龙	234,335	7,946,299.85	0.28
98	300027	华谊兄弟	2,472,000	7,910,400.00	0.28
99	300087	荃银高科	478,222	7,871,534.12	0.27
100	688399	硕世生物	68,754	7,839,331.08	0.27
101	002733	雄韬股份	443,000	7,712,630.00	0.27
102	300078	思创医惠	1,462,400	7,472,864.00	0.26
103	300327	中颖电子	148,860	7,414,716.60	0.26
104	000567	海德股份	494,318	7,315,906.40	0.26
105	300035	中科电气	261,000	7,294,950.00	0.25
106	600742	一汽富维	784,670	7,281,737.60	0.25
107	002310	东方园林	3,010,300	7,254,823.00	0.25
108	002449	国星光电	865,900	7,005,131.00	0.24
109	000989	九芝堂	748,200	6,808,620.00	0.24
110	002182	云海金属	269,400	6,756,552.00	0.24
111	300573	兴齐眼药	44,000	6,746,080.00	0.24
112	300180	华峰超纤	1,653,500	6,630,535.00	0.23
113	300855	图南股份	157,500	6,581,925.00	0.23
114	002611	东方精工	1,259,900	6,551,480.00	0.23
115	600308	华泰股份	1,121,700	6,404,907.00	0.22
116	002472	双环传动	198,600	6,323,424.00	0.22
117	300666	江丰电子	103,400	6,307,400.00	0.22
118	300775	三角防务	130,800	6,298,020.00	0.22
119	002929	润建股份	174,600	6,268,140.00	0.22
120	601677	明泰铝业	259,882	6,185,191.60	0.22
121	603118	共进股份	831,500	6,169,730.00	0.22
122	600063	皖维高新	797,400	6,044,292.00	0.21
123	002100	天康生物	620,500	6,031,260.00	0.21

124	603713	密尔克卫	44,015	6,016,850.50	0.21
125	688033	天宜上佳	275,230	5,845,885.20	0.20
126	688200	华峰测控	16,176	5,765,126.40	0.20
127	603212	赛伍技术	215,600	5,737,116.00	0.20
128	002344	海宁皮城	1,224,800	5,719,816.00	0.20
129	601606	长城军工	490,700	5,697,027.00	0.20
130	603306	华懋科技	167,900	5,691,810.00	0.20
131	300860	锋尚文化	120,190	5,676,573.70	0.20
132	002641	公元股份	1,176,500	5,670,730.00	0.20
133	002091	江苏国泰	514,600	5,531,950.00	0.19
134	000035	中国天楹	1,050,100	5,513,025.00	0.19
135	600639	浦东金桥	405,200	5,506,668.00	0.19
136	603279	景津装备	177,160	5,493,731.60	0.19
137	300525	博思软件	254,600	5,461,170.00	0.19
138	002378	章源钨业	673,500	5,441,880.00	0.19
139	605111	新洁能	44,800	5,378,688.00	0.19
140	603305	旭升股份	177,700	5,370,094.00	0.19
141	300740	水羊股份	389,500	5,351,730.00	0.19
142	600810	神马股份	593,500	5,341,500.00	0.19
143	000848	承德露露	532,135	5,151,066.80	0.18
144	688085	三友医疗	237,178	5,134,903.70	0.18
145	300723	一品红	188,800	5,078,720.00	0.18
146	300487	蓝晓科技	82,654	5,041,894.00	0.18
147	600100	同方股份	1,118,400	4,976,880.00	0.17
148	002217	合力泰	1,570,900	4,916,917.00	0.17
149	603396	金辰股份	53,400	4,861,002.00	0.17
150	600496	精工钢构	1,050,300	4,852,386.00	0.17
151	000810	创维数字	292,800	4,746,288.00	0.17
152	000592	平潭发展	1,779,500	4,680,085.00	0.16
153	002850	科达利	29,100	4,626,900.00	0.16
154	002605	姚记科技	273,612	4,555,639.80	0.16
155	002261	拓维信息	704,600	4,516,486.00	0.16
156	002436	兴森科技	400,500	4,513,635.00	0.16
157	000885	城发环境	483,650	4,497,945.00	0.16
158	000921	海信家电	315,184	4,469,309.12	0.16
159	688568	中科星图	65,398	4,431,368.48	0.15
160	603678	火炬电子	93,100	4,358,011.00	0.15
161	688278	特宝生物	144,900	4,271,652.00	0.15
162	000058	深赛格	703,200	4,261,392.00	0.15
163	000603	盛达资源	376,400	4,245,792.00	0.15
164	600491	龙元建设	620,800	4,233,856.00	0.15

