

富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）

二〇二三年中期报告

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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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 .....	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 .....	16
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	16
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 .....	22
§7	投资组合报告 .....	46
7.1	期末基金资产组合情况 .....	46

7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	46
7.3	期末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.....	47
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	56
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	58
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.....	58
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.....	59
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.....	59
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.....	59
7.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	59
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	59
7.12	投资组合报告附注.....	59
§8	基金份额持有人信息.....	61
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	61
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	61
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	61
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.....	62
§9	开放式基金份额变动.....	63
§10	重大事件揭示.....	64
10.1	基金份额持有人大会决议.....	64
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.....	64
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	64
10.4	基金投资策略的改变.....	64
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	64
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.....	64
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	64
10.8	其他重大事件.....	68
§11	影响投资者决策的其他重要信息.....	69
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.....	69
§12	备查文件目录.....	70



## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）	
基金简称	富国新兴成长量化精选混合（LOF）	
场内简称	成长 LOF	
基金主代码	161038	
基金运作方式	契约型，开放式	
基金合同生效日	2017 年 07 月 21 日	
基金管理人	富国基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	22,726,677.85 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	2017 年 8 月 18 日	
下属分级基金的基金简称	富国新兴成长量化精选混合（LOF）A	富国新兴成长量化精选混合（LOF）C
下属分级基金场内简称	成长 LOF	—
下属分级基金的交易代码	161038	014171
报告期末下属分级基金的份额总额	22,017,087.09 份	709,590.76 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	利用定量投资模型，在严格控制风险的前提下，追求资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金主要投资于新兴成长股票，指在中国经济转型升级和产业结构调整的大背景下，具备新技术、新工艺、新材料、新市场需求、新商业模式等新兴要素的成长性产业的股票。本基金通过定量与定性相结合的方法，采用“自上而下”的资产配置方法确定各类资产的配置比例；本基金主要通过定量投资模型，选取并持有预期收益较好的新兴成长股票构成投资组合，在有效控制风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报；债券投资方面，本基金将制定久期控制下的资产类属配置策略，具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。本基金的存托凭证投资策略、资产支持证券投资策略、中小企业私募债券投资策略、权证投资策略和其他金融衍生工具投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×47.5%+创业板指数收益率×47.5%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	王小飞
	联系电话	021-20361818	021-60637103
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		95105686、4008880688	021-60637228
传真		021-20361616	021-60635778
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	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		裴长江	田国立

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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 中国建设银行股份有限公司 北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

### 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) 富国新兴成长量化精选混合 (LOF) A

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	-3,114,708.47
本期利润	-1,310,886.78
加权平均基金份额本期利润	-0.0424
本期加权平均净值利润率	-3.25%
本期基金份额净值增长率	-4.27%
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	5,114,433.55
期末可供分配基金份额利润	0.2323
期末基金资产净值	27,131,520.64
期末基金份额净值	1.2323
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	23.23%

##### (2) 富国新兴成长量化精选混合 (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	57,373.20
本期利润	404,344.67
加权平均基金份额本期利润	0.2574
本期加权平均净值利润率	19.39%
本期基金份额净值增长率	-4.38%
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	162,428.54
期末可供分配基金份额利润	0.2289
期末基金资产净值	872,019.30
期末基金份额净值	1.2289
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	-20.80%

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) 富国新兴成长量化精选混合(LOF) 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	2.61%	0.96%	0.10%	1.04%	2.51%	-0.08%
过去三个月	-4.87%	0.85%	-6.18%	0.87%	1.31%	-0.02%
过去六个月	-4.27%	0.81%	-1.56%	0.84%	-2.71%	-0.03%
过去一年	-18.76%	1.01%	-13.53%	1.02%	-5.23%	-0.01%
过去三年	8.06%	1.19%	-2.12%	1.30%	10.18%	-0.11%
自基金合同生效起至今	23.23%	1.25%	15.27%	1.39%	7.96%	-0.14%

