

富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)

二 0 二三年中期报告

2023 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： 2023 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 2023 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 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
§2	基金简介.....	6
2.1	基金基本情况.....	6
2.2	基金产品说明.....	6
2.3	基金管理人和基金托管人.....	6
2.4	信息披露方式.....	7
2.5	其他相关资料.....	7
§3	主要财务指标和基金净值表现.....	8
3.1	主要会计数据和财务指标.....	8
3.2	基金净值表现.....	9
§4	管理人报告.....	12
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	15
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
4.8	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	17
§5	托管人报告.....	18
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	18
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	18
§6	中期财务报告（未经审计）.....	19
6.1	资产负债表.....	19
6.2	利润表.....	20
6.3	净资产（基金净值）变动表.....	21
6.4	报表附注.....	23
§7	投资组合报告.....	48
7.1	期末基金资产组合情况.....	48

7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	48
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.....	49
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	70
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	72
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.....	72
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.....	72
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.....	72
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.....	72
7.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	72
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	72
7.12	投资组合报告附注.....	72
§8	基金份额持有人信息.....	74
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	74
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	74
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	74
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.....	75
§9	开放式基金份额变动.....	76
§10	重大事件揭示.....	77
10.1	基金份额持有人大会决议.....	77
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.....	77
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	77
10.4	基金投资策略的改变.....	77
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	77
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.....	77
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	77
10.8	其他重大事件.....	80
§11	影响投资者决策的其他重要信息.....	81
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.....	81
§12	备查文件目录.....	82



## § 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	3,247,091,518.13 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2011 年 10 月 21 日		
下属分级基金的基金简称	富国中证 500 指数增强 (LOF) A/B	富国中证 500 指数增强 (LOF) C	
下属分级基金场内简称	500 增强 LOF	—	
下属分级基金的交易代码	前端	后端	013332
	161017	161021	
报告期末下属分级基金的份额总额	3,097,878,117.77 份		149,213,400.36 份

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	富国基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司	
信息披露负责人	姓名	赵瑛	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	A类：中国证券登记结算有限责任公司；C类：富国基金管理有限公司	北京市西城区太平桥大街17号

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

##### (1) 富国中证 500 指数增强 (LOF) A/B

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023年01月01日至2023年06月30日)
本期已实现收益	59,858,813.13
本期利润	336,415,047.31
加权平均基金份额本期利润	0.1092
本期加权平均净值利润率	4.77%
本期基金份额净值增长率	4.76%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年06月30日)
期末可供分配利润	3,926,255,651.46
期末可供分配基金份额利润	1.2674
期末基金资产净值	7,024,133,769.23
期末基金份额净值	2.267
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年06月30日)
基金份额累计净值增长率	181.60%

##### (2) 富国中证 500 指数增强 (LOF) C

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023年01月01日至2023年06月30日)
本期已实现收益	1,424,637.81
本期利润	6,915,322.34
加权平均基金份额本期利润	0.0778
本期加权平均净值利润率	3.41%
本期基金份额净值增长率	4.68%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年06月30日)
期末可供分配利润	187,997,586.54
期末可供分配基金份额利润	1.2599
期末基金资产净值	337,210,986.90
期末基金份额净值	2.260
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年06月30日)
基金份额累计净值增长率	-10.67%

注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式



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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### (1) 富国中证 500 指数增强 (LOF) A/B

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.27%	0.85%	-0.69%	0.89%	0.96%	-0.04%
过去三个月	-2.75%	0.76%	-4.87%	0.78%	2.12%	-0.02%
过去六个月	4.76%	0.72%	2.70%	0.75%	2.06%	-0.03%
过去一年	-6.44%	0.89%	-5.73%	0.91%	-0.71%	-0.02%
过去三年	15.37%	1.14%	5.54%	1.13%	9.83%	0.01%
自基金合同生效起至今	181.60%	1.48%	75.72%	1.50%	105.88%	-0.02%

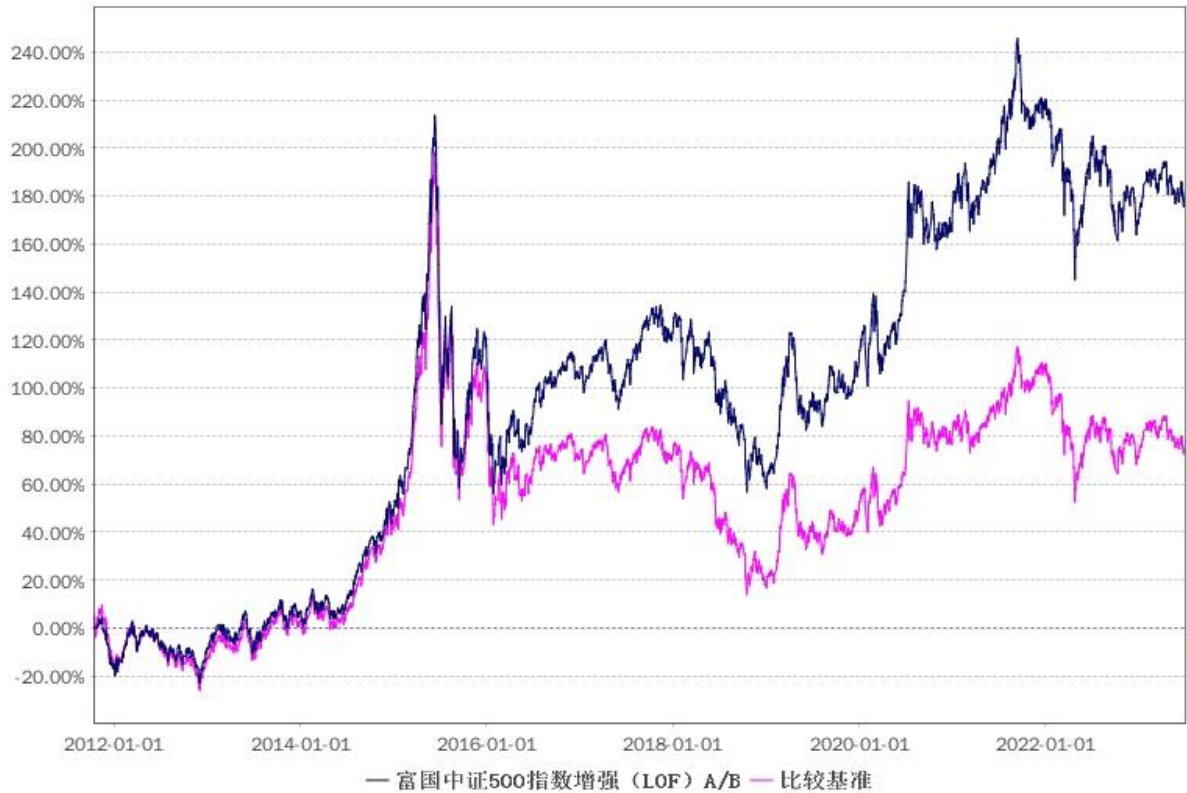
##### (2) 富国中证 500 指数增强 (LOF) C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.27%	0.85%	-0.69%	0.89%	0.96%	-0.04%
过去三个月	-2.75%	0.76%	-4.87%	0.78%	2.12%	-0.02%
过去六个月	4.68%	0.72%	2.70%	0.75%	1.98%	-0.03%
过去一年	-6.61%	0.89%	-5.73%	0.91%	-0.88%	-0.02%
自基金分级生效日起至今	-10.67%	1.08%	-11.25%	1.11%	0.58%	-0.03%

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

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

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



注：1、截止日期为 2023 年 6 月 30 日。

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

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



注：1、截止日期为2023年6月30日。

2、本基金自2021年8月19日起增加C类份额，相关数据按实际存续期计算。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

截至 2023 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国新兴产业股票型证券投资基金、富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、富国天利增长债券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国中债-1-3 年国开行债券指数证券投资基金、富国全球科技互联网股票型证券投资基金（QDII）、富国鑫旺稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、富国富钱包货币市场基金、富国首创水务封闭式基础设施证券投资基金等 304 只公开募集证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐幼华	本基金现任基金经理	2011-10-12	—	18	硕士，曾任上海京华创业投资有限公司投资部经理助理；自 2006 年 7 月加入富国基金管理有限公司，历任助理数量研究员、研究员、基金经理助理、基金经理、量化与海

					外投资部量化投资副总监，量化与海外投资部量化投资总监；现任富国基金量化投资部副总经理，兼任富国基金资深定量基金经理。自2011年05月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金基金经理；自2011年10月起任富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理；自2018年05月起任富国港股通量化精选股票型证券投资基金基金经理；自2018年05月起任富国中证1000指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理；自2018年07月起任富国大盘价值量化精选混合型证券投资基金基金经理；自2018年12月起任富国MSCI中国A股国际通指数增强型证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。
李笑薇	本基金现任基金经理	2011-10-12	—	21	博士，曾任摩根士丹利资本国际Barra公司(MSCIBARRA)高级研究员，巴克莱国际投资管理公司(BarclaysGlobal Investors)大中华主动股票投资总监、高级基金经理及高级研究员；自2009年6月加入富国基金管理有限公司，历任量化与海外投资部总经理、基金经理、公司总经理助理；现任富国基金副总经理，兼任富国基金资深定量基金经理。自2009年12月起任富国沪深300增强证券投资基金基金经理；自2011年10月起任富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理；具有基金从业资格。
方旻	本基金现任基金经理	2014-11-19	—	13	硕士，自2010年2月加入富国基金管理有限公司，历任定量研究员、基金经理助理、基金经理、量化与海外投资部量化投资总监助理、高级定量基金经理、量化投资部量化投资副总监、量化投资部量化投资总监；现任富国基金量化投资部量化投资总监兼资深定量基金经理。自2014年11月起任富国沪

					<p>深 300 增强证券投资基金基金经理；自 2014 年 11 月起任富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金经理；自 2014 年 11 月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金基金经理；自 2014 年 11 月起任上证综指交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2015 年 10 月起任富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；自 2018 年 05 月起任富国中证 1000 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金经理；自 2019 年 01 月起任富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金基金经理；自 2020 年 02 月起任富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金基金经理；自 2022 年 11 月起任富国中证 1000 优选股票型证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。</p>
--	--	--	--	--	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

注：1、上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国中证 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 34 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**

年初以来，随着主要城市疫情高峰过去，疫情对经济的冲击逐步减小，投资

者对 2023 年经济复苏预期变动更加乐观，A 股迎来开门红。进入 3 月，由于两会政府工作报告公布的 GDP 增速目标低于市场预期，市场迎来一轮快速调整。海外方面，美国公布的 2 月通胀数据超预期，加息预期再次升温，全球资本市场迎来调整。4 月以来，尽管 1-2 月工业企业利润下降一度压制市场情绪，但 3 月 PMI 验证经济进一步向好，提振市场信心。在经济弱复苏，流动性宽裕的背景下，人工智能相关板块迎来加速上涨。石油化工、建筑等板块在中特估及一带一路等主题概念的驱动下也迎来靓丽表现。进入 5 月中旬，由于金融、通胀数据均回落，指向经济内生动能不强，复苏斜率放缓压制市场情绪，同时海外银行业危机和债务违约风险持续发酵，引发市场担忧加剧，各板块均迎来快速调整。6 月初，虽然国内方面经济数据维持弱势，但结构性政策开始落地，结合外资巨头接连访华为经济注入新动力，提振市场信心。6 月下旬，随着短期宏观政策兑现，同时部分 TMT 公司涨幅过大，投资者选择获利了结，叠加人民币进一步贬值及节前避险情绪升温，A 股迎来调整。