165	605168	三人行	39,097	4,227,558.61	0.15
166	600328	中盐化工	178,400	4,201,320.00	0.15
167	600428	中远海特	876,600	4,172,616.00	0.15
168	300477	合纵科技	536,000	4,127,200.00	0.14
169	603128	华贸物流	411,200	4,124,336.00	0.14
170	601588	北辰实业	1,747,500	4,089,150.00	0.14
171	000917	电广传媒	764,900	4,061,619.00	0.14
172	688277	天智航	272,300	3,918,397.00	0.14
173	300613	富瀚微	45,687	3,874,257.60	0.14
174	688586	江航装备	142,800	3,799,908.00	0.13
175	002911	佛燃能源	412,466	3,745,191.28	0.13
176	002833	弘亚数控	221,256	3,690,550.08	0.13
177	600007	中国国贸	249,100	3,674,225.00	0.13
178	002267	陕天然气	518,803	3,626,432.97	0.13
179	600017	日照港	1,190,000	3,617,600.00	0.13
180	002130	沃尔核材	585,100	3,592,514.00	0.13
181	688017	绿的谐波	30,100	3,581,900.00	0.12
182	603588	高能环境	307,700	3,547,781.00	0.12
183	600490	鹏欣资源	901,500	3,470,775.00	0.12
184	600990	四创电子	82,100	3,394,835.00	0.12
185	000652	泰达股份	824,300	3,297,200.00	0.11
186	002176	江特电机	130,100	3,257,704.00	0.11
187	000061	农产品	521,600	3,233,920.00	0.11
188	300326	凯利泰	391,000	3,229,660.00	0.11
189	603881	数据港	120,000	3,222,000.00	0.11
190	002283	天润工业	461,800	3,154,094.00	0.11
191	000761	本钢板材	872,900	3,142,440.00	0.11
192	688356	键凯科技	12,754	3,084,044.74	0.11
193	600771	广誉远	86,967	3,056,890.05	0.11
194	600635	大众公用	894,600	2,952,180.00	0.10
195	300590	移为通信	216,880	2,943,061.60	0.10
196	600850	电科数字	155,220	2,896,405.20	0.10
197	000672	上峰水泥	181,300	2,860,914.00	0.10
198	300409	道氏技术	109,700	2,850,006.00	0.10
199	601137	博威合金	159,300	2,819,610.00	0.10
200	300226	上海钢联	124,474	2,819,336.10	0.10
201	300785	值得买	106,050	2,772,147.00	0.10
202	000918	嘉凯城	1,197,000	2,753,100.00	0.10
203	601921	浙版传媒	350,224	2,724,742.72	0.10
204	601666	平煤股份	196,500	2,670,435.00	0.09
205	300827	上能电气	51,900	2,654,685.00	0.09

206	300634	彩讯股份	208,000	2,641,600.00	0.09
207	605090	九丰能源	128,460	2,603,884.20	0.09
208	603610	麒盛科技	186,712	2,522,479.12	0.09
209	600797	浙大网新	424,200	2,511,264.00	0.09
210	688158	优刻得	165,908	2,410,643.24	0.08
211	605123	派克新材	17,100	2,406,312.00	0.08
212	600331	宏达股份	711,500	2,383,525.00	0.08
213	603896	寿仙谷	60,320	2,339,209.60	0.08
214	000910	大亚圣象	254,700	2,335,599.00	0.08
215	300131	英唐智控	440,100	2,306,124.00	0.08
216	600366	宁波韵升	182,000	2,293,200.00	0.08
217	002432	九安医疗	37,600	2,258,256.00	0.08
218	300215	电科院	328,700	2,258,169.00	0.08
219	002274	华昌化工	230,800	2,247,992.00	0.08
220	601001	晋控煤业	121,700	2,160,175.00	0.08
221	601886	江河集团	252,300	2,131,935.00	0.07
222	603959	百利科技	175,600	2,128,272.00	0.07
223	300552	万集科技	68,900	2,117,986.00	0.07
224	601099	太平洋	705,900	2,110,641.00	0.07
225	300271	华宇软件	279,900	2,104,848.00	0.07
226	600565	迪马股份	905,200	2,100,064.00	0.07
227	002891	中宠股份	82,600	2,099,692.00	0.07
228	000403	派林生物	95,000	2,086,200.00	0.07
229	000088	盐田港	394,800	2,056,908.00	0.07
230	002488	金固股份	304,600	2,049,958.00	0.07
231	688100	威胜信息	97,100	2,038,129.00	0.07
232	600569	安阳钢铁	773,501	2,026,572.62	0.07
233	600502	安徽建工	281,100	2,023,920.00	0.07
234	000923	河钢资源	147,100	2,004,973.00	0.07
235	300080	易成新能	394,200	1,978,884.00	0.07
236	300510	金冠股份	388,300	1,922,085.00	0.07
237	600621	华鑫股份	132,200	1,919,544.00	0.07
238	300548	博创科技	107,700	1,919,214.00	0.07
239	300236	上海新阳	57,800	1,913,180.00	0.07
240	600996	贵广网络	276,400	1,901,632.00	0.07
241	000823	超声电子	179,200	1,852,928.00	0.06
242	002498	汉缆股份	434,300	1,845,775.00	0.06
243	002332	仙琚制药	186,300	1,829,466.00	0.06
244	300068	南都电源	118,300	1,814,722.00	0.06
245	300429	强力新材	189,200	1,795,508.00	0.06
246	603010	万盛股份	94,900	1,769,885.00	0.06