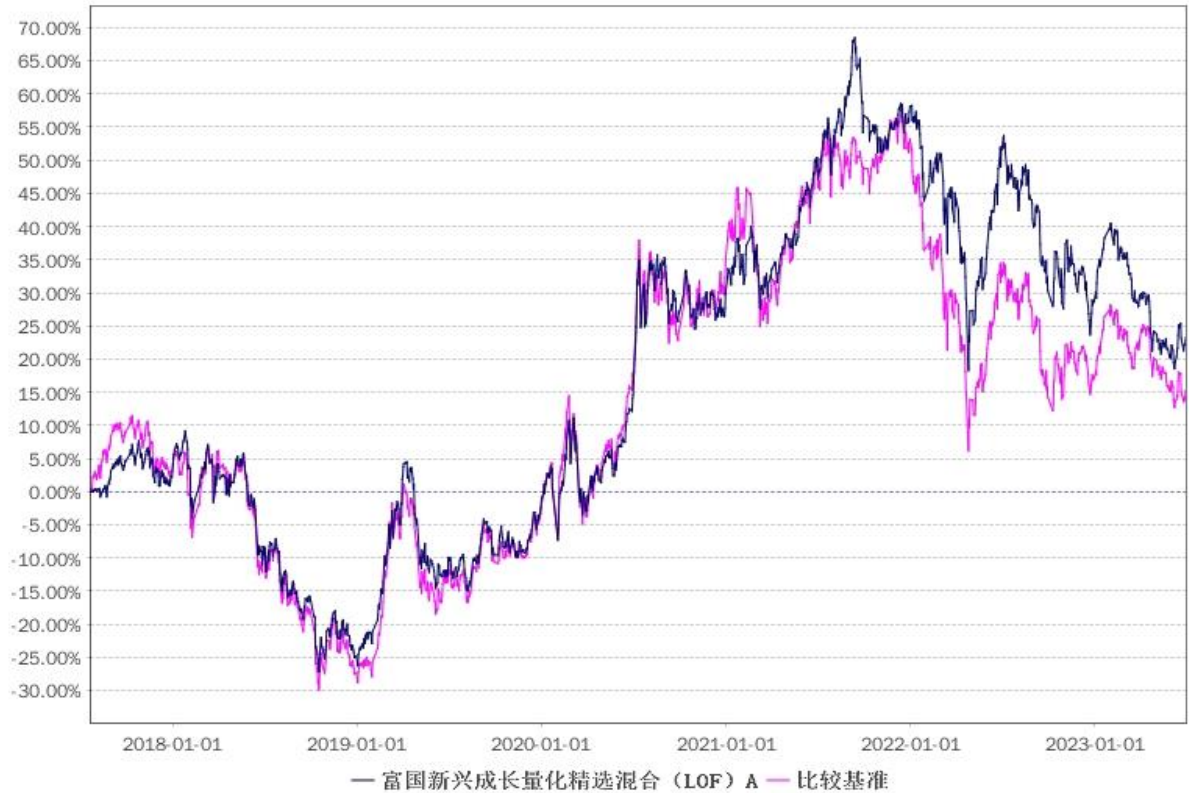
##### (2) 富国新兴成长量化精选混合(LOF) C

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	2.59%	0.96%	0.10%	1.04%	2.49%	-0.08%
过去三个月	-4.92%	0.85%	-6.18%	0.87%	1.26%	-0.02%
过去六个月	-4.38%	0.81%	-1.56%	0.84%	-2.82%	-0.03%
过去一年	-18.93%	1.01%	-13.53%	1.02%	-5.40%	-0.01%
自基金分级生效日起至今	-20.80%	1.21%	-24.48%	1.25%	3.68%	-0.04%