总体来看，2023 年上半年上证综指上涨 3.65%，沪深 300 下跌 0.75%，创业板指下跌 5.61%，中证 500 指数上涨 2.29%。

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 2023 年 6 月 30 日，本基金份额净值 A/B 级为 2.267 元，C 级为 2.26 元；份额累计净值 A/B 级为 2.636 元，C 级为 2.26 元；本报告期，本基金份额净值增长率 A/B 级为 4.76%，C 级为 4.68%，同期业绩比较基准收益率 A/B 级为 2.70%，C 级为 2.70%。

#### **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 2023 下半年，积极因素正进一步累积，悲观预期将逐步修正。首先，外部的扰动将逐步缓解。当前市场已将 7 月美联储会议的加息预期较充分地计入，并且后续 8 月没有美联储议息会议的情况下，市场将阶段性进入鹰派信息的“空窗期”，来自美债利率上行、汇率贬值等外部压力已在缓和。其次，6 月份多项经济数据已经止跌企稳、甚至拐头向上，市场对于经济增长的悲观预期仍有望逐步修正。2 季度 GDP 数据虽略不及预期，但 6 月经济数据已经边际回暖。生



产端，尽管工业增加值、服务业生产指数两年复合增速仍低于疫情前水平，但 5-6 月已出现持续改善。消费端，边际上居民收入改善，5-6 月商品消费加速。投资端，基建、制造业投资维持强势。近期各项经济政策也在密集加码落地，如促进家居消费若干措施、促民营经济、城中村改造等政策密集加码。此外，当前市场本身仍处在一个隐含风险溢价较高、多数行业拥挤度较低的位置，具备整体修复的空间。

#### **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 2023 年 1 月 1 日至 2023 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：2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>		
银行存款	547,427,445.91	537,133,143.42
结算备付金	20,712,490.67	4,847,551.51
存出保证金	639,151.30	449,071.86
交易性金融资产	6,818,123,424.1 2	6,460,403,211.71
其中：股票投资	6,818,123,424.1 2	6,460,352,211.04
基金投资	—	—
债券投资	—	51,000.67
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	—	9,144,449.33
应收股利	—	—
应收申购款	8,966,902.70	7,744,536.97
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	7,395,869,414.7 0	7,019,721,964.80
<b>负债和净资产</b>	<b>本期末</b> 2023 年 06 月 30 日	<b>上年度末</b> 2022 年 12 月 31 日
<b>负 债：</b>		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付清算款	185,268.94	—
应付赎回款	18,902,751.59	3,695,118.63
应付管理人报酬	5,972,906.24	6,157,991.71
应付托管费	895,935.95	923,698.76

应付销售服务费	44,291.38	40,280.68
应付投资顾问费	—	—
应交税费	—	0.45
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	8,523,504.47	9,527,683.66
负债合计	34,524,658.57	20,344,773.89
<b>净资产：</b>		
实收基金	3,247,091,518.13	3,234,623,934.90
其他综合收益	—	—
未分配利润	4,114,253,238.00	3,764,753,256.01
净资产合计	7,361,344,756.13	6,999,377,190.91
负债和净资产总计	7,395,869,414.70	7,019,721,964.80

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.267 元，基金份额总额 3,247,091,518.13 份。其中：富国中证 500 指数增强（LOF）A/B 份额净值 2.267 元，份额总额 3,097,878,117.77 份；富国中证 500 指数增强（LOF）C 份额净值 2.260 元，份额总额 149,213,400.36 份。

## 6.2 利润表

会计主体：富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日)	上年度可比期间 (2022 年 01 月 01 日 至 2022 年 06 月 30 日)
<b>一、营业总收入</b>	385,600,090.60	-423,559,291.90
1.利息收入	2,099,596.60	2,357,140.04
其中：存款利息收入	2,099,596.60	2,357,140.04
债券利息收入	—	—
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	—	—
证券出借利息收入	—	—
其他利息收入	—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）	99,923,779.34	-408,880,778.90
其中：股票投资收益	14,465,380.41	-497,998,958.21
基金投资收益	—	—
债券投资收益	969,917.36	1,267,692.40

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	84,488,481.57	87,850,486.91
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）	282,046,918.71	-19,784,689.39
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	1,529,795.95	2,749,036.35
<b>减：二、营业总支出</b>	<b>42,269,720.95</b>	<b>44,159,573.53</b>
1. 管理人报酬	35,994,030.99	37,688,115.10
2. 托管费	5,399,104.62	5,653,217.24
3. 销售服务费	201,945.27	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	2.99	1.31
8. 其他费用	674,637.08	703,026.31
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>343,330,369.65</b>	<b>-467,718,865.43</b>
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>343,330,369.65</b>	<b>-467,718,865.43</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>	<b>—</b>	<b>—</b>
<b>六、综合收益总额</b>	<b>343,330,369.65</b>	<b>-467,718,865.43</b>

### 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：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 (2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日)		
	实收基金	未分配 利润	净资产 合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	3,234,623,934.90	3,764,753,256.01	6,999,377,190.91
加：会计政策变更	—	—	—
二、本期期初净资产 (基金净值)	3,234,623,934.90	3,764,753,256.01	6,999,377,190.91
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	12,467,583.23	349,499,981.99	361,967,565.22
(一)、综合收益总额	—	343,330,369.65	343,330,369.65
(二)、本期基金份额	12,467,583.23	6,169,612.34	18,637,195.57

交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	610,392,917.31	780,327,018.94	1,390,719,936.25
2. 基金赎回款	-597,925,334.08	-774,157,406.60	-1,372,082,740.68
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(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)	3,247,091,518.13	4,114,253,238.00	7,361,344,756.13
项目	上年度可比期间 (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

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。其中，股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产的 90%，投资于中证 500 指数成份股和备选成份股的资产（均含存托凭证）不低于股票资产的 80%；保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2023年6月30日的财务状况以及2023年1月1日至2023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**

本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### **6.4.5 会计差错更正的说明**

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### **6.4.6 税项**

##### 1 印花税

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

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

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

##### 2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值



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

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

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

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

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

### 3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

#### 4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 5 个人所得税

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 (2023年06月30日)
活期存款	547,427,445.91
等于：本金	547,302,257.92
加：应计利息	125,187.99
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	547,427,445.91

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(2023年06月30日)			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	6,954,992,82 6.28	—	6,818,123,42 4.12	— 136,869,402. 16
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	—	—	—
	合计	—	—	—
资产支持证券	—	—	—	—
基金	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	6,954,992,82 6.28	—	6,818,123,42 4.12	— 136,869,402. 16

### 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（2023年06月30日）
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	16,364.65
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	7,769,514.98
其中：交易所市场	7,769,514.98
银行间市场	—
应付利息	—
预提信息披露费	60,000.00
预提审计费	101,720.30
应付指数使用费	575,904.54
合计	8,523,504.47

### 6.4.7.7 实收基金

富国中证500指数增强（LOF）A/B：

金额单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,147,679,233.12	3,147,679,233.12
本期申购	468,975,469.39	468,975,469.39
本期赎回（以“-”号填列）	-518,776,584.74	-518,776,584.74
本期末	3,097,878,117.77	3,097,878,117.77

富国中证500指数增强（LOF）C：

金额单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	86,944,701.78	86,944,701.78
本期申购	141,417,447.92	141,417,447.92
本期赎回（以“-”号填列）	-79,148,749.34	-79,148,749.34
本期末	149,213,400.36	149,213,400.36

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8未分配利润

富国中证500指数增强（LOF）A/B：

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	4,396,786,765.44	- 732,822,436.74	3,663,964,328.70
本期利润	59,858,813.13	276,556,234.18	336,415,047.31
本期基金份额交易产生的变动数	-68,252,650.47	-5,871,074.08	-74,123,724.55
其中：基金申购款	661,418,852.96	-61,593,307.40	599,825,545.56
基金赎回款	-729,671,503.43	55,722,233.32	-673,949,270.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,388,392,928.10	- 462,137,276.64	3,926,255,651.46

富国中证500指数增强（LOF）C：

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	121,016,334.42	- 20,227,407.11	100,788,927.31
本期利润	1,424,637.81	5,490,684.53	6,915,322.34
本期基金份额交易产生的变动数	87,812,187.82	-7,518,850.93	80,293,336.89
其中：基金申购款	198,674,279.62	- 18,172,806.24	180,501,473.38
基金赎回款	- 110,862,091.80	10,653,955.31	-100,208,136.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	210,253,160.05	- 22,255,573.51	187,997,586.54

#### 6.4.7.9存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）
活期存款利息收入	1,943,426.82
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	127,206.27
其他	28,963.51
合计	2,099,596.60

#### 6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）
卖出股票成交总额	10,824,815,623.60
减：卖出股票成本总额	10,782,188,805.30
减：交易费用	28,161,437.89
买卖股票差价收入	14,465,380.41

#### 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（2023年01月01日至2023年06月30日）
债券投资收益——利息收入	821.00
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	969,096.36
合计	969,917.36

##### 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（2023年01月01日至2023年06月30日）
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,770,933.66
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,800,800.00
减：应计利息总额	846.45
减：交易费用	190.85
债券投资收益-差价收入	969,096.36

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

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

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无买卖贵金属交易。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

##### 6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）
股票投资产生的股利收益	84,488,481.57
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	84,488,481.57

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）
1. 交易性金融资产	282,046,918.71
股票投资	282,046,918.71
债券投资	—
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	282,046,918.71

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）
基金赎回费收入	1,522,943.27
基金转换费收入	6,852.68
合计	1,529,795.95

#### 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（2023年01月01日至2023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	5,008.69
指数使用费	575,904.54
其他	3.55
合计	674,637.08

#### 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	基金托管人、基金代销机构
海通期货股份有限公司	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（2023年01月01日至2023年06月30日）		上年度可比期间（2022年01月01日至2022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	3,463,804,398.40	15.99	889,625,605.32	6.40
申万宏源	3,541,589,589.52	16.34	1,236,376,150.23	8.89

#### 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（2023年01月01日至2023年06月30日）		上年度可比期间（2022年01月01日至2022年06月30日）	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
申万宏源	1,204,538.77	25.25	—	—

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2023年01月01日至2023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（%）
海通证券	2,498,452.99	15.98	1,406,304.45	18.10
申万宏源	2,555,299.60	16.35	1,599,064.24	20.58
关联方名称	上年度可比期间（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

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（2023年01月01日至 2023年06月30日）	上年度可比期间（2022年01月 01日至2022年06月30日）
当期发生的基金应支付的管理费	35,994,030.99	37,688,115.10
其中：支付销售机构的客户维护费	12,078,680.85	10,860,803.55

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（2023年01月01 日至2023年06月30 日）	上年度可比期间（2022年01 月01日至2022年06月30 日）
当期发生的基金应支付的托管费	5,399,104.62	5,653,217.24

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

$$H=E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关 联方名称	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富国中证500指数增 强（LOF）A/B	富国中证500指数增 强（LOF）C	合计
富国基金管理有限公司	—	114,521.24	114,521.24
海通证券股份有限公司	—	42.24	42.24

申万宏源证券有限公司	—	68.33	68.33
合计	—	114,631.81	114,631.81

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间（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（LOF）A/B	富国中证500指数增强（LOF）C	合计
富国基金管理有限公司	—	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：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均未与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

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

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

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

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适

用市场化期限费率从事证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）		上年度可比期间（2022年01月01日至2022年06月30日）	
	富国中证500指数增强（LOF）A/B	富国中证500指数增强（LOF）C	富国中证500指数增强（LOF）A/B	富国中证500指数增强（LOF）C
基金合同生效日（2011年10月12日）持有的基金份额	20,003,333.00	—	20,003,333.00	—
期初持有的基金份额	12,657,866.18	395.26	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	12,657,866.18	395.26
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.41%	0.00%	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。