247	603348	文灿股份	32,504	1,742,214.40	0.06
248	300307	慈星股份	283,300	1,725,297.00	0.06
249	603301	振德医疗	40,900	1,719,845.00	0.06
250	600715	文投控股	673,400	1,696,968.00	0.06
251	000423	东阿阿胶	45,900	1,696,005.00	0.06
252	300323	华灿光电	222,400	1,674,672.00	0.06
253	603308	应流股份	100,500	1,636,140.00	0.06
254	300657	弘信电子	139,700	1,623,314.00	0.06
255	603612	索通发展	44,000	1,621,400.00	0.06
256	002239	奥特佳	521,400	1,590,270.00	0.06
257	300725	药石科技	16,000	1,583,840.00	0.06
258	688301	奕瑞科技	3,300	1,561,032.00	0.05
259	688389	普门科技	89,200	1,560,108.00	0.05
260	600266	城建发展	379,600	1,548,768.00	0.05
261	600971	恒源煤电	194,300	1,534,970.00	0.05
262	600694	大商股份	85,600	1,532,240.00	0.05
263	000935	四川双马	62,900	1,523,438.00	0.05
264	300659	中孚信息	71,620	1,523,357.40	0.05
265	001696	宗申动力	240,400	1,521,732.00	0.05
266	000539	粤电力A	359,000	1,507,800.00	0.05
267	002218	拓日新能	255,000	1,501,950.00	0.05
268	688139	海尔生物	20,112	1,464,756.96	0.05
269	002044	美年健康	262,400	1,461,568.00	0.05
270	300638	广和通	54,915	1,454,698.35	0.05
271	600596	新安股份	66,900	1,448,385.00	0.05
272	600223	鲁商发展	135,600	1,421,088.00	0.05
273	000903	云内动力	464,100	1,406,223.00	0.05
274	002206	海利得	218,700	1,382,184.00	0.05
275	600338	西藏珠峰	48,000	1,377,600.00	0.05
276	002737	葵花药业	86,500	1,352,860.00	0.05
277	000676	智度股份	239,500	1,331,620.00	0.05
278	002036	联创电子	86,600	1,330,176.00	0.05
279	600548	深高速	139,200	1,327,968.00	0.05
280	300184	力源信息	236,800	1,302,400.00	0.05
281	000710	贝瑞基因	89,700	1,286,298.00	0.04
282	300783	三只松鼠	50,600	1,267,530.00	0.04
283	600577	精达股份	227,200	1,260,960.00	0.04
284	688018	乐鑫科技	11,200	1,258,880.00	0.04
285	300458	全志科技	41,110	1,236,999.90	0.04
286	002646	天佑德酒	64,200	1,229,430.00	0.04
287	605338	巴比食品	40,100	1,223,451.00	0.04

288	002677	浙江美大	83,200	1,220,544.00	0.04
289	000829	天音控股	102,200	1,217,202.00	0.04
290	601375	中原证券	287,100	1,197,207.00	0.04
291	002425	凯撒文化	207,500	1,159,925.00	0.04
292	002158	汉钟精机	49,840	1,158,780.00	0.04
293	688019	安集科技	5,400	1,149,768.00	0.04
294	002314	南山控股	277,300	1,148,022.00	0.04
295	002918	蒙娜丽莎	60,500	1,132,560.00	0.04
296	002216	三全食品	57,000	1,116,630.00	0.04
297	300339	润和软件	60,900	1,093,155.00	0.04
298	600618	氯碱化工	87,400	1,092,500.00	0.04
299	300294	博雅生物	30,100	1,082,095.00	0.04
300	601311	骆驼股份	97,100	1,080,723.00	0.04
301	301029	怡合达	13,240	1,079,060.00	0.04
302	002245	蔚蓝锂芯	45,200	1,049,092.00	0.04
303	603013	亚普股份	73,900	1,032,383.00	0.04
304	000976	华铁股份	238,800	1,019,676.00	0.04
305	300747	锐科激光	26,200	1,019,180.00	0.04
306	601158	重庆水务	190,300	1,018,105.00	0.04
307	600888	新疆众和	110,200	1,013,840.00	0.04
308	603222	济民医疗	92,120	1,013,320.00	0.04
309	002573	清新环境	173,700	1,009,197.00	0.04
310	002041	登海种业	47,600	1,003,884.00	0.04
311	300034	钢研高纳	23,600	995,448.00	0.03
312	600360	华微电子	123,500	980,590.00	0.03
313	300233	金城医药	34,300	978,579.00	0.03
314	300123	亚光科技	156,600	970,920.00	0.03
315	601918	新集能源	189,800	967,980.00	0.03
316	002312	川发龙蟒	56,000	966,560.00	0.03
317	002913	奥士康	30,400	962,160.00	0.03
318	002807	江阴银行	210,920	955,467.60	0.03
319	600055	万东医疗	38,600	939,138.00	0.03
320	688020	方邦股份	24,000	935,760.00	0.03
321	300662	科锐国际	17,800	923,642.00	0.03
322	002042	华孚时尚	242,300	915,894.00	0.03
323	002276	万马股份	114,700	896,954.00	0.03
324	600295	鄂尔多斯	49,320	890,226.00	0.03
325	300134	大富科技	109,100	889,165.00	0.03
326	600129	太极集团	40,100	880,997.00	0.03
327	300055	万邦达	93,300	873,288.00	0.03
328	600612	老凤祥	20,800	869,024.00	0.03