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

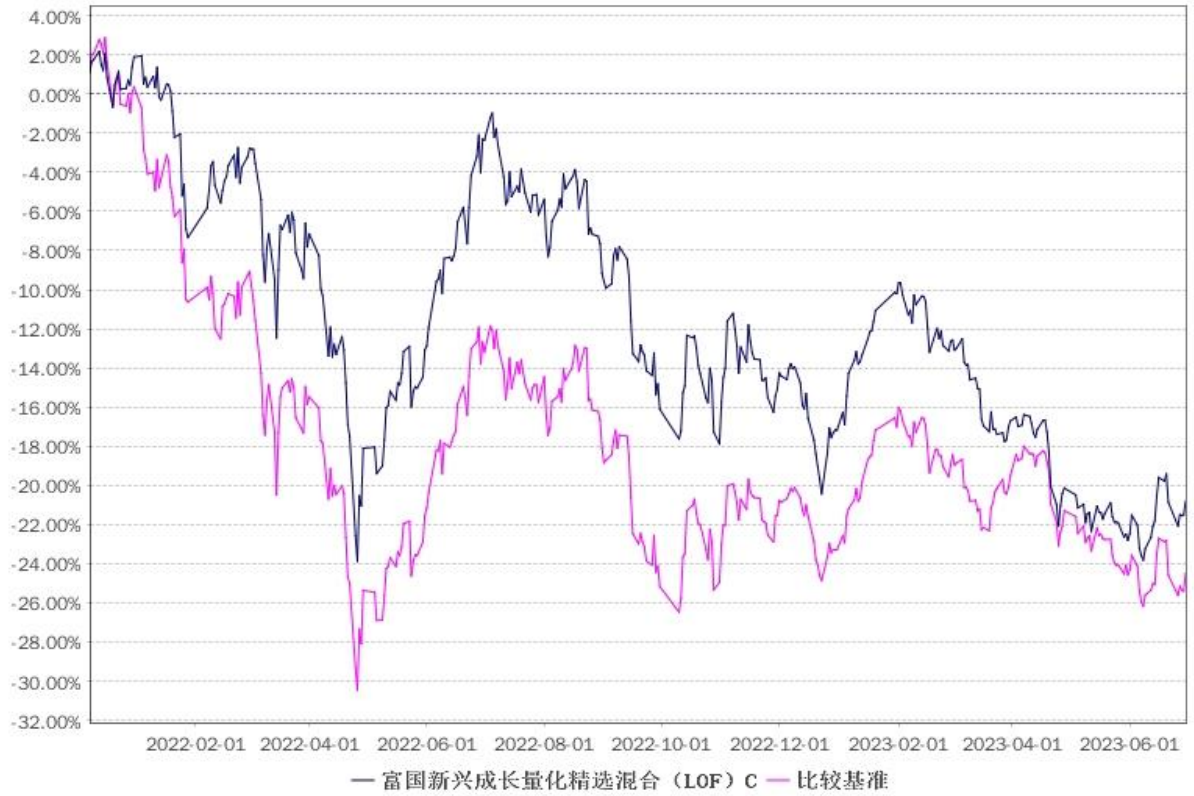
(1) 自基金合同生效以来富国新兴成长量化精选混合(LOF) A 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2023 年 6 月 30 日。

2、本基金于 2017 年 7 月 21 日成立，建仓期 6 个月，从 2017 年 7 月 21 日起至 2018 年 1 月 20 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新兴成长量化精选混合 (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 12 月 7 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		
王保合	本基金现任基金经理	2020-09-15	—	17	博士，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

					<p>投资总监；现任富国基金量化投资部总经理，兼任富国基金资深定量基金经理。自 2011 年 03 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 2011 年 03 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 2013 年 09 月起任富国创业板指数型证券投资基金(原富国创业板指数分级证券投资基金)基金经理；自 2015 年 04 月起任富国中证国有企业改革指数型证券投资基金(原富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金)基金经理；自 2015 年 05 月起任富国中证全指证券公司指数型证券投资基金(原富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金)基金经理；自 2015 年 05 月起任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)基金经理；自 2019 年 11 月起任富国中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2019 年 12 月起任富国中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；自 2020 年 09 月起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；自 2022 年 10 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 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；自 2023 年 03 月起任富国创业板增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。</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新兴成长量化精选混合型证券投资基金（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》、《富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（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 8 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**

2023 年年初以来，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 级为 1.2323 元，C 级为 1.2289 元；份额累计净值 A 级为 1.2323 元，C 级为 1.2289 元；本报告期，本基金份额净值增长率 A 级为-4.27%，C 级为-4.38%，同期业绩比较基准收益率 A 级为-1.56%，C 级为-1.56%。

#### 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 年下半年，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**

1、本报告期内本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

2、自 2023 年 3 月 8 日至 2023 年 6 月 30 日，本基金存在资产净值连续六十个工作日低于五千万元的情况，基金管理人已向中国证监会报告此情形并将采取适当措施。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支、等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 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