##### 6.4.10.5.2 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（2023年01月01日至2023年06月30日）		上年度可比期间（2022年01月01日至2022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	547,427,445.91	1,943,426.82	561,282,222.03	2,223,193.02

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证

券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023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
001282	三联锻造	2023-05-15	6个月	新股限售	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	—
001286	陕西能源	2023-03-31	6个月	新股限售	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	—
001287	中电港	2023-03-30	6个月	新股限售	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	—
001324	长青科技	2023-05-12	6个月	新股限售	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	—
001360	南矿集团	2023-03-31	6个月	新股限售	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	—
001367	海森药业	2023-03-30	6个月	新股限售	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	—
001380	华纬科技	2023-05-09	6个月	新股限售	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	—
300308	中际旭创	2023-04-24	6个月	大宗交易 限售	74.67	130.25	580,000	43,308,600.00	75,545,000.00	—
300804	广康生化	2023-06-15	6个月	新股限售	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	—
301170	锡南科技	2023-06-16	6个月	新股限售	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	—
301202	朗威股份	2023-06-28	1个月内 (含)	新股认购	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	—
301202	朗威股份	2023-06-28	6个月	新股限售	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	—
301203	国泰环保	2023-03-28	6个月	新股限售	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	—
301210	金杨股份	2023-06-21	6个月	新股限售	57.88	49.17	281	16,264.28	13,816.77	—
301225	恒勃股份	2023-06-08	6个月	新股限售	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	—
301246	宏源药业	2023-03-10	6个月	新股限售	50.00	30.71	931	46,550.00	28,591.01	—
301261	恒工精密	2023-06-29	1个月内 (含)	新股认购	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	—
301261	恒工精密	2023-06-29	6个月	新股限售	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	—
301262	海看股份	2023-06-13	6个月	新股限售	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00	—
301281	科源制药	2023-03-28	6个月	新股限售	44.18	25.10	241	10,647.38	6,049.10	—
301281	科源制药	2023-05-26	5个月	新股限售	—	25.10	97	—	2,434.70	—

				转增						
301293	三博脑科	2023-04-25	6个月	新股限售	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	—
301303	真兰仪表	2023-02-13	6个月	新股限售	26.80	22.32	1,058	28,354.40	23,614.56	—
301305	朗坤环境	2023-05-15	6个月	新股限售	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	—
301315	威士顿	2023-06-13	6个月	新股限售	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	—
301317	鑫磊股份	2023-01-12	6个月	新股限售	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	—
301322	绿通科技	2023-02-27	6个月	新股限售	131.11	53.24	261	34,219.71	13,895.64	—
301322	绿通科技	2023-05-25	4个月	新股限售_转增	—	53.24	131	—	6,974.44	—
301323	新莱福	2023-05-29	6个月	新股限售	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	—
301332	德尔玛	2023-05-09	6个月	新股限售	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	—
301337	亚华电子	2023-05-16	6个月	新股限售	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	—
301345	涛涛车业	2023-03-10	6个月	新股限售	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	—
301357	北方长龙	2023-04-11	6个月	新股限售	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	—
301358	湖南裕能	2023-02-01	6个月	新股限售	23.77	42.89	2,023	48,086.71	86,766.47	—
301360	荣旗科技	2023-04-17	6个月	新股限售	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	—
301376	致欧科技	2023-06-14	6个月	新股限售	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	—
301383	天键股份	2023-05-31	6个月	新股限售	46.16	35.72	493	22,756.88	17,609.96	—
301386	未来电器	2023-03-21	6个月	新股限售	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	—
301387	光大同创	2023-04-10	6个月	新股限售	58.32	45.36	307	17,904.24	13,925.52	—
301395	仁信新材	2023-06-21	1个月内(含)	新股认购	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68	—
301395	仁信新材	2023-06-21	6个月	新股限售	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60	—
301397	溯联股份	2023-06-15	6个月	新股限售	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	—
301399	英特科技	2023-05-16	6个月	新股限售	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	—
301408	华人健康	2023-02-22	6个月	新股限售	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	—
301429	森泰股份	2023-04-10	6个月	新股限售	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	—
301439	泓淋电力	2023-03-10	6个月	新股限售	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	—
301486	致尚科技	2023-06-30	1个月内(含)	新股认购	57.66	57.66	4,338	250,129.08	250,129.08	—
301486	致尚科技	2023-06-30	6个月	新股限售	57.66	57.66	482	27,792.12	27,792.12	—
301488	豪恩汽电	2023-06-26	1个月内(含)	新股认购	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	—
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6个月	新股限售	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	—
601065	江盐集团	2023-03-31	6个月	新股限售	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	—
603125	常青科技	2023-03-30	6个月	新股限售	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	—
688146	中船特气	2023-04-13	6个月	新股限售	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	—
688249	晶合集成	2023-04-24	6个月	新股限售	19.86	18.06	7,405	147,063.30	133,734.30	—
688352	颀中科技	2023-04-11	6个月	新股限售	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	—
688361	中科飞测	2023-05-12	6个月	新股限售	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	—
688429	时创能源	2023-06-20	6个月	新股限售	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	—

688433	华曙高科	2023-04-07	6个月	新股限售	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	—
688458	美芯晟	2023-05-15	6个月	新股限售	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	—
688472	阿特斯	2023-06-02	6个月	新股限售	11.10	17.04	6,261	69,497.10	106,687.44	—
688478	晶升股份	2023-04-13	6个月	新股限售	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	—
688479	友车科技	2023-05-04	6个月	新股限售	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	—
688484	南芯科技	2023-03-28	6个月	新股限售	39.99	36.71	1,008	40,309.92	37,003.68	—
688485	九州一轨	2023-01-11	6个月	新股限售	17.47	15.17	3,580	62,542.60	54,308.60	—
688523	航天环宇	2023-05-26	6个月	新股限售	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	—
688535	华海诚科	2023-03-28	6个月	新股限售	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	—
688543	国科军工	2023-06-14	6个月	新股限售	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	—
688552	航天南湖	2023-05-08	6个月	新股限售	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	—
688570	天玛智控	2023-05-29	6个月	新股限售	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	—
688576	西山科技	2023-05-30	6个月	新股限售	135.80	120.41	240	32,592.00	28,898.40	—
688581	安杰思	2023-05-12	6个月	新股限售	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	—
688593	新相微	2023-05-25	6个月	新股限售	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	—
688603	天承科技	2023-06-30	1个月内 (含)	新股认购	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	—
688603	天承科技	2023-06-30	6个月	新股限售	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	—
688623	双元科技	2023-05-31	6个月	新股限售	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	—
688631	莱斯信息	2023-06-19	6个月	新股限售	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	—

#### 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
601298	青岛港	2023年06月28日	重大事项停牌	6.97	2023年07月03日	7.40	169.00	956.74	1,177.93	—

#### 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 2023 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 2023 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部和合规稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。由于国债、央行票据和政策性金融债的信用风险很低，故不进行列示。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的信用债。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末（2023 年 06 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
AAA	—	—
AAA 以下	—	51,000.67
未评级	—	—
合计	—	51,000.67

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的信用债。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（2023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	547,427,445.91	—	—	—	—	—	547,427,445.91
结算备付金	20,712,490.67	—	—	—	—	—	20,712,490.67
存出保证金	639,151.30	—	—	—	—	—	639,151.30
交易性金融资产	—	—	—	—	—	6,818,123,424.12	6,818,123,424.12
应收申购款	164,937.27	—	—	—	—	8,801,965.43	8,966,902.70
资产总计	568,944,025.15	—	—	—	—	6,826,925,389.55	7,395,869,414.70
负债							
应付清算款	—	—	—	—	—	185,268.94	185,268.94
应付赎回款	—	—	—	—	—	18,902,751.59	18,902,751.59
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	5,972,906.24	5,972,906.24
应付托管费	—	—	—	—	—	895,935.95	895,935.95
应付销售服务费	—	—	—	—	—	44,291.38	44,291.38
其他负债	—	—	—	—	—	8,523,504.47	8,523,504.47
负债总计	—	—	—	—	—	34,524,658.57	34,524,658.57
利率敏感度缺口	568,944,025.15	—	—	—	—	6,792,400,730.98	7,361,344,756.13
上年度末（2022年12月31日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	537,133,143.42	—	—	—	—	—	537,133,143.42
结算备付金	4,847,551.51	—	—	—	—	—	4,847,551.51

存出保证金	449,071.86	—	—	—	—	—	449,071.86
交易性金融资产	—	—	51,000.67	—	—	6,460,352,211.04	6,460,403,211.71
应收清算款	—	—	—	—	—	9,144,449.33	9,144,449.33
应收申购款	262,750.88	—	—	—	—	7,481,786.09	7,744,536.97
资产总计	542,692,517.67	—	51,000.67	—	—	6,476,978,446.46	7,019,721,964.80
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	3,695,118.63	3,695,118.63
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	6,157,991.71	6,157,991.71
应付托管费	—	—	—	—	—	923,698.76	923,698.76
应付销售服务费	—	—	—	—	—	40,280.68	40,280.68
应交税费	—	—	—	—	—	0.45	0.45
其他负债	—	—	—	—	—	9,527,683.66	9,527,683.66
负债总计	—	—	—	—	—	20,344,773.89	20,344,773.89
利率敏感度缺口	542,692,517.67	—	51,000.67	—	—	6,456,633,672.57	6,999,377,190.91

#### 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（2023年06月30日）		上年度末（2022年12月31日）	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	6,818,123,424.12	92.62	6,460,352,211.04	92.30
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	51,000.67	0.00
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—

衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	6,818,123,424.12	92.62	6,460,403,211.71	92.30

#### 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（2023年06月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	1. 业绩比较基准增加1%	69,330,487.12	67,370,578.91
	2. 业绩比较基准减少1%	-69,330,487.12	-67,370,578.91

#### 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
---------------	-----	------

	(2023年06月30日)	(2022年12月31日)
第一层次	6,740,548,881.42	6,357,216,947.19
第二层次	750,190.35	2,711,920.07
第三层次	76,824,352.35	100,474,344.45
合计	6,818,123,424.12	6,460,403,211.71

#### 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	6,818,123,424.12	92.19
	其中：股票	6,818,123,424.12	92.19
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	568,139,936.58	7.68
8	其他各项资产	9,606,054.00	0.13
9	合计	7,395,869,414.70	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

##### 7.2.1.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	12,200,454.31	0.17
C	制造业	863,912,686.94	11.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,660,873.47	0.02
E	建筑业	15,784,526.36	0.21
F	批发和零售业	66,425,996.87	0.90
G	交通运输、仓储和邮政业	2,042,087.00	0.03
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	143,549,978.00	1.95
J	金融业	42,433,019.62	0.58
K	房地产业	13,812,123.14	0.19
L	租赁和商务服务业	8,643,406.98	0.12
M	科学研究和技术服务业	10,069,279.92	0.14



N	水利、环境和公共设施管理业	5,525,835.17	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	5,949,600.00	0.08
Q	卫生和社会工作	1,175,164.86	0.02
R	文化、体育和娱乐业	30,547,493.00	0.41
S	综合	—	—
	合计	1,223,732,525.64	16.62

### 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	72,106,983.56	0.98
B	采矿业	318,137,148.23	4.32
C	制造业	3,630,106,193.93	49.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	118,607,800.10	1.61
E	建筑业	39,804,876.15	0.54
F	批发和零售业	123,915,280.77	1.68
G	交通运输、仓储和邮政业	35,501,513.30	0.48
H	住宿和餐饮业	13,871,400.00	0.19
I	信息传输、软件和信息技术服务业	493,992,592.01	6.71
J	金融业	462,353,065.92	6.28
K	房地产业	80,007,858.02	1.09
L	租赁和商务服务业	24,879,301.49	0.34
M	科学研究和技术服务业	51,714,686.66	0.70
N	水利、环境和公共设施管理业	5,277,145.00	0.07
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	108,853,821.28	1.48
S	综合	15,261,232.06	0.21
	合计	5,594,390,898.48	76.00