329	300624	万兴科技	27,000	863,730.00	0.03
330	000036	华联控股	199,900	863,568.00	0.03
331	300298	三诺生物	30,600	859,860.00	0.03
332	600908	无锡银行	152,600	859,138.00	0.03
333	002675	东诚药业	63,200	853,200.00	0.03
334	605136	丽人丽妆	53,300	843,206.00	0.03
335	601515	东风股份	181,220	835,424.20	0.03
336	600108	亚盛集团	237,063	829,720.50	0.03
337	300829	金丹科技	25,300	820,226.00	0.03
338	002285	世联行	250,400	816,304.00	0.03
339	002839	张家港行	153,960	814,448.40	0.03
340	600267	海正药业	62,200	796,782.00	0.03
341	300685	艾德生物	24,580	786,560.00	0.03
342	600740	山西焦化	134,000	779,880.00	0.03
343	600993	马应龙	33,400	778,220.00	0.03
344	300842	帝科股份	13,000	774,800.00	0.03
345	600645	中源协和	39,400	767,118.00	0.03
346	002446	盛路通信	110,300	764,379.00	0.03
347	600459	贵研铂业	41,700	755,187.00	0.03
348	000503	国新健康	82,100	737,258.00	0.03
349	600252	中恒集团	249,900	737,205.00	0.03
350	000650	仁和药业	114,000	727,320.00	0.03
351	002906	华阳集团	16,000	724,960.00	0.03
352	688133	泰坦科技	4,100	724,224.00	0.03
353	002636	金安国纪	79,100	714,273.00	0.02
354	688106	金宏气体	35,900	701,845.00	0.02
355	300219	鸿利智汇	78,700	684,690.00	0.02
356	300841	康华生物	5,925	683,982.00	0.02
357	002099	海翔药业	98,600	683,298.00	0.02
358	300602	飞荣达	41,600	682,240.00	0.02
359	002262	恩华药业	49,400	671,840.00	0.02
360	600285	羚锐制药	52,792	661,483.76	0.02
361	601212	白银有色	239,500	661,020.00	0.02
362	600587	新华医疗	32,500	658,125.00	0.02
363	603098	森特股份	18,300	656,238.00	0.02
364	600557	康缘药业	44,600	655,174.00	0.02
365	600395	盘江股份	74,500	653,365.00	0.02
366	000566	海南海药	142,500	651,225.00	0.02
367	603393	新天然气	30,100	642,936.00	0.02
368	688166	博瑞医药	26,500	639,975.00	0.02
369	603323	苏农银行	124,800	636,480.00	0.02

370	688617	惠泰医疗	2,903	635,989.24	0.02
371	300497	富祥药业	47,100	633,024.00	0.02
372	600422	昆药集团	51,300	623,295.00	0.02
373	000627	天茂集团	182,600	622,666.00	0.02
374	600812	华北制药	92,500	621,600.00	0.02
375	601567	三星医疗	46,700	620,176.00	0.02
376	603520	司太立	22,000	618,640.00	0.02
377	002038	双鹭药业	63,450	616,099.50	0.02
378	000712	锦龙股份	40,500	611,145.00	0.02
379	603229	奥翔药业	16,040	610,482.40	0.02
380	600750	江中药业	42,600	610,032.00	0.02
381	002727	一心堂	26,500	607,645.00	0.02
382	688233	神工股份	10,800	606,960.00	0.02
383	603989	艾华集团	21,300	600,660.00	0.02
384	603113	金能科技	53,500	591,710.00	0.02
385	300674	宇信科技	37,500	588,000.00	0.02
386	688520	神州细胞	11,360	587,652.80	0.02
387	300702	天宇股份	20,400	579,564.00	0.02
388	002773	康弘药业	38,700	578,178.00	0.02
389	600420	国药现代	58,000	574,200.00	0.02
390	603690	至纯科技	14,200	572,260.00	0.02
391	002204	大连重工	127,200	555,864.00	0.02
392	002151	北斗星通	17,000	536,520.00	0.02
393	002649	博彦科技	52,200	532,962.00	0.02
394	603387	基蛋生物	36,620	522,201.20	0.02
395	603368	柳药集团	30,100	518,322.00	0.02
396	600575	淮河能源	165,800	517,296.00	0.02
397	601963	重庆银行	64,900	515,306.00	0.02
398	300149	睿智医药	44,800	505,344.00	0.02
399	688408	中信博	5,300	490,144.00	0.02
400	000735	罗牛山	71,700	488,994.00	0.02
401	300143	盈康生命	43,000	488,050.00	0.02
402	600458	时代新材	49,700	487,060.00	0.02
403	300633	开立医疗	16,200	486,486.00	0.02
404	688198	佰仁医疗	3,899	475,366.08	0.02
405	603718	海利生物	41,200	472,976.00	0.02
406	601015	陕西黑猫	80,800	472,680.00	0.02
407	002020	京新药业	51,900	472,290.00	0.02
408	605369	拱东医疗	3,800	471,960.00	0.02
409	600955	维远股份	16,300	470,092.00	0.02
410	688128	中国电研	19,200	467,520.00	0.02

411	603338	浙江鼎力	9,200	466,440.00	0.02
412	600326	西藏天路	79,400	464,490.00	0.02
413	002581	未名医药	26,900	463,756.00	0.02
414	002437	誉衡药业	174,500	441,485.00	0.02
415	300158	振东制药	65,000	438,750.00	0.02
416	688699	明微电子	4,000	433,840.00	0.02
417	688315	诺禾致源	16,800	432,936.00	0.02
418	301047	义翘神州	3,300	428,109.00	0.01
419	600789	鲁抗医药	64,900	424,446.00	0.01
420	688266	泽璟制药	11,766	422,281.74	0.01
421	600882	妙可蓝多	8,900	416,520.00	0.01
422	002589	瑞康医药	107,000	416,230.00	0.01
423	002550	千红制药	72,000	412,560.00	0.01
424	603565	中谷物流	25,500	404,685.00	0.01
425	002950	奥美医疗	32,000	403,840.00	0.01
426	300039	上海凯宝	63,600	403,224.00	0.01
427	300406	九强生物	23,300	402,857.00	0.01
428	301089	拓新药业	3,200	401,984.00	0.01
429	000813	德展健康	115,600	398,820.00	0.01
430	688366	昊海生科	3,723	393,818.94	0.01
431	000697	炼石航空	50,100	393,786.00	0.01
432	000597	东北制药	70,700	388,850.00	0.01
433	300267	尔康制药	111,800	387,946.00	0.01
434	600997	开滦股份	49,800	379,476.00	0.01
435	601011	宝泰隆	90,400	377,872.00	0.01
436	603108	润达医疗	37,300	367,405.00	0.01
437	002435	长江健康	73,200	357,948.00	0.01
438	002421	达实智能	106,400	356,440.00	0.01
439	688222	成都先导	22,190	354,152.40	0.01
440	603363	傲农生物	19,000	351,690.00	0.01
441	601882	海天精工	17,000	350,370.00	0.01
442	300204	舒泰神	26,000	348,920.00	0.01
443	300109	新开源	21,300	347,616.00	0.01
444	002724	海洋王	27,300	339,339.00	0.01
445	301080	百普赛斯	2,000	333,780.00	0.01
446	002428	云南锗业	25,800	333,336.00	0.01
447	603979	金诚信	17,100	330,201.00	0.01
448	300352	北信源	67,600	312,312.00	0.01
449	605589	圣泉集团	12,600	310,842.00	0.01
450	688578	艾力斯	14,700	310,170.00	0.01
451	600452	涪陵电力	26,160	303,717.60	0.01