本托管人复核审查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。

## § 6 中期财务报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（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	1,052,519.18	108,793.30
结算备付金	127,960.71	300,907.66
存出保证金	15,104.79	20,570.67
交易性金融资产	27,005,894.24	56,179,305.18
其中：股票投资	26,091,749.12	53,118,676.41
基金投资	—	—
债券投资	914,145.12	3,060,628.77
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	—	78,442.57
应收股利	—	—
应收申购款	685.47	3,553.88
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	28,202,164.39	56,691,573.26
<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	—	—
应付赎回款	5,638.75	680.46
应付管理人报酬	20,443.41	47,794.76
应付托管费	5,678.71	13,276.32
应付销售服务费	128.80	879.78
应付投资顾问费	—	—
应交税费	—	0.01

应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	166,734.78	296,207.52
负债合计	198,624.45	358,838.85
<b>净资产：</b>		
实收基金	22,726,677.85	43,773,813.20
其他综合收益	—	—
未分配利润	5,276,862.09	12,558,921.21
净资产合计	28,003,539.94	56,332,734.41
负债和净资产总计	28,202,164.39	56,691,573.26

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.2322 元，基金份额总额 22,726,677.85 份。其中：富国新兴成长量化精选混合（LOF）A 份额净值 1.2323 元，份额总额 22,017,087.09 份；富国新兴成长量化精选混合（LOF）C 份额净值 1.2289 元，份额总额 709,590.76 份。

## 6.2 利润表

会计主体：富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（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>	-619,931.83	-4,304,361.60
1.利息收入	6,857.35	12,006.82
其中：存款利息收入	6,857.35	12,006.82
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）	-2,789,544.24	-10,268,175.45
其中：股票投资收益	-3,019,983.76	-11,111,502.15
基金投资收益	—	—
债券投资收益	5,389.05	41,237.62
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	225,050.47	802,089.08
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）	2,150,793.16	5,904,391.95
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	11,961.90	47,415.08
<b>减：二、营业总支出</b>	<b>286,610.28</b>	<b>648,312.67</b>
1. 管理人报酬	189,947.95	445,799.00
2. 托管费	52,763.33	123,833.00
3. 销售服务费	2,182.08	2,076.45
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	—	0.01
8. 其他费用	41,716.92	76,604.21
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-906,542.11</b>	<b>-4,952,674.27</b>
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-906,542.11</b>	<b>-4,952,674.27</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>-906,542.11</b>	<b>-4,952,674.27</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（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）	43,773,813.20	12,558,921.21	56,332,734.41
加：会计政策变更	—	—	—
二、本期期初净资产（基金净值）	43,773,813.20	12,558,921.21	56,332,734.41
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	—	-7,282,059.12	—
（一）、综合收益总额	21,047,135.35	-906,542.11	28,329,194.47
（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）	—	-6,375,517.01	—
其中：1. 基金申购款	21,047,135.35	787,673.09	27,422,652.36
2. 基金赎回款	2,484,611.62	-7,163,190.10	3,272,284.71
（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）	22,726,677.85	5,276,862.09	28,003,539.94
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）	71,148,015.46	41,362,602.78	112,510,618.24
加：会计政策变更	—	—	—
二、本期期初净资产（基金净值）	71,148,015.46	41,362,602.78	112,510,618.24
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-6,459,681.38	-7,933,580.66	-14,393,262.04
（一）、综合收益总额	—	-4,952,674.27	-4,952,674.27
（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）	-6,459,681.38	-2,980,906.39	-9,440,587.77
其中：1.基金申购款	18,521,397.34	7,730,399.12	26,251,796.46
2.基金赎回款	—	—	—
	24,981,078.72	10,711,305.51	-35,692,384.23
（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）	64,688,334.08	33,429,022.12	98,117,356.20

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

陈戈

林志松

徐慧

基金管理人 基金管理公司负责人

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

富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（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[2016]2912号《关于准予富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）注册的批复》

的核准，由基金管理人富国基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于 2017 年 7 月 21 日生效。首次设立募集规模为 632,370,666.56 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 11 月 30 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 12 月 7 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（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、国家债券、央行票据、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据、中小企业私募债券、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、衍生工具（股指期货、权证等）以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）。

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：本基金股票及存托凭证资产的投资比例占基金资产的 60-95%；其中投资于新兴成长相关股票及存托凭证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，现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例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。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×47.5%+创业板指数收益率×47.5%+银行活期存款利率（税后）×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《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	1,052,519.18
等于：本金	1,052,417.44
加：应计利息	101.74
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	1,052,519.18