### 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	000060	中金岭南	19,136,300	90,897,425.00	1.23
2	300308	中际旭创	633,593	83,447,287.85	1.13
3	002249	大洋电机	14,341,118	81,744,372.60	1.11

4	600497	驰宏锌锗	15,472,500	77,671,950.00	1.06
5	000630	铜陵有色	24,782,300	71,620,847.00	0.97
6	600582	天地科技	11,889,270	69,314,444.10	0.94
7	600909	华安证券	13,444,190	62,784,367.30	0.85
8	300003	乐普医疗	2,734,886	61,835,772.46	0.84
9	000559	万向钱潮	10,690,608	58,263,813.60	0.79
10	002128	电投能源	4,354,750	57,569,795.00	0.78
11	002465	海格通信	5,492,700	56,794,518.00	0.77
12	002340	格林美	8,196,773	56,639,701.43	0.77
13	600885	宏发股份	1,769,925	56,372,111.25	0.77
14	600879	航天电子	6,605,023	56,076,645.27	0.76
15	600959	江苏有线	16,276,390	55,014,198.20	0.75
16	600398	海澜之家	7,846,400	53,983,232.00	0.73
17	002273	水晶光电	4,323,076	51,617,527.44	0.70
18	300136	信维通信	2,438,437	48,963,814.96	0.67
19	002152	广电运通	4,128,494	48,385,949.68	0.66
20	000878	云南铜业	4,282,700	47,323,835.00	0.64
21	000513	丽珠集团	1,210,081	47,084,251.71	0.64
22	600517	国网英大	7,857,734	44,789,083.80	0.61
23	600967	内蒙一机	4,380,209	44,240,110.90	0.60
24	601106	中国一重	13,145,900	44,170,224.00	0.60
25	002078	太阳纸业	4,051,722	43,312,908.18	0.59
26	601168	西部矿业	4,110,700	43,203,457.00	0.59
27	600271	航天信息	3,136,454	42,938,055.26	0.58
28	300088	长信科技	7,012,265	42,283,957.95	0.57
29	600487	亨通光电	2,857,000	41,883,620.00	0.57
30	600489	中金黄金	4,052,911	41,866,570.63	0.57
31	002384	东山精密	1,615,988	41,854,089.20	0.57
32	600143	金发科技	4,692,000	40,961,160.00	0.56
33	002422	科伦药业	1,365,500	40,528,040.00	0.55
34	002600	领益智造	5,669,000	39,172,790.00	0.53
35	000869	张裕A	1,235,375	37,876,597.50	0.51
36	600998	九州通	3,642,348	37,807,572.24	0.51
37	600580	卧龙电驱	2,564,600	37,468,806.00	0.51
38	000156	华数传媒	4,296,153	37,376,531.10	0.51
39	688116	天奈科技	808,251	36,977,483.25	0.50
40	688009	中国通号	6,259,700	36,306,260.00	0.49
41	002250	联化科技	3,463,900	36,232,394.00	0.49
42	600380	健康元	2,839,938	36,095,611.98	0.49
43	300296	利亚德	5,522,039	36,058,914.67	0.49
44	300012	华测检测	1,822,941	35,547,349.50	0.48

45	688777	中控技术	563,860	35,399,130.80	0.48
46	688819	天能股份	918,112	33,823,246.08	0.46
47	601717	郑煤机	2,622,737	32,653,075.65	0.44
48	300383	光环新网	3,022,400	32,490,800.00	0.44
49	002203	海亮股份	2,703,831	32,473,010.31	0.44
50	688256	寒武纪	172,700	32,467,600.00	0.44
51	600208	新湖中宝	13,028,240	32,310,035.20	0.44
52	601108	财通证券	4,365,058	31,603,019.92	0.43
53	000750	国海证券	9,372,820	31,398,947.00	0.43
54	600637	东方明珠	3,995,330	31,243,480.60	0.42
55	000988	华工科技	813,800	30,932,538.00	0.42
56	688538	和辉光电	12,122,200	30,790,388.00	0.42
57	002506	协鑫集成	10,033,297	29,397,560.21	0.40
58	002223	鱼跃医疗	803,000	28,899,970.00	0.39
59	000623	吉林敖东	1,800,536	28,880,597.44	0.39
60	002185	华天科技	3,126,612	28,764,830.40	0.39
61	600699	均胜电子	1,596,452	28,161,413.28	0.38
62	601869	长飞光纤	754,000	27,905,540.00	0.38
63	600409	三友化工	5,111,963	27,860,198.35	0.38
64	000738	航发控制	1,137,462	27,754,072.80	0.38
65	000997	新大陆	1,397,982	26,421,859.80	0.36
66	600177	雅戈尔	4,154,860	26,217,166.60	0.36
67	601997	贵阳银行	5,079,600	26,210,736.00	0.36
68	600598	北大荒	1,943,344	25,904,775.52	0.35
69	600161	天坛生物	953,304	25,882,203.60	0.35
70	300009	安科生物	2,582,869	25,828,690.00	0.35
71	601928	凤凰传媒	2,265,181	25,823,063.40	0.35
72	000563	陕国投A	8,387,830	25,582,881.50	0.35
73	000039	中集集团	3,642,350	25,095,791.50	0.34
74	600718	东软集团	2,331,800	24,856,988.00	0.34
75	600820	隧道股份	4,066,715	24,440,957.15	0.33
76	002966	苏州银行	3,707,000	24,280,850.00	0.33
77	002268	电科网安	870,400	24,258,048.00	0.33
78	601118	海南橡胶	5,315,648	23,814,103.04	0.32
79	300832	新产业	402,430	23,743,370.00	0.32
80	603858	步长制药	1,153,065	23,741,608.35	0.32
81	000937	冀中能源	3,694,032	23,567,924.16	0.32
82	002925	盈趣科技	1,188,905	23,064,757.00	0.31
83	300850	新强联	607,815	22,720,124.70	0.31
84	600299	安迪苏	2,811,000	22,403,670.00	0.30
85	000027	深圳能源	3,343,824	22,035,800.16	0.30

86	600535	天士力	1,502,600	21,802,726.00	0.30
87	603883	老百姓	729,812	21,784,888.20	0.30
88	000783	长江证券	3,709,100	21,512,780.00	0.29
89	002299	圣农发展	1,122,200	21,490,130.00	0.29
90	002065	东华软件	3,036,857	21,440,210.42	0.29
91	600536	中国软件	453,007	21,236,968.16	0.29
92	601231	环旭电子	1,412,600	21,132,496.00	0.29
93	600155	华创云信	3,359,600	20,896,712.00	0.28
94	600755	厦门国贸	2,648,900	20,502,486.00	0.28
95	002463	沪电股份	974,800	20,412,312.00	0.28
96	002595	豪迈科技	578,700	20,329,731.00	0.28
97	300395	菲利华	412,300	20,285,160.00	0.28
98	600166	福田汽车	5,958,300	20,258,220.00	0.28
99	300699	光威复材	640,758	19,767,384.30	0.27
100	600038	中直股份	495,083	19,714,205.06	0.27
101	000830	鲁西化工	1,844,700	19,480,032.00	0.26
102	002156	通富微电	860,006	19,436,135.60	0.26
103	002373	千方科技	1,415,200	19,303,328.00	0.26
104	600008	首创环保	6,567,455	18,914,270.40	0.26
105	002624	完美世界	1,109,400	18,737,766.00	0.25
106	603026	胜华新材	314,815	18,652,788.75	0.25
107	601016	节能风电	5,074,401	18,623,051.67	0.25
108	688390	固德威	111,603	18,622,076.58	0.25
109	300058	蓝色光标	1,913,747	18,505,933.49	0.25
110	600623	华谊集团	2,962,600	18,456,998.00	0.25
111	688208	道通科技	604,298	18,316,272.38	0.25
112	300285	国瓷材料	665,600	18,237,440.00	0.25
113	002429	兆驰股份	3,261,500	17,938,250.00	0.24
114	688567	孚能科技	828,467	17,886,602.53	0.24
115	600563	法拉电子	130,009	17,850,235.70	0.24
116	002797	第一创业	3,104,400	17,757,168.00	0.24
117	600566	济川药业	604,386	17,551,369.44	0.24
118	002439	启明星辰	581,300	17,299,488.00	0.24
119	601162	天风证券	5,797,400	17,276,252.00	0.23
120	002195	二三四五	5,817,500	16,812,575.00	0.23
121	300253	卫宁健康	1,553,391	16,807,690.62	0.23
122	600663	陆家嘴	1,648,916	16,274,800.92	0.22
123	603444	吉比特	33,073	16,242,481.03	0.22
124	601555	东吴证券	2,333,294	16,193,060.36	0.22
125	688385	复旦微电	320,400	16,052,040.00	0.22
126	002673	西部证券	2,527,500	16,049,625.00	0.22

127	002294	信立泰	512,935	15,998,442.65	0.22
128	605358	立昂微	426,480	15,664,610.40	0.21
129	688772	珠海冠宇	773,161	15,579,194.15	0.21
130	688779	长远锂科	1,378,000	15,530,060.00	0.21
131	300357	我武生物	456,800	15,362,184.00	0.21
132	002030	达安基因	1,533,628	15,290,271.16	0.21
133	300073	当升科技	303,700	15,285,221.00	0.21
134	300474	景嘉微	166,900	15,019,331.00	0.20
135	600863	内蒙华电	3,593,700	14,913,855.00	0.20
136	000728	国元证券	2,275,048	14,833,312.96	0.20
137	600131	国网信通	731,181	14,762,544.39	0.20
138	600968	海油发展	4,764,500	14,627,015.00	0.20
139	002926	华西证券	1,739,177	14,452,560.87	0.20
140	601098	中南传媒	1,225,031	14,210,359.60	0.19
141	002025	航天电器	219,800	14,023,240.00	0.19
142	600258	首旅酒店	732,000	13,871,400.00	0.19
143	600556	天下秀	1,950,300	13,827,627.00	0.19
144	600549	厦门钨业	723,100	13,760,593.00	0.19
145	601718	际华集团	4,603,100	13,671,207.00	0.19
146	000932	华菱钢铁	2,863,960	13,661,089.20	0.19
147	688002	睿创微纳	304,300	13,632,640.00	0.19
148	688521	芯原股份	188,016	13,522,110.72	0.18
149	600066	宇通客车	916,400	13,507,736.00	0.18
150	603160	汇顶科技	290,974	13,457,547.50	0.18
151	002244	滨江集团	1,522,687	13,430,099.34	0.18
152	600096	云天化	781,000	13,331,670.00	0.18
153	601198	东兴证券	1,650,400	13,236,208.00	0.18
154	000400	许继电气	573,820	13,226,551.00	0.18
155	601608	中信重工	3,089,800	13,008,058.00	0.18
156	600985	淮北矿业	1,116,600	12,863,232.00	0.17
157	002138	顺络电子	522,200	12,485,802.00	0.17
158	000553	安道麦A	1,468,339	12,392,781.16	0.17
159	603228	景旺电子	481,425	12,348,551.25	0.17
160	000729	燕京啤酒	982,495	12,251,712.65	0.17
161	688185	康希诺	149,945	12,220,517.50	0.17
162	603456	九洲药业	439,022	12,020,422.36	0.16
163	600167	联美控股	1,674,300	11,669,871.00	0.16
164	603317	天味食品	794,059	11,601,201.99	0.16
165	002028	思源电气	247,000	11,539,840.00	0.16
166	600282	南钢股份	3,414,100	11,505,517.00	0.16
167	300438	鹏辉能源	236,200	11,347,048.00	0.15