452	603055	台华新材	23,900	300,184.00	0.01
453	603567	珍宝岛	25,100	297,937.00	0.01
454	603171	税友股份	10,600	296,588.00	0.01
455	300485	赛升药业	24,000	296,400.00	0.01
456	000950	重药控股	57,900	289,500.00	0.01
457	603439	贵州三力	21,600	283,392.00	0.01
458	601369	陕鼓动力	29,300	281,280.00	0.01
459	603093	南华期货	26,500	280,635.00	0.01
460	688505	复旦张江	27,100	275,065.00	0.01
461	002880	卫光生物	10,100	265,832.00	0.01
462	300735	光弘科技	25,100	262,295.00	0.01
463	300255	常山药业	41,900	261,037.00	0.01
464	600729	重庆百货	12,000	258,840.00	0.01
465	600874	创业环保	37,600	253,048.00	0.01
466	600449	宁夏建材	19,800	240,966.00	0.01
467	300206	理邦仪器	22,900	234,725.00	0.01
468	600073	上海梅林	29,000	231,130.00	0.01
469	300765	新诺威	15,284	218,102.68	0.01
470	600391	航发科技	11,200	215,152.00	0.01
471	300318	博晖创新	31,800	207,972.00	0.01
472	301087	可孚医疗	4,760	202,966.40	0.01
473	603733	仙鹤股份	7,200	191,520.00	0.01
474	002961	瑞达期货	10,600	191,224.00	0.01
475	603053	成都燃气	19,300	180,262.00	0.01
476	000875	吉电股份	25,000	173,750.00	0.01
477	301015	百洋医药	7,900	170,482.00	0.01
478	600550	保变电气	31,100	168,873.00	0.01
479	300205	天喻信息	13,276	160,241.32	0.01
480	300981	中红医疗	6,300	158,886.00	0.01
481	605296	神农集团	5,920	152,203.20	0.01
482	605507	国邦医药	6,100	147,315.00	0.01
483	000683	远兴能源	13,800	145,038.00	0.01
484	605199	葫芦娃	7,900	139,435.00	0.00
485	002201	正威新材	4,900	127,155.00	0.00
486	603337	杰克股份	5,900	126,732.00	0.00
487	002335	科华数据	4,100	126,485.00	0.00
488	300145	中金环境	45,700	125,675.00	0.00
489	002287	奇正藏药	4,700	121,025.00	0.00
490	300085	银之杰	10,900	119,791.00	0.00
491	605009	豪悦护理	3,000	116,640.00	0.00
492	600335	国机汽车	11,358	113,693.58	0.00

493	688001	华兴源创	4,143	112,772.46	0.00
494	000936	华西股份	20,600	111,446.00	0.00
495	603105	芯能科技	9,900	110,682.00	0.00
496	600363	联创光电	4,900	110,054.00	0.00
497	688027	国盾量子	1,081	109,181.00	0.00
498	002626	金达威	4,500	107,280.00	0.00
499	300151	昌红科技	5,500	103,950.00	0.00
500	300276	三丰智能	23,800	100,198.00	0.00
501	000065	北方国际	11,430	96,583.50	0.00
502	688268	华特气体	1,300	91,338.00	0.00
503	000016	深康佳A	14,600	88,330.00	0.00
504	300598	诚迈科技	2,100	86,709.00	0.00
505	002635	安洁科技	5,100	83,487.00	0.00
506	002292	奥飞娱乐	17,400	81,606.00	0.00
507	000019	深粮控股	10,100	77,871.00	0.00
508	601126	四方股份	4,600	74,566.00	0.00
509	000657	中钨高新	4,900	73,500.00	0.00
510	600523	贵航股份	2,800	65,800.00	0.00
511	600761	安徽合力	5,400	64,260.00	0.00
512	688526	科前生物	2,400	62,376.00	0.00
513	300394	天孚通信	2,200	59,554.00	0.00
514	300183	东软载波	4,000	59,160.00	0.00
515	002777	久远银海	4,100	58,958.00	0.00
516	300203	聚光科技	2,200	52,888.00	0.00
517	301060	兰卫医学	1,286	45,035.72	0.00
518	688598	金博股份	26	7,662.20	0.00
519	688095	福昕软件	43	3,053.00	0.00
520	002978	安宁股份	75	2,897.25	0.00
521	603915	国茂股份	40	839.60	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	688005	容百科技	103,266	13,366,751.04	0.47
2	600089	特变电工	476,000	13,037,640.00	0.45
3	002517	恺英网络	2,213,600	12,351,888.00	0.43
4	300769	德方纳米	28,480	11,639,206.40	0.41
5	688556	高测股份	131,140	10,582,998.00	0.37
6	688518	联赢激光	305,200	10,373,748.00	0.36
7	600732	爱旭股份	313,700	10,358,374.00	0.36