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	26,792,691.29	—	26,091,749.12	-700,942.17	
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—	
债券	交易所市场	899,372.00	14,265.12	914,145.12	508.00
	银行间市场	—	—	—	—
	合计	899,372.00	14,265.12	914,145.12	508.00
资产支持证券	—	—	—	—	
基金	—	—	—	—	
其他	—	—	—	—	
合计	27,692,063.29	14,265.12	27,005,894.24	-700,434.17	

### 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	—
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	92,307.86
其中：交易所市场	92,307.86
银行间市场	—
应付利息	—
预提信息披露费	32,500.00
预提审计费	41,926.92
合计	166,734.78

#### 6.4.7.7 实收基金

富国新兴成长量化精选混合（LOF）A：

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	37,318,938.47	37,318,938.47
本期申购	1,575,511.91	1,575,511.91
本期赎回（以“-”号填列）	-16,877,363.29	-16,877,363.29
本期末	22,017,087.09	22,017,087.09

富国新兴成长量化精选混合（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	6,454,874.73	6,454,874.73
本期申购	909,099.71	909,099.71
本期赎回（以“-”号填列）	-6,654,383.68	-6,654,383.68
本期末	709,590.76	709,590.76

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

富国新兴成长量化精选混合（LOF）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	19,688,499.16	- 8,970,319.05	10,718,180.11
本期利润	-3,114,708.47	1,803,821.69	-1,310,886.78
本期基金份额交易产生的变动数	-7,369,443.71	3,076,583.93	-4,292,859.78
其中：基金申购款	805,035.02	-291,074.93	513,960.09
基金赎回款	-8,174,478.73	3,367,658.86	-4,806,819.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,204,346.98	- 4,089,913.43	5,114,433.55

富国新兴成长量化精选混合（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	3,393,121.27	- 1,552,380.17	1,840,741.10
本期利润	57,373.20	346,971.47	404,344.67
本期基金份额交易产生的变动数	- 3,156,096.80	1,073,439.57	-2,082,657.23
其中：基金申购款	459,641.40	-185,928.40	273,713.00
基金赎回款	- 3,615,738.20	1,259,367.97	-2,356,370.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	294,397.67	-131,969.13	162,428.54

#### 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	4,161.25
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	2,439.95
其他	256.15
合计	6,857.35

#### 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	231,360,391.56

减：卖出股票成本总额	233,800,390.95
减：交易费用	579,984.37
买卖股票差价收入	-3,019,983.76

#### 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	4,908.38
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	480.67
合计	5,389.05

##### 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	3,085,534.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,022,035.59
减：应计利息总额	63,016.83
减：交易费用	0.91
债券投资收益-差价收入	480.67

#### 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	225,050.47
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	225,050.47

#### 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	2,150,793.16
股票投资	2,147,949.57
债券投资	2,843.59
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	2,150,793.16

#### 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	10,901.44
基金转换费收入	1,060.46
合计	11,961.90

#### 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	8,926.92
信息披露费	32,500.00
证券出借违约金	—

银行费用	290.00
合计	41,716.92

#### 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
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、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	55,550,381.76	12.75	78,176,999.62	13.92
申万宏源	41,080,537.94	9.43	74,541,743.43	13.27

###### 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（%）
海通证券	199,603.00	21.65	—	—

### 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	40,068.59	12.75	21,209.61	22.98
申万宏源	29,631.27	9.43	20,191.43	21.87
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	68,462.85	13.31	68,450.49	24.12
海通证券	71,872.40	13.98	71,795.79	25.30

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	189,947.95	445,799.00
其中：支付销售机构的客户维护费	46,111.43	55,165.18

注：本基金的管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.90 \% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，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	52,763.33	123,833.00

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

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		
	富国新兴成长量化精选混合（LOF）A	富国新兴成长量化精选混合（LOF）C	合计
富国基金管理有限公司	—	939.17	939.17
合计	—	939.17	939.17

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		
	富国新兴成长量化精选混合（LOF）A	富国新兴成长量化精选混合（LOF）C	合计
富国基金管理有限公司	—	295.43	295.43
合计	—	295.43	295.43

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费将专门

用于本基金 C 类基金份额的销售与基金份额持有人服务。

在通常情况下，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.20% 年费率计提。销售服务费计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，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)	
	富国新兴成长量	富国新兴成长量化	富国新兴成长量	富国新兴成长