168	300618	寒锐钴业	335,300	10,867,073.00	0.15
169	300144	宋城演艺	868,400	10,768,160.00	0.15
170	000089	深圳机场	1,510,300	10,496,585.00	0.14
171	600873	梅花生物	1,149,800	10,267,714.00	0.14
172	603707	健友股份	751,452	10,144,602.00	0.14
173	002497	雅化集团	562,372	9,998,974.16	0.14
174	600153	建发股份	910,600	9,934,646.00	0.13
175	002500	山西证券	1,757,500	9,806,850.00	0.13
176	600350	山东高速	1,538,000	9,797,060.00	0.13
177	600060	海信视像	391,817	9,697,470.75	0.13
178	688105	诺唯赞	310,000	9,451,900.00	0.13
179	600109	国金证券	1,086,457	9,419,582.19	0.13
180	600673	东阳光	1,304,877	9,408,163.17	0.13
181	600739	辽宁成大	704,111	9,259,059.65	0.13
182	000975	银泰黄金	776,740	9,087,858.00	0.12
183	002745	木林森	986,600	9,076,720.00	0.12
184	600498	烽火通信	442,034	9,004,232.58	0.12
185	688107	安路科技	162,400	8,995,336.00	0.12
186	600352	浙江龙盛	960,600	8,981,610.00	0.12
187	002568	百润股份	246,100	8,945,735.00	0.12
188	603885	吉祥航空	578,500	8,926,255.00	0.12
189	603218	日月股份	467,083	8,869,906.17	0.12
190	600901	江苏金租	2,103,839	8,688,855.07	0.12
191	002683	广东宏大	289,800	8,531,712.00	0.12
192	601958	金钼股份	761,319	8,488,706.85	0.12
193	603927	中科软	219,453	8,462,107.68	0.11
194	600597	光明乳业	813,300	8,458,320.00	0.11
195	600499	科达制造	744,100	8,452,976.00	0.11
196	600988	赤峰黄金	626,400	8,431,344.00	0.11
197	000893	亚钾国际	366,407	8,405,376.58	0.11
198	300390	天华新能	234,128	8,381,782.40	0.11
199	600511	国药股份	213,700	8,302,245.00	0.11
200	000066	中国长城	600,100	8,299,383.00	0.11
201	301029	怡合达	183,506	8,199,048.08	0.11
202	600848	上海临港	683,540	8,168,303.00	0.11
203	000807	云铝股份	636,275	8,099,780.75	0.11
204	000598	兴蓉环境	1,441,159	7,825,493.37	0.11
205	603267	鸿远电子	118,700	7,751,110.00	0.11
206	688072	拓荆科技	18,000	7,667,460.00	0.10
207	300724	捷佳伟创	67,809	7,618,341.15	0.10
208	002399	海普瑞	663,400	7,609,198.00	0.10

209	002092	中泰化学	1,176,500	7,588,425.00	0.10
210	600995	南网储能	680,400	7,491,204.00	0.10
211	300487	蓝晓科技	119,950	7,487,279.00	0.10
212	600481	双良节能	534,378	7,470,604.44	0.10
213	601665	齐鲁银行	1,878,113	7,362,202.96	0.10
214	600486	扬农化工	84,200	7,360,764.00	0.10
215	000933	神火股份	565,000	7,345,000.00	0.10
216	002353	杰瑞股份	288,834	7,258,398.42	0.10
217	002153	石基信息	511,790	7,165,060.00	0.10
218	002563	森马服饰	1,148,300	7,142,426.00	0.10
219	600808	马钢股份	2,772,480	7,125,273.60	0.10
220	688006	杭可科技	231,704	7,060,020.88	0.10
221	600707	彩虹股份	1,471,400	7,003,864.00	0.10
222	002081	金螳螂	1,550,100	6,990,951.00	0.09
223	688234	天岳先进	92,000	6,802,480.00	0.09
224	300861	美畅股份	154,302	6,692,077.74	0.09
225	300251	光线传媒	826,100	6,683,149.00	0.09
226	002032	苏泊尔	132,000	6,600,000.00	0.09
227	603589	口子窖	132,600	6,543,810.00	0.09
228	600418	江淮汽车	519,000	6,534,210.00	0.09
229	601128	常熟银行	942,379	6,427,024.78	0.09
230	603866	桃李面包	634,380	6,419,925.60	0.09
231	000785	居然之家	1,672,800	6,373,368.00	0.09
232	600529	山东药玻	227,700	6,197,994.00	0.08
233	600827	百联股份	461,078	6,164,612.86	0.08
234	300017	网宿科技	859,177	6,108,748.47	0.08
235	688516	奥特维	31,745	5,980,758.00	0.08
236	300115	长盈精密	496,240	5,910,218.40	0.08
237	000009	中国宝安	484,927	5,853,068.89	0.08
238	688301	奕瑞科技	20,307	5,735,306.01	0.08
239	002056	横店东磁	311,890	5,679,516.90	0.08
240	603338	浙江鼎力	100,800	5,645,808.00	0.08
241	603529	爱玛科技	174,700	5,628,834.00	0.08
242	002155	湖南黄金	451,300	5,505,860.00	0.07
243	600170	上海建工	2,026,900	5,452,361.00	0.07
244	002739	万达电影	427,019	5,354,818.26	0.07
245	300182	捷成股份	847,800	5,349,618.00	0.07
246	688295	中复神鹰	145,700	5,344,276.00	0.07
247	600369	西南证券	1,383,800	5,050,870.00	0.07
248	300568	星源材质	291,100	5,004,009.00	0.07
249	600141	兴发集团	224,251	4,982,857.22	0.07

250	000967	盈峰环境	983,700	4,967,685.00	0.07
251	000683	远兴能源	689,400	4,956,786.00	0.07
252	601992	金隅集团	2,240,300	4,883,854.00	0.07
253	600867	通化东宝	448,187	4,679,072.28	0.06
254	600171	上海贝岭	254,100	4,637,325.00	0.06
255	001914	招商积余	306,400	4,611,320.00	0.06
256	600399	抚顺特钢	450,800	4,598,160.00	0.06
257	000930	中粮科技	561,800	4,550,580.00	0.06
258	002625	光启技术	291,757	4,452,211.82	0.06
259	000581	威孚高科	278,450	4,385,587.50	0.06
260	300776	帝尔激光	66,143	4,292,680.70	0.06
261	600316	洪都航空	183,026	4,291,959.70	0.06
262	601187	厦门银行	847,200	4,252,944.00	0.06
263	601058	赛轮轮胎	373,000	4,248,470.00	0.06
264	000825	太钢不锈	1,078,491	4,173,760.17	0.06
265	300418	昆仑万维	100,480	4,047,334.40	0.05
266	600348	华阳股份	510,950	4,041,614.50	0.05
267	603939	益丰药房	108,753	4,023,861.00	0.05
268	002407	多氟多	201,040	3,992,654.40	0.05
269	601991	大唐发电	1,201,500	3,976,965.00	0.05
270	603233	大参林	139,382	3,904,089.82	0.05
271	600528	中铁工业	393,300	3,885,804.00	0.05
272	603355	莱克电气	148,598	3,775,875.18	0.05
273	000031	大悦城	1,007,966	3,689,155.56	0.05
274	603596	伯特利	46,300	3,669,738.00	0.05
275	002518	科士达	91,100	3,644,911.00	0.05
276	002372	伟星新材	174,600	3,586,284.00	0.05
277	603000	人民网	121,100	3,536,120.00	0.05
278	600079	人福医药	124,500	3,354,030.00	0.05
279	600521	华海药业	179,762	3,309,418.42	0.04
280	600956	新天绿能	379,000	3,304,880.00	0.04
281	600373	中文传媒	246,856	3,288,121.92	0.04
282	603379	三美股份	137,800	3,239,678.00	0.04
283	000958	电投产融	744,400	3,223,252.00	0.04
284	002690	美亚光电	124,860	3,215,145.00	0.04
285	300026	红日药业	582,315	3,156,147.30	0.04
286	002110	三钢闽光	744,600	3,142,212.00	0.04
287	300373	扬杰科技	76,434	3,100,927.38	0.04
288	603688	石英股份	27,000	3,073,680.00	0.04
289	600160	巨化股份	222,700	3,068,806.00	0.04
290	603225	新凤鸣	273,417	3,021,257.85	0.04



291	600927	永安期货	183,916	2,990,474.16	0.04
292	600372	中航电子	186,800	2,835,624.00	0.04
293	603127	昭衍新药	69,213	2,830,811.70	0.04
294	300363	博腾股份	95,647	2,830,194.73	0.04
295	601611	中国核建	333,400	2,817,230.00	0.04
296	688690	纳微科技	70,989	2,757,922.65	0.04
297	300682	朗新科技	117,700	2,740,056.00	0.04
298	603786	科博达	41,400	2,719,980.00	0.04
299	000739	普洛药业	152,400	2,703,576.00	0.04
300	688200	华峰测控	17,600	2,692,800.00	0.04
301	000591	太阳能	394,800	2,676,744.00	0.04
302	000887	中鼎股份	204,000	2,670,360.00	0.04
303	002240	盛新锂能	81,700	2,603,779.00	0.04
304	603056	德邦股份	167,500	2,582,850.00	0.04
305	002131	利欧股份	1,044,800	2,403,040.00	0.03
306	002831	裕同科技	95,500	2,329,245.00	0.03
307	000987	越秀资本	345,100	2,191,385.00	0.03
308	000636	风华高科	138,600	2,126,124.00	0.03
309	688248	南网科技	55,300	2,122,967.00	0.03
310	600195	中牧股份	179,100	2,091,888.00	0.03
311	002430	杭氧股份	60,800	2,089,088.00	0.03
312	002368	太极股份	49,792	2,049,936.64	0.03
313	300146	汤臣倍健	84,500	2,026,310.00	0.03
314	002409	雅克科技	27,318	1,990,935.84	0.03
315	688188	柏楚电子	10,443	1,969,132.08	0.03
316	600021	上海电力	178,400	1,921,368.00	0.03
317	601000	唐山港	520,482	1,837,301.46	0.02
318	603658	安图生物	35,300	1,826,069.00	0.02
319	300604	长川科技	38,400	1,823,616.00	0.02
320	300676	华大基因	29,354	1,760,946.46	0.02
321	600329	达仁堂	39,200	1,759,688.00	0.02
322	600157	永泰能源	1,228,500	1,744,470.00	0.02
323	000960	锡业股份	112,000	1,741,600.00	0.02
324	601228	广州港	532,027	1,718,447.21	0.02
325	002192	融捷股份	25,423	1,699,019.09	0.02
326	002532	天山铝业	279,000	1,671,210.00	0.02
327	601778	晶科科技	312,600	1,544,244.00	0.02
328	000402	金融街	337,200	1,524,144.00	0.02
329	688082	盛美上海	13,600	1,501,440.00	0.02
330	601966	玲珑轮胎	67,200	1,493,184.00	0.02
331	688052	纳芯微	9,100	1,441,167.00	0.02