8	600282	南钢股份	3,225,900	10,161,585.00	0.35
9	601877	正泰电器	275,100	9,843,078.00	0.34
10	603198	迎驾贡酒	148,647	9,682,865.58	0.34
11	002821	凯莱英	32,400	9,363,600.00	0.33
12	600745	闻泰科技	109,900	9,353,589.00	0.33
13	002468	申通快递	758,900	9,046,088.00	0.32
14	000552	靖远煤电	2,087,100	8,995,401.00	0.31
15	002410	广联达	154,100	8,389,204.00	0.29
16	600863	内蒙华电	2,266,000	8,270,900.00	0.29
17	300363	博腾股份	104,000	8,110,960.00	0.28
18	600970	中材国际	761,100	7,375,059.00	0.26
19	600967	内蒙一机	778,100	7,096,272.00	0.25
20	002475	立讯精密	204,400	6,906,676.00	0.24
21	300073	当升科技	73,100	6,603,854.00	0.23
22	000898	鞍钢股份	2,042,500	6,576,850.00	0.23
23	002080	中材科技	234,500	6,448,750.00	0.22
24	002497	雅化集团	187,700	6,128,405.00	0.21
25	603818	曲美家居	637,000	6,051,500.00	0.21
26	001979	招商蛇口	441,600	5,930,688.00	0.21
27	300196	长海股份	295,900	5,589,551.00	0.19
28	300873	海晨股份	196,300	5,549,401.00	0.19
29	601156	东航物流	271,200	5,369,760.00	0.19
30	688330	宏力达	62,273	5,354,855.27	0.19
31	600765	中航重机	164,420	5,291,035.60	0.18
32	300450	先导智能	81,600	5,155,488.00	0.18
33	600438	通威股份	85,500	5,118,030.00	0.18
34	002240	盛新锂能	84,400	5,094,384.00	0.18
35	688123	聚辰股份	47,100	5,017,092.00	0.17
36	000625	长安汽车	280,800	4,863,456.00	0.17
37	300390	天华超净	54,700	4,780,780.00	0.17
38	600782	新钢股份	946,600	4,770,864.00	0.17
39	002466	天齐锂业	37,900	4,729,920.00	0.16
40	688777	中控技术	63,227	4,600,396.52	0.16
41	300724	捷佳伟创	49,600	4,431,760.00	0.15
42	300244	迪安诊断	139,600	4,341,560.00	0.15
43	688357	建龙微纳	35,926	4,039,519.44	0.14
44	002009	天奇股份	211,900	3,920,150.00	0.14
45	600219	南山铝业	1,054,900	3,892,581.00	0.14
46	002128	电投能源	262,000	3,751,840.00	0.13
47	300681	英搏尔	64,800	3,743,496.00	0.13
48	002191	劲嘉股份	345,100	3,699,472.00	0.13

49	688778	厦钨新能	31,200	3,477,864.00	0.12
50	601872	招商轮船	582,000	3,352,320.00	0.12
51	600019	宝钢股份	551,000	3,317,020.00	0.12
52	688559	海目星	44,700	3,249,690.00	0.11
53	688601	力芯微	21,600	3,240,000.00	0.11
54	603365	水星家纺	216,000	3,235,680.00	0.11
55	300209	天泽信息	399,300	3,086,589.00	0.11
56	002709	天赐材料	45,800	2,842,348.00	0.10
57	300911	亿田智能	33,700	2,589,845.00	0.09
58	600642	申能股份	453,900	2,578,152.00	0.09
59	603501	韦尔股份	14,800	2,560,844.00	0.09
60	603456	九洲药业	48,000	2,481,600.00	0.09
61	600597	光明乳业	187,500	2,368,125.00	0.08
62	605006	山东玻纤	193,440	2,214,888.00	0.08
63	300661	圣邦股份	12,150	2,211,543.00	0.08
64	000667	美好置业	1,315,500	2,104,800.00	0.07
65	688690	纳微科技	25,800	2,084,898.00	0.07
66	300168	万达信息	219,300	2,070,192.00	0.07
67	300571	平治信息	49,600	2,048,480.00	0.07
68	000553	安道麦 A	164,200	1,988,462.00	0.07
69	600499	科达制造	94,031	1,940,799.84	0.07
70	605016	百龙创园	46,000	1,932,920.00	0.07
71	603719	良品铺子	65,300	1,869,539.00	0.07
72	002745	木林森	188,600	1,842,622.00	0.06
73	300218	安利股份	128,300	1,830,841.00	0.06
74	603300	华铁应急	228,300	1,819,551.00	0.06
75	000960	锡业股份	107,500	1,802,775.00	0.06
76	603650	彤程新材	54,900	1,788,642.00	0.06
77	300179	四方达	113,100	1,773,408.00	0.06
78	688499	利元亨	8,000	1,770,400.00	0.06
79	002460	赣锋锂业	11,800	1,754,660.00	0.06
80	600686	金龙汽车	247,800	1,724,688.00	0.06
81	300482	万孚生物	42,100	1,713,891.00	0.06
82	002547	春兴精工	402,100	1,700,883.00	0.06
83	600879	航天电子	260,900	1,693,241.00	0.06
84	603859	能科科技	55,400	1,681,944.00	0.06
85	603708	家家悦	110,600	1,574,944.00	0.05
86	688300	联瑞新材	19,400	1,506,410.00	0.05
87	603613	国联股份	16,696	1,479,265.60	0.05
88	300481	濮阳惠成	61,300	1,440,550.00	0.05
89	002438	江苏神通	85,400	1,259,650.00	0.04