332	688099	晶晨股份	16,800	1,416,576.00	0.02
333	600390	五矿资本	262,700	1,413,326.00	0.02
334	600655	豫园股份	203,100	1,393,266.00	0.02
335	002958	青农商行	508,600	1,383,392.00	0.02
336	002653	海思科	57,800	1,364,080.00	0.02
337	603737	三棵树	20,840	1,363,352.80	0.02
338	002326	永太科技	86,800	1,327,172.00	0.02
339	002508	老板电器	51,200	1,294,848.00	0.02
340	600862	中航高科	51,000	1,290,810.00	0.02
341	601077	渝农商行	357,375	1,282,976.25	0.02
342	688520	神州细胞	22,600	1,282,324.00	0.02
343	688029	南微医学	15,400	1,256,024.00	0.02
344	000898	鞍钢股份	450,500	1,252,390.00	0.02
345	600416	湘电股份	65,000	1,240,850.00	0.02
346	600435	北方导航	105,400	1,211,046.00	0.02
347	000883	湖北能源	243,300	1,109,448.00	0.02
348	600298	安琪酵母	30,400	1,100,784.00	0.01
349	688276	百克生物	16,800	1,051,680.00	0.01
350	603826	坤彩科技	20,400	1,020,000.00	0.01
351	300677	英科医疗	45,800	1,007,600.00	0.01
352	002080	中材科技	48,500	995,220.00	0.01
353	600871	石化油服	495,500	981,090.00	0.01
354	000012	南玻A	157,400	938,104.00	0.01
355	601568	北元集团	176,400	929,628.00	0.01
356	000998	隆平高科	58,500	897,975.00	0.01
357	002432	九安医疗	25,200	887,292.00	0.01
358	601139	深圳燃气	117,200	854,388.00	0.01
359	600315	上海家化	29,400	852,894.00	0.01
360	603517	绝味食品	19,600	728,140.00	0.01
361	603156	养元饮品	28,800	711,360.00	0.01
362	600297	广汇汽车	337,700	702,416.00	0.01
363	300037	新宙邦	12,500	648,625.00	0.01
364	603712	七一二	17,500	528,675.00	0.01
365	300212	易华录	15,300	508,419.00	0.01
366	000709	河钢股份	207,100	468,046.00	0.01
367	601005	重庆钢铁	278,600	390,040.00	0.01
368	300866	安克创新	4,200	367,500.00	0.00
369	002266	浙富控股	74,800	308,924.00	0.00
370	603868	飞科电器	4,280	270,025.20	0.00
371	000959	首钢股份	74,300	260,050.00	0.00
372	600062	华润双鹤	12,900	224,718.00	0.00

373	603893	瑞芯微	2,200	160,270.00	0.00
374	002468	申通快递	12,800	138,496.00	0.00
375	600970	中材国际	8,108	103,377.00	0.00
376	600859	王府井	4,100	81,139.00	0.00
377	002505	鹏都农牧	29,100	54,999.00	0.00
378	300741	华宝股份	300	6,426.00	0.00
379	600118	中国卫星	200	5,642.00	0.00
380	300558	贝达药业	100	4,803.00	0.00
381	002444	巨星科技	215	4,704.20	0.00
382	600765	中航重机	166	4,400.66	0.00
383	300001	特锐德	200	4,156.00	0.00
384	600737	中粮糖业	420	3,381.00	0.00
385	002867	周大生	175	3,111.50	0.00
386	000050	深天马A	300	2,754.00	0.00
387	601636	旗滨集团	300	2,586.00	0.00
388	601577	长沙银行	305	2,366.80	0.00
389	600839	四川长虹	400	2,020.00	0.00
390	000021	深科技	100	1,999.00	0.00
391	600377	宁沪高速	200	1,966.00	0.00
392	600642	申能股份	250	1,747.50	0.00
393	002019	亿帆医药	100	1,460.00	0.00
394	601598	中国外运	295	1,374.70	0.00
395	601298	青岛港	169	1,177.93	0.00
396	000778	新兴铸管	200	816.00	0.00
397	003035	南网能源	100	712.00	0.00
398	601179	中国西电	100	541.00	0.00
399	300070	碧水源	100	536.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601607	上海医药	2,335,350	52,335,193.50	0.71
2	000725	京东方A	11,324,100	46,315,569.00	0.63
3	000338	潍柴动力	2,816,091	35,088,493.86	0.48
4	002085	万丰奥威	4,864,992	33,714,394.56	0.46
5	600728	佳都科技	4,013,508	27,813,610.44	0.38
6	600406	国电南瑞	1,075,656	24,847,653.60	0.34
7	300463	迈克生物	1,630,448	24,652,373.76	0.33
8	000555	神州信息	1,785,700	21,964,110.00	0.30
9	300661	圣邦股份	237,610	19,514,909.30	0.27

10	601600	中国铝业	3,469,700	19,048,653.00	0.26
11	603096	新经典	904,900	18,423,764.00	0.25
12	688598	金博股份	100,794	17,286,171.00	0.23
13	601369	陕鼓动力	1,857,000	16,917,270.00	0.23
14	000538	云南白药	312,346	16,391,918.08	0.22
15	601222	林洋能源	1,770,228	14,498,167.32	0.20
16	601766	中国中车	2,183,000	14,189,500.00	0.19
17	002396	星网锐捷	590,900	13,348,431.00	0.18
18	002049	紫光国微	140,400	13,092,300.00	0.18
19	600104	上汽集团	863,800	12,240,046.00	0.17
20	688707	振华新材	353,652	10,888,945.08	0.15
21	002446	盛路通信	1,111,387	10,502,607.15	0.14
22	603993	洛阳钼业	1,910,800	10,184,564.00	0.14
23	603599	广信股份	375,500	10,168,540.00	0.14
24	601615	明阳智能	588,900	9,940,632.00	0.14
25	601728	中国电信	1,678,134	9,447,894.42	0.13
26	601319	中国人保	1,612,700	9,418,168.00	0.13
27	600884	杉杉股份	619,000	9,371,660.00	0.13
28	000157	中联重科	1,373,100	9,268,425.00	0.13
29	301039	中集车辆	691,865	9,153,373.95	0.12
30	600050	中国联通	1,899,600	9,118,080.00	0.12
31	300433	蓝思科技	748,400	8,801,184.00	0.12
32	600875	东方电气	469,300	8,752,445.00	0.12
33	300226	上海钢联	268,560	8,701,344.00	0.12
34	000100	TCL 科技	2,207,160	8,696,210.40	0.12
35	002027	分众传媒	1,251,268	8,521,135.08	0.12
36	300627	华测导航	259,348	8,421,029.56	0.11
37	600741	华域汽车	453,900	8,378,994.00	0.11
38	688100	威胜信息	275,245	8,205,053.45	0.11
39	300855	图南股份	229,285	8,098,346.20	0.11
40	000990	诚志股份	1,060,278	8,079,318.36	0.11
41	603612	索通发展	449,300	7,786,369.00	0.11
42	002782	可立克	505,500	7,729,095.00	0.10
43	601877	正泰电器	275,400	7,614,810.00	0.10
44	603301	振德医疗	256,900	7,609,378.00	0.10
45	601668	中国建筑	1,317,700	7,563,598.00	0.10
46	002885	京泉华	345,596	7,547,816.64	0.10
47	002304	洋河股份	56,709	7,448,727.15	0.10
48	601318	中国平安	158,200	7,340,480.00	0.10
49	600376	首开股份	1,836,000	7,160,400.00	0.10
50	300035	中科电气	594,200	7,142,284.00	0.10

51	601801	皖新传媒	749,700	7,039,683.00	0.10
52	600660	福耀玻璃	195,600	7,012,260.00	0.10
53	002291	遥望科技	520,800	6,822,480.00	0.09
54	300059	东方财富	478,175	6,790,085.00	0.09
55	603027	千禾味业	313,624	6,623,738.88	0.09
56	688733	壹石通	209,109	6,474,014.64	0.09
57	300775	三角防务	188,000	6,350,640.00	0.09
58	002839	张家港行	1,492,184	6,311,938.32	0.09
59	603859	能科科技	121,200	6,196,956.00	0.08
60	000333	美的集团	104,000	6,127,680.00	0.08
61	300842	帝科股份	67,000	6,126,480.00	0.08
62	603158	腾龙股份	783,580	6,002,222.80	0.08
63	600276	恒瑞医药	125,200	5,997,080.00	0.08
64	603377	东方时尚	740,000	5,949,600.00	0.08
65	688267	中触媒	279,013	5,878,803.91	0.08
66	300132	青松股份	1,031,800	5,850,306.00	0.08
67	001269	欧晶科技	78,400	5,764,752.00	0.08
68	603283	赛腾股份	127,600	5,678,200.00	0.08
69	300258	精锻科技	391,200	5,668,488.00	0.08
70	002727	一心堂	214,600	5,665,440.00	0.08
71	603600	永艺股份	590,850	5,618,983.50	0.08
72	002829	星网宇达	127,400	5,596,682.00	0.08
73	688559	海目星	117,637	5,530,115.37	0.08
74	002371	北方华创	17,273	5,486,768.45	0.07
75	603323	苏农银行	1,301,530	5,479,441.30	0.07
76	603136	天目湖	211,200	5,448,960.00	0.07
77	603306	华懋科技	187,200	5,432,544.00	0.07
78	600219	南山铝业	1,762,000	5,321,240.00	0.07
79	002245	蔚蓝锂芯	484,000	5,299,800.00	0.07
80	600567	山鹰国际	2,273,800	5,207,002.00	0.07
81	300532	今天国际	250,020	5,140,411.20	0.07
82	000651	格力电器	138,516	5,057,219.16	0.07
83	605333	沪光股份	300,300	4,966,962.00	0.07
84	300470	中密控股	106,600	4,927,052.00	0.07
85	600064	南京高科	741,195	4,899,298.95	0.07
86	601677	明泰铝业	351,040	4,872,435.20	0.07
87	688377	迪威尔	194,200	4,864,710.00	0.07
88	603466	风语筑	345,400	4,801,060.00	0.07
89	603309	维力医疗	310,030	4,796,164.10	0.07
90	688800	瑞可达	75,144	4,670,199.60	0.06
91	300760	迈瑞医疗	15,200	4,556,960.00	0.06

92	300207	欣旺达	267,200	4,360,704.00	0.06
93	002048	宁波华翔	318,697	4,270,539.80	0.06
94	688711	宏微科技	71,016	4,143,073.44	0.06
95	002698	博实股份	234,800	4,106,652.00	0.06
96	688020	方邦股份	81,100	4,052,567.00	0.06
97	301011	华立科技	169,800	3,978,414.00	0.05
98	688636	智明达	71,371	3,925,405.00	0.05
99	603799	华友钴业	85,000	3,902,350.00	0.05
100	000425	徐工机械	560,200	3,792,554.00	0.05
101	603639	海利尔	203,700	3,650,304.00	0.05
102	300451	创业慧康	434,050	3,637,339.00	0.05
103	600309	万华化学	41,400	3,636,576.00	0.05
104	603605	珀莱雅	31,568	3,548,243.20	0.05
105	002675	东诚药业	238,800	3,512,748.00	0.05
106	300763	锦浪科技	32,503	3,383,562.30	0.05
107	300593	新雷能	146,090	3,346,921.90	0.05
108	301004	嘉益股份	86,200	3,344,560.00	0.05
109	600562	国睿科技	205,600	3,330,720.00	0.05
110	688180	君实生物	82,200	3,167,988.00	0.04
111	688126	沪硅产业	142,700	2,982,430.00	0.04
112	301117	佳缘科技	45,800	2,959,596.00	0.04
113	300767	震安科技	116,400	2,951,904.00	0.04
114	688608	恒玄科技	24,300	2,941,029.00	0.04
115	002661	克明食品	261,400	2,878,014.00	0.04
116	603383	顶点软件	51,000	2,826,420.00	0.04
117	601618	中国中冶	705,400	2,800,438.00	0.04
118	002060	粤水电	423,800	2,788,604.00	0.04
119	603303	得邦照明	201,600	2,784,096.00	0.04
120	603214	爱婴室	170,300	2,770,781.00	0.04
121	600522	中天科技	173,000	2,752,430.00	0.04
122	300790	宇瞳光学	179,050	2,728,722.00	0.04
123	002215	诺普信	360,000	2,703,600.00	0.04
124	603186	华正新材	76,800	2,641,920.00	0.04
125	603348	文灿股份	60,300	2,641,743.00	0.04
126	300636	同和药业	214,300	2,627,318.00	0.04
127	002912	中新赛克	59,400	2,614,194.00	0.04
128	601868	中国能建	1,112,500	2,603,250.00	0.04
129	300806	斯迪克	137,760	2,578,867.20	0.04
130	300796	贝斯美	211,700	2,546,751.00	0.03
131	688798	艾为电子	41,640	2,463,006.00	0.03
132	300762	上海瀚讯	205,400	2,417,558.00	0.03