90	300572	安车检测	82,500	1,235,025.00	0.04
91	300831	派瑞股份	79,800	1,126,776.00	0.04
92	600256	广汇能源	102,700	1,082,458.00	0.04
93	002308	威创股份	278,500	1,072,225.00	0.04
94	688682	霍莱沃	12,600	1,046,178.00	0.04
95	688305	科德数控	12,900	985,173.00	0.03
96	300268	佳沃食品	32,500	966,875.00	0.03
97	688022	瀚川智能	16,000	940,640.00	0.03
98	688700	东威科技	10,900	908,406.00	0.03
99	002299	圣农发展	46,200	886,116.00	0.03
100	603887	城地香江	109,320	853,789.20	0.03
101	605358	立昂微	11,904	802,091.52	0.03
102	688800	瑞可达	6,300	795,753.00	0.03
103	002156	通富微电	51,400	791,560.00	0.03
104	300041	回天新材	42,900	745,173.00	0.03
105	603738	泰晶科技	23,700	744,417.00	0.03
106	002008	大族激光	22,300	738,799.00	0.03
107	300811	铂科新材	7,400	720,168.00	0.03
108	601339	百隆东方	125,100	635,508.00	0.02
109	000089	深圳机场	82,000	633,040.00	0.02
110	688766	普冉股份	3,800	619,894.00	0.02
111	601928	凤凰传媒	84,300	602,745.00	0.02
112	600383	金地集团	40,900	549,696.00	0.02
113	002383	合众思壮	90,500	540,285.00	0.02
114	300300	海峡创新	99,600	415,332.00	0.01
115	300474	景嘉微	6,050	413,759.50	0.01
116	601858	中国科传	50,500	397,940.00	0.01
117	002161	远望谷	77,900	390,279.00	0.01
118	000711	京蓝科技	143,400	381,444.00	0.01
119	688630	芯碁微装	5,800	375,260.00	0.01
120	603866	桃李面包	22,580	373,699.00	0.01
121	603799	华友钴业	3,700	353,794.00	0.01
122	002946	新乳业	25,200	327,348.00	0.01
123	600825	新华传媒	80,400	319,188.00	0.01
124	002647	仁东控股	43,600	292,992.00	0.01
125	601600	中国铝业	61,000	289,750.00	0.01
126	000807	云铝股份	27,400	270,712.00	0.01
127	600702	舍得酒业	1,300	265,187.00	0.01
128	600377	宁沪高速	30,200	258,814.00	0.01
129	002881	美格智能	7,770	249,106.20	0.01
130	002322	理工能科	27,700	247,915.00	0.01

131	601899	紫金矿业	23,500	219,255.00	0.01
132	301206	三元生物	4,645	218,668.05	0.01
133	600299	安迪苏	21,100	202,138.00	0.01
134	002841	视源股份	2,600	195,832.00	0.01
135	603277	银都股份	8,500	179,435.00	0.01
136	603668	天马科技	7,700	157,773.00	0.01
137	603477	巨星农牧	5,300	127,094.00	0.00
138	603078	江化微	4,259	121,679.63	0.00
139	002081	金螳螂	20,500	104,140.00	0.00
140	600376	首开股份	21,200	104,092.00	0.00
141	301219	腾远钴业	578	50,759.96	0.00
142	300896	爱美客	76	45,600.76	0.00
143	301200	大族数控	857	44,495.44	0.00
144	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
145	301150	中一科技	404	33,435.04	0.00
146	301109	军信股份	1,838	29,665.32	0.00
147	600325	华发股份	3,700	28,009.00	0.00
148	301201	诚达药业	353	25,253.62	0.00
149	300834	星辉环材	635	19,069.05	0.00
150	000799	酒鬼酒	100	18,581.00	0.00
151	301162	国能日新	334	18,072.74	0.00
152	301123	奕东电子	656	16,655.84	0.00
153	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.00
154	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.00
155	688122	西部超导	138	12,723.60	0.00
156	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
157	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
158	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
159	688030	山石网科	193	4,004.75	0.00
160	688308	欧科亿	54	3,594.24	0.00
161	601898	中煤能源	100	1,038.00	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	002405	四维图新	32,576,250.00	1.50
2	300457	赢合科技	27,693,260.00	1.27
3	300769	德方纳米	25,699,290.40	1.18
4	600873	梅花生物	22,948,764.00	1.06
5	300222	科大智能	20,535,857.08	0.95

6	002585	双星新材	20,191,829.00	0.93
7	688518	联赢激光	20,129,928.24	0.93
8	300130	新国都	19,355,152.80	0.89
9	300568	星源材质	19,210,063.65	0.88
10	688005	容百科技	18,187,651.38	0.84
11	688508	芯朋微	17,480,670.69	0.80
12	002545	东方铁塔	17,476,024.00	0.80
13	688388	嘉元科技	17,471,086.55	0.80
14	300224	正海磁材	17,087,120.82	0.79
15	300118	东方日升	16,866,044.00	0.78
16	600481	双良节能	16,384,138.00	0.75
17	300073	当升科技	16,366,899.00	0.75
18	002497	雅化集团	16,354,026.00	0.75
19	300432	富临精工	16,253,521.37	0.75
20	300476	胜宏科技	16,085,883.26	0.74