133	688388	嘉元科技	89,180	2,400,725.60	0.03
134	603378	亚士创能	262,125	2,387,958.75	0.03
135	603185	弘元绿能	29,700	2,214,135.00	0.03
136	300719	安达维尔	155,700	2,198,484.00	0.03
137	002391	长青股份	318,000	2,184,660.00	0.03
138	002929	润建股份	50,300	2,183,523.00	0.03
139	300628	亿联网络	61,800	2,167,326.00	0.03
140	000682	东方电子	222,000	2,157,840.00	0.03
141	000063	中兴通讯	46,800	2,131,272.00	0.03
142	300203	聚光科技	104,400	2,116,188.00	0.03
143	300803	指南针	43,400	2,108,806.00	0.03
144	605266	健之佳	25,100	2,104,133.00	0.03
145	688981	中芯国际	41,060	2,074,351.20	0.03
146	002807	江阴银行	559,700	2,065,293.00	0.03
147	688239	航宇科技	28,800	2,014,560.00	0.03
148	002419	天虹股份	344,000	2,012,400.00	0.03
149	600183	生益科技	140,000	1,988,000.00	0.03
150	002020	京新药业	152,380	1,953,511.60	0.03
151	688131	皓元医药	33,600	1,914,528.00	0.03
152	603920	世运电路	96,025	1,875,368.25	0.03
153	600537	亿晶光电	243,200	1,858,048.00	0.03
154	688022	瀚川智能	50,400	1,820,952.00	0.02
155	601006	大秦铁路	239,500	1,779,485.00	0.02
156	000656	金科股份	1,574,100	1,747,251.00	0.02
157	600761	安徽合力	87,587	1,745,608.91	0.02
158	300454	深信服	14,800	1,676,100.00	0.02
159	600583	海油工程	285,000	1,667,250.00	0.02
160	688235	百济神州	15,000	1,636,650.00	0.02
161	600986	浙文互联	252,900	1,618,560.00	0.02
162	600011	华能国际	174,300	1,614,018.00	0.02
163	688578	艾力斯	59,805	1,611,744.75	0.02
164	688201	信安世纪	37,700	1,611,298.00	0.02
165	603489	八方股份	22,560	1,581,907.20	0.02
166	300590	移为通信	128,000	1,564,160.00	0.02
167	002594	比亚迪	6,000	1,549,620.00	0.02
168	688722	同益中	81,346	1,508,154.84	0.02
169	002609	捷顺科技	128,800	1,501,808.00	0.02
170	600845	宝信软件	29,520	1,499,911.20	0.02
171	688168	安博通	42,000	1,495,200.00	0.02
172	002483	润邦股份	253,200	1,468,560.00	0.02
173	688676	金盘科技	47,959	1,452,678.11	0.02

174	688089	嘉必优	48,600	1,448,280.00	0.02
175	300294	博雅生物	36,800	1,335,104.00	0.02
176	002484	江海股份	62,700	1,334,883.00	0.02
177	688021	奥福环保	49,800	1,290,816.00	0.02
178	603987	康德莱	99,700	1,288,124.00	0.02
179	600458	时代新材	107,400	1,287,726.00	0.02
180	002180	纳思达	37,305	1,277,696.25	0.02
181	688078	龙软科技	24,600	1,268,130.00	0.02
182	688533	上声电子	27,113	1,266,990.49	0.02
183	600869	远东股份	228,600	1,261,872.00	0.02
184	688206	概伦电子	44,800	1,256,192.00	0.02
185	002752	昇兴股份	259,600	1,233,100.00	0.02
186	688202	美迪西	14,400	1,227,600.00	0.02
187	600000	浦发银行	166,800	1,207,632.00	0.02
188	603551	奥普家居	91,600	1,184,388.00	0.02
189	603308	应流股份	64,400	1,178,520.00	0.02
190	605088	冠盛股份	67,600	1,159,340.00	0.02
191	600941	中国移动	12,400	1,156,920.00	0.02
192	300642	透景生命	57,300	1,155,741.00	0.02
193	603195	公牛集团	12,000	1,152,720.00	0.02
194	002937	兴瑞科技	46,800	1,151,280.00	0.02
195	300378	鼎捷软件	33,200	1,137,100.00	0.02
196	002410	广联达	34,880	1,133,251.20	0.02
197	600908	无锡银行	211,200	1,132,032.00	0.02
198	605123	派克新材	10,400	1,129,960.00	0.02
199	002765	蓝黛科技	133,100	1,112,716.00	0.02
200	300687	赛意信息	38,400	1,066,752.00	0.01
201	688268	华特气体	13,200	1,065,636.00	0.01
202	300450	先导智能	27,100	980,207.00	0.01
203	603181	皇马科技	87,600	975,864.00	0.01
204	688157	松井股份	17,920	942,592.00	0.01
205	000062	深圳华强	79,000	902,180.00	0.01
206	000951	中国重汽	53,400	899,790.00	0.01
207	603171	税友股份	22,200	887,556.00	0.01
208	688039	当虹科技	24,583	881,054.72	0.01
209	300681	英搏尔	41,200	877,148.00	0.01
210	603667	五洲新春	55,168	820,899.84	0.01
211	688270	臻镭科技	12,500	811,625.00	0.01
212	002241	歌尔股份	44,720	793,780.00	0.01
213	002212	天融信	81,753	793,004.10	0.01
214	300705	九典制药	28,800	761,184.00	0.01



215	688032	禾迈股份	2,129	756,114.35	0.01
216	002859	洁美科技	27,200	753,440.00	0.01
217	003038	鑫铂股份	18,100	750,426.00	0.01
218	300708	聚灿光电	74,400	734,328.00	0.01
219	688261	东微半导	5,140	718,931.80	0.01
220	600426	华鲁恒升	22,500	689,175.00	0.01
221	300610	晨化股份	59,100	686,151.00	0.01
222	002706	良信股份	60,400	679,500.00	0.01
223	601012	隆基绿能	23,500	673,745.00	0.01
224	600584	长电科技	20,400	635,868.00	0.01
225	000938	紫光股份	19,600	624,260.00	0.01
226	300416	苏试试验	28,800	620,928.00	0.01
227	605166	聚合顺	66,000	615,120.00	0.01
228	000999	华润三九	10,100	612,666.00	0.01
229	002603	以岭药业	23,800	611,422.00	0.01
230	300623	捷捷微电	33,600	608,832.00	0.01
231	301239	普瑞眼科	6,200	608,096.00	0.01
232	600436	片仔癀	2,100	601,356.00	0.01
233	301071	力量钻石	13,500	594,000.00	0.01
234	600200	江苏吴中	81,600	588,336.00	0.01
235	603005	晶方科技	28,800	581,760.00	0.01
236	301181	标榜股份	19,200	577,728.00	0.01
237	600129	太极集团	9,700	577,053.00	0.01
238	300122	智飞生物	12,900	570,180.00	0.01
239	601398	工商银行	118,200	569,724.00	0.01
240	000516	国际医学	64,600	543,286.00	0.01
241	688617	惠泰医疗	1,433	535,583.75	0.01
242	300896	爱美客	1,200	533,940.00	0.01
243	605136	丽人丽妆	45,600	525,768.00	0.01
244	300848	美瑞新材	24,900	516,675.00	0.01
245	600519	贵州茅台	300	507,300.00	0.01
246	002990	盛视科技	13,500	496,800.00	0.01
247	301367	怡和嘉业	3,000	445,020.00	0.01
248	002988	豪美新材	23,600	403,324.00	0.01
249	605060	联德股份	11,600	318,536.00	0.00
250	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.00
251	000915	华特达因	7,300	257,617.00	0.00
252	603809	豪能股份	22,000	247,060.00	0.00
253	603527	众源新材	19,600	239,512.00	0.00
254	601127	赛力斯	5,700	209,589.00	0.00
255	300860	锋尚文化	3,500	194,040.00	0.00

256	300653	正海生物	5,500	189,145.00	0.00
257	688560	明冠新材	6,800	188,972.00	0.00
258	600933	爱柯迪	8,000	186,320.00	0.00
259	300124	汇川技术	2,800	179,788.00	0.00
260	603613	国联股份	4,732	174,752.76	0.00
261	002543	万和电气	19,200	151,872.00	0.00
262	688121	卓然股份	3,900	145,860.00	0.00
263	688259	创耀科技	1,774	140,412.10	0.00
264	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.00
265	601872	招商轮船	23,800	137,802.00	0.00
266	600547	山东黄金	5,737	134,704.76	0.00
267	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.00
268	605369	拱东医疗	2,300	128,892.00	0.00
269	601699	潞安环能	7,590	123,868.80	0.00
270	600026	中远海能	9,700	122,608.00	0.00
271	688680	海优新材	1,000	121,820.00	0.00
272	688308	欧科亿	2,705	108,200.00	0.00
273	002726	龙大美食	13,000	107,770.00	0.00
274	688472	阿特斯	6,261	106,687.44	0.00
275	002897	意华股份	2,300	106,444.00	0.00
276	600570	恒生电子	2,400	106,296.00	0.00
277	603606	东方电缆	2,160	105,904.80	0.00
278	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.00
279	688050	爱博医疗	500	102,665.00	0.00
280	600559	老白干酒	4,000	98,040.00	0.00
281	300782	卓胜微	1,000	96,630.00	0.00
282	002202	金风科技	9,000	95,580.00	0.00
283	601088	中国神华	2,929	90,066.75	0.00
284	688639	华恒生物	985	89,122.80	0.00
285	300413	芒果超媒	2,600	88,946.00	0.00
286	600929	雪天盐业	11,126	88,340.44	0.00
287	000811	冰轮环境	5,588	88,066.88	0.00
288	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.00
289	300662	科锐国际	2,400	84,888.00	0.00
290	002434	万里扬	9,416	84,273.20	0.00
291	603681	永冠新材	5,880	83,966.40	0.00
292	300382	斯莱克	6,000	79,140.00	0.00
293	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
294	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.00
295	688122	西部超导	1,372	76,461.56	0.00
296	300835	龙磁科技	2,435	76,410.30	0.00

297	603345	安井食品	506	74,280.80	0.00
298	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
299	688008	澜起科技	1,200	68,904.00	0.00
300	300751	迈为股份	388	65,719.44	0.00
301	688123	聚辰股份	1,170	62,852.40	0.00
302	688066	航天宏图	1,027	62,544.30	0.00
303	002701	奥瑞金	13,800	62,238.00	0.00
304	300996	普联软件	2,020	62,014.00	0.00
305	605128	上海沿浦	1,500	60,765.00	0.00
306	600690	海尔智家	2,400	56,352.00	0.00
307	688063	派能科技	279	55,311.75	0.00
308	688485	九州一轨	3,580	54,308.60	0.00
309	688361	中科飞测-U	831	53,740.77	0.00
310	688037	芯源微	312	53,336.40	0.00
311	600633	浙数文化	3,200	51,872.00	0.00
312	300928	华安鑫创	1,200	49,488.00	0.00
313	688148	芳源股份	4,051	49,422.20	0.00
314	300910	瑞丰新材	980	49,294.00	0.00
315	688621	阳光诺和	756	44,467.92	0.00
316	300647	超频三	6,100	43,798.00	0.00
317	002938	鹏鼎控股	1,800	43,722.00	0.00
318	688529	豪森股份	1,600	41,792.00	0.00
319	002176	江特电机	3,400	40,528.00	0.00
320	603890	春秋电子	4,600	39,376.00	0.00
321	600648	外高桥	3,440	38,906.40	0.00
322	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
323	002812	恩捷股份	400	38,540.00	0.00
324	605168	三人行	435	37,383.90	0.00
325	688484	南芯科技	1,008	37,003.68	0.00
326	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
327	688155	先惠技术	630	34,183.80	0.00
328	605286	同力日升	1,100	31,812.00	0.00
329	300142	沃森生物	1,200	31,740.00	0.00
330	300752	隆利科技	1,862	31,709.86	0.00
331	301035	润丰股份	400	31,428.00	0.00
332	002390	信邦制药	6,800	30,124.00	0.00
333	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
334	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
335	000733	振华科技	300	28,755.00	0.00
336	301246	宏源药业	931	28,591.01	0.00
337	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00