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	002497	雅化集团	23,898,281.92	1.10
2	600502	安徽建工	22,852,588.05	1.05
3	300073	当升科技	20,441,704.95	0.94
4	600256	广汇能源	20,012,366.15	0.92
5	300769	德方纳米	19,419,895.60	0.89
6	600596	新安股份	19,375,520.57	0.89
7	600499	科达制造	19,070,143.00	0.88
8	603566	普莱柯	18,589,221.52	0.86
9	000498	山东路桥	17,954,417.00	0.83
10	600123	兰花科创	17,502,861.00	0.81
11	603599	广信股份	17,370,072.00	0.80
12	002240	盛新锂能	16,341,211.50	0.75
13	002756	永兴材料	16,324,453.40	0.75
14	600323	瀚蓝环境	15,524,905.32	0.71
15	300390	天华超净	15,524,696.00	0.71
16	002245	蔚蓝锂芯	15,376,661.00	0.71
17	601001	晋控煤业	15,291,024.00	0.70
18	000683	远兴能源	15,137,962.00	0.70
19	002254	泰和新材	15,103,985.84	0.70
20	601677	明泰铝业	15,051,411.71	0.69

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	3,730,736,939.05
卖出股票收入（成交）总额	2,999,290,846.47

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）	108,007.33	0.00
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	108,007.33	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	123148	上能转债	629	62,907.03	0.00
2	123150	九强转债	451	45,100.30	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

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，胜宏科技(惠州)股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到惠州市生态环境局、惠州市生态环境局博罗分局的处罚。

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

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

7.12.2 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	536,606.75
2	应收清算款	—

3	应收股利	108,806.78
4	应收利息	—
5	应收申购款	3,763,513.79
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	应计出借证券利息	29,981.40
9	其他	—
10	合计	4,438,908.72

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300457	赢合科技	1,744,374.00	0.06	转融通流通受限
2	600873	梅花生物	882,096.00	0.03	转融通流通受限
3	300476	胜宏科技	216,648.00	0.01	转融通流通受限

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600089	特变电工	1,369,500.00	0.05	转融通流通受限
2	002517	恺英网络	1,170,126.00	0.04	转融通流通受限
3	688556	高测股份	823,140.00	0.03	转融通流通受限

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 1000 指数增强 A	62,956	19,536.91	876,934,354.18	71.30	353,031,162.30	28.70
富国中证 1000 指数增强 C	41,489	4,695.94	168,883,232.80	86.68	25,946,587.85	13.32
合计	104,445	13,641.58	1,045,817,586.98	73.40	378,977,750.15	26.60

8.2 期末上市基金前十名持有人

富国中证 1000 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	北京新湖巨源投资管理有限公司—新湖巨源泓湖百世风险平衡1号私募证券投资基金	2,269,852.00	10.80
2	付小珍	644,348.00	3.07
3	熊振国	573,600.00	2.73
4	张秀宽	500,000.00	2.38
5	刘树航	408,690.00	1.95
6	李群	400,023.00	1.90
7	邓玉良	300,040.00	1.43
8	共青城树山投资管理有限公司—树山远星多策略精选1号私募证券投资基金	273,599.00	1.30
9	张巍	253,119.00	1.20
10	前海钜阵资本管理(深圳)有限公司—钜阵恒山1号私募证券投资基金	232,263.00	1.11

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 1000 指数增强 A	194,052.02	0.0158

	富国中证 1000 指数增 强 C	54,613.68	0.0280
	合计	248,665.70	0.0175

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 1000 指数 增强 A	0~10
	富国中证 1000 指数 增强 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基 金	富国中证 1000 指数 增强 A	0
	富国中证 1000 指数 增强 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	富国中证 1000 指数增 强 A	富国中证 1000 指数增 强 C
基金合同生效日(2018 年 05 月 31 日) 基金份额总额	512,114,043.76	—
报告期期初基金份额总额	815,445,341.41	202,981,847.37
本报告期基金总申购份额	817,409,809.12	156,404,175.79
减：本报告期基金总赎回份额	402,889,634.05	164,556,202.51
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	1,229,965,516.48	194,829,820.65

§ 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	220,848,200.86	3.29	17,508.40	0.42	—	—	—	—	201,255.44	3.28	—
德邦证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
第一创业证券	2	367,630,127.31	5.48	881,336.80	21.06	—	—	—	—	336,339.56	5.48	—
东北证券	2	765,856,507.87	11.41	390,206.30	9.33	—	—	—	—	699,938.22	11.40	—
东方证券	2	302,648,124.29	4.51	2,281,803.60	54.53	—	—	—	—	276,454.75	4.50	—
国海证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国联证券	1	210,773,029.38	3.14	—	—	—	—	—	—	194,171.80	3.16	—
国泰君安	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
海通证券	1	644,509,290.02	9.60	—	—	—	—	—	—	590,075.01	9.61	—
华菁证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
汇丰前海	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
开源证券	4	1,131,638,657.80	16.86	313,780.75	7.50	—	—	—	—	1,036,431.19	16.88	—
申万宏源	4	686,819,487.83	10.23	—	—	—	—	—	—	628,489.81	10.23	—
兴业证券	2	773,951,552.72	11.53	—	—	—	—	—	—	705,301.32	11.49	—

浙商证券	1	1,049,466,143.01	15.63	39,125.92	0.94	—	—	—	—	963,246.31	15.69	—
中泰证券	1	558,220,764.22	8.32	260,452.60	6.22	—	—	—	—	509,225.24	8.29	—
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旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2022年01月07日
3	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2022年01月07日
4	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2022年02月10日
5	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

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	2022-03-11 至 2022-06-30	—	524,930 ,803.69	—	524,930,803 .69	36.84%
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 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）的文件 2、富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同 3、富国中证 1000 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 1000 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） 公司地址： http://www.fullgoal.com.cn 。