338	000895	双汇发展	1,100	26,939.00	0.00
339	600110	诺德股份	3,600	26,064.00	0.00
340	600201	生物股份	2,600	24,726.00	0.00
341	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
342	301303	真兰仪表	1,058	23,614.56	0.00
343	603666	亿嘉和	500	22,575.00	0.00
344	301349	信德新材	450	22,563.00	0.00
345	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
346	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
347	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
348	603898	好莱客	2,200	21,384.00	0.00
349	301322	绿通科技	392	20,870.08	0.00
350	688329	艾隆科技	643	20,833.20	0.00
351	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
352	601390	中国中铁	2,600	19,708.00	0.00
353	600210	紫江企业	3,700	19,684.00	0.00
354	300685	艾德生物	800	19,408.00	0.00
355	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
356	600132	重庆啤酒	200	18,432.00	0.00
357	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
358	300072	海新能科	5,200	17,784.00	0.00
359	603055	台华新材	1,600	17,776.00	0.00
360	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
361	301383	天键股份	493	17,609.96	0.00
362	600196	复星医药	564	17,427.60	0.00
363	000726	鲁泰A	2,500	17,100.00	0.00
364	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
365	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
366	688595	芯海科技	500	15,990.00	0.00
367	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
368	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
369	301177	迪阿股份	400	15,372.00	0.00
370	300759	康龙化成	400	15,312.00	0.00
371	688700	东威科技	152	15,158.96	0.00
372	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
373	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
374	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
375	301397	溯联股份	362	14,552.40	0.00
376	688085	三友医疗	550	14,443.00	0.00
377	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
378	301387	光大同创	307	13,925.52	0.00

379	301210	金杨股份	281	13,816.77	0.00
380	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
381	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
382	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
383	003022	联泓新科	493	12,275.70	0.00
384	300014	亿纬锂能	200	12,100.00	0.00
385	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
386	002790	瑞尔特	1,200	11,520.00	0.00
387	600025	华能水电	1,600	11,408.00	0.00
388	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
389	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
390	688166	博瑞医药	500	10,995.00	0.00
391	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
392	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
393	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
394	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
395	300630	普利制药	500	9,775.00	0.00
396	688389	普门科技	409	9,607.41	0.00
397	688139	海尔生物	186	9,573.42	0.00
398	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
399	000921	海信家电	346	9,324.70	0.00
400	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
401	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
402	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
403	600882	妙可蓝多	400	8,912.00	0.00
404	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
405	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
406	301281	科源制药	338	8,483.80	0.00
407	002959	小熊电器	100	8,350.00	0.00
408	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
409	300655	晶瑞电材	400	7,964.00	0.00
410	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
411	688187	时代电气	183	7,660.38	0.00
412	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
413	600039	四川路桥	756	7,416.36	0.00
414	300181	佐力药业	600	7,326.00	0.00
415	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
416	002006	精工科技	300	6,471.00	0.00
417	002171	楚江新材	900	6,408.00	0.00
418	601688	华泰证券	400	5,508.00	0.00
419	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00

420	601155	新城控股	359	5,173.19	0.00
421	601567	三星医疗	400	5,052.00	0.00
422	600989	宝丰能源	400	5,044.00	0.00
423	300174	元力股份	300	4,731.00	0.00
424	600446	金证股份	300	4,362.00	0.00
425	603733	仙鹤股份	200	4,170.00	0.00
426	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
427	601658	邮储银行	800	3,912.00	0.00
428	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
429	002043	兔宝宝	300	3,273.00	0.00
430	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
431	600966	博汇纸业	400	2,368.00	0.00
432	002697	红旗连锁	400	2,336.00	0.00
433	002053	云南能投	200	2,244.00	0.00
434	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
435	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
436	603212	赛伍技术	100	2,081.00	0.00
437	603313	梦百合	200	2,006.00	0.00
438	600548	深高速	200	1,796.00	0.00
439	000090	天健集团	300	1,512.00	0.00
440	688518	联赢激光	34	947.24	0.00
441	601333	广深铁路	100	396.00	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	002340	格林美	80,923,619.55	1.16
2	600497	驰宏锌锗	78,959,432.00	1.13
3	002250	联化科技	71,243,020.37	1.02
4	000513	丽珠集团	68,792,568.07	0.98
5	300308	中际旭创	68,468,991.00	0.98
6	300003	乐普医疗	67,202,138.01	0.96
7	002249	大洋电机	63,004,535.88	0.90
8	600487	亨通光电	60,016,555.00	0.86
9	002465	海格通信	57,781,596.00	0.83
10	002384	东山精密	57,380,664.32	0.82
11	002128	电投能源	57,325,238.30	0.82
12	300418	昆仑万维	57,129,830.95	0.82
13	600959	江苏有线	56,553,935.90	0.81
14	002268	电科网安	55,679,214.36	0.80

15	600582	天地科技	54,388,760.00	0.78
16	000807	云铝股份	52,076,077.63	0.74
17	600879	航天电子	51,730,620.41	0.74
18	688116	天奈科技	51,696,395.76	0.74
19	002739	万达电影	51,316,932.00	0.73
20	601607	上海医药	50,845,077.32	0.73

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	300017	网宿科技	85,171,456.88	1.22
2	600160	巨化股份	84,343,316.68	1.21
3	600867	通化东宝	76,602,105.00	1.09
4	688063	派能科技	71,463,675.37	1.02
5	300308	中际旭创	68,651,289.00	0.98
6	002030	达安基因	67,605,755.80	0.97
7	002065	东华软件	61,879,230.63	0.88
8	688122	西部超导	61,292,321.34	0.88
9	600667	太极实业	61,061,231.14	0.87
10	600373	中文传媒	59,898,211.19	0.86
11	300073	当升科技	59,271,663.14	0.85
12	600528	中铁工业	58,534,306.13	0.84
13	300776	帝尔激光	56,658,485.99	0.81
14	000878	云南铜业	55,212,086.68	0.79
15	600718	东软集团	54,789,781.20	0.78
16	600839	四川长虹	54,545,917.09	0.78
17	000729	燕京啤酒	54,422,930.45	0.78
18	601577	长沙银行	54,114,659.36	0.77
19	000807	云铝股份	53,450,832.28	0.76
20	600064	南京高科	52,281,615.40	0.75

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	10,857,913,099.67
卖出股票收入（成交）总额	10,824,815,623.60

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交

---

金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### **7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合**

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### **7.10 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金根据基金合同的约定，不允许投资股指期货。

#### **7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

##### **7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

##### **7.11.2 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末未投资国债期货。

#### **7.12 投资组合报告附注**

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

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 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库**

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

##### **7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元



序号	名称	金额
1	存出保证金	639,151.30
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	8,966,902.70
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	9,606,054.00

#### 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	300308	中际旭创	75,545,000.00	1.03	大宗交易限售

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

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中未持有流通受限股票。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
富国中证 500 指数增强 (LOF) A/B	632,897	4,894.76	454,983,751.43	14.69	2,642,894,366.34	85.31
富国中证 500 指数增强 (LOF) C	7,362	20,268.05	123,137,547.63	82.52	26,075,852.73	17.48
合计	640,259	5,071.53	578,121,299.06	17.80	2,668,970,219.07	82.20

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

富国中证 500 指数增强 (LOF) A/B

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	丁飞	788,200.00	1.19
2	合肥黄山大厦酒店管理集团有限公司	748,920.00	1.13
3	吴林萍	707,463.00	1.07
4	厦门市营嘉系统集成技术有限公司	560,658.00	0.85
5	陈阳	500,000.00	0.75
6	董理	404,400.00	0.61
7	孙选艳	403,718.00	0.61
8	张莲	371,000.00	0.56
9	李宏伟	362,575.00	0.55
10	章晖	357,897.00	0.54

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	富国中证 500 指数增强 (LOF) A/B	1,653,017.50	0.0534
	富国中证 500 指数增强 (LOF) C	3,293.56	0.0022
	合计	1,656,311.06	0.0510

#### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	富国中证 500 指数增强 (LOF) A/B	富国中证 500 指数增强 (LOF) C
基金合同生效日(2011 年 10 月 12 日)基金份额总额	455,487,249.88	—
报告期期初基金份额总额	3,147,679,233.12	86,944,701.78
本报告期基金总申购份额	468,975,469.39	141,417,447.92
减：本报告期基金总赎回份额	518,776,584.74	79,148,749.34
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	3,097,878,117.77	149,213,400.36

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
安信证券	2	390,970,388.67	1.80	282,006.00	1.80	—
德邦证券	2	—	—	—	—	—
东北证券	2	855,848,485.45	3.95	617,319.80	3.95	—
东方证券	2	788,945,299.20	3.64	569,069.08	3.64	—

国海证券	2	649,347,775.13	3.00	468,376.02	3.00	—
国联证券	1	1,503,713,714.21	6.94	1,084,630.74	6.94	—
国泰君安	2	1,088,177,926.21	5.02	784,903.23	5.02	—
海通证券	1	3,463,804,398.40	15.99	2,498,452.99	15.98	—
华兴证券	1	—	—	—	—	—
汇丰前海	2	—	—	—	—	—
开源证券	4	4,805,601,012.31	22.18	3,466,279.58	22.18	—
申万宏源	4	3,541,589,589.52	16.34	2,555,299.60	16.35	—
兴业证券	2	2,432,497,250.56	11.23	1,754,579.91	11.23	—
浙商证券	1	—	—	—	—	—
中泰证券	1	713,211,227.38	3.29	514,426.88	3.29	—
中信建投	2	—	—	—	—	—
中信证券	2	1,434,802,960.43	6.62	1,034,924.25	6.62	—

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
安信证券	—	—	—	—	—	—
德邦证券	—	—	—	—	—	—
东北证券	402,101.00	8.43	—	—	—	—
东方证券	—	—	—	—	—	—
国海证券	—	—	—	—	—	—
国联证券	2,560,241.70	53.66	—	—	—	—
国泰君安	—	—	—	—	—	—
海通证券	—	—	—	—	—	—
华兴证券	—	—	—	—	—	—
汇丰前海	—	—	—	—	—	—
开源证券	335,011.24	7.02	—	—	—	—
申万宏源	1,204,538.77	25.25	—	—	—	—

---

兴业证券	2,280.46	0.05	—	—	—	—
浙商证券	—	—	—	—	—	—
中泰证券	72,009.96	1.51	—	—	—	—
中信建投	—	—	—	—	—	—
中信证券	194,750.53	4.08	—	—	—	—

## **10.8 其他重大事件**

注：本基金本报告期无需要说明的重大事件。



---

## § 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 : <a href="http://www.fullgoal.com.cn">http://www.fullgoal.com.cn</a> 。