	化精选混合 (LOF) A	精选混合 (LOF) C	化精选混合 (LOF) A	量化精选混合 (LOF) C
基金合同生效日 (2017 年 07 月 21 日) 持有的基金份额	—	—	—	—
期初持有的基金份额	—	644.45	—	644.45
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	—	644.45	—	644.45
期末持有的基金份额占基金总份额比例	—	0.09%	—	4.34%

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
中国建设银行股份有限公司	1,052,519.18	4,161.25	3,894,040.22	7,301.51

#### 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**

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### **6.4.12.2 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 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**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的信用债。

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

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

#### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

### **6.4.13.3 流动性风险**

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

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

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

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，

确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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

本基金本报告期末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	1,052,519.18	—	—	—	—	—	1,052,519.18
结算备付金	127,960.71	—	—	—	—	—	127,960.71
存出保证金	15,104.79	—	—	—	—	—	15,104.79
交易性金融资产	610,787.34	—	303,357.78	—	—	26,091,749.12	27,005,894.24
应收申购款	40.00	—	—	—	—	645.47	685.47
资产总计	1,806,412.02	—	303,357.78	—	—	26,092,394.59	28,202,164.39
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	5,638.75	5,638.75
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	20,443.41	20,443.41
应付托管费	—	—	—	—	—	5,678.71	5,678.71
应付销售服务费	—	—	—	—	—	128.80	128.80
其他负债	—	—	—	—	—	166,734.78	166,734.78
负债总计	—	—	—	—	—	198,624.45	198,624.45
利率敏感度缺口	1,806,412.02	—	303,357.78	—	—	25,893,770.14	28,003,539.94
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	108,793.30	—	—	—	—	—	108,793.30
结算备付金	300,907.66	—	—	—	—	—	300,907.66
存出保证金	20,570.67	—	—	—	—	—	20,570.67



交易性金融资产	3,060,628.77	—	—	—	—	53,118,676.41	56,179,305.18
应收清算款	—	—	—	—	—	78,442.57	78,442.57
应收申购款	2,580.00	—	—	—	—	973.88	3,553.88
资产总计	3,493,480.40	—	—	—	—	53,198,092.86	56,691,573.26
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	680.46	680.46
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	47,794.76	47,794.76
应付托管费	—	—	—	—	—	13,276.32	13,276.32
应付销售服务费	—	—	—	—	—	879.78	879.78
应交税费	—	—	—	—	—	0.01	0.01
其他负债	—	—	—	—	—	296,207.52	296,207.52
负债总计	—	—	—	—	—	358,838.85	358,838.85
利率敏感度缺口	3,493,480.40	—	—	—	—	52,839,254.01	56,332,734.41

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

下表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

假设	1. 影响生息资产公允价值的其他变量不变，仅利率发生变动；2. 利率变动范围合理。		
	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）
分析	1. 基准点利率增加 0.1%	-125.14	-108.96
	2. 基准点利率减少 0.1%	125.14	108.96

#### 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，包括国内依法发行上市的股票（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、国家债券、央行票据、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据、中小企业私募债券、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、衍生工具（股指期货、权证等）以及

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：本基金股票及存托凭证资产的投资比例占基金资产的 60-95%；其中投资于新兴成长相关股票及存托凭证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，现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例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（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	26,091,749.12	93.17	53,118,676.41	94.29
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	914,145.12	3.26	3,060,628.77	5.43
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	27,005,894.24	96.44	56,179,305.18	99.73

#### 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%	247,777.97	525,146.41

	2. 业绩比较基准减少 1%	-247,777.97	-525,146.41
--	----------------	-------------	-------------

#### 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 (2023年06月30日)	上年度末 (2022年12月31日)
第一层次	26,091,709.12	53,043,596.61
第二层次	914,185.12	3,135,708.57
第三层次	—	—
合计	27,005,894.24	56,179,305.18

###### 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	26,091,749.12	92.52
	其中：股票	26,091,749.12	92.52
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	914,145.12	3.24
	其中：债券	914,145.12	3.24
	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	1,180,479.89	4.19
8	其他各项资产	15,790.26	0.06
9	合计	28,202,164.39	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

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	853,975.00	3.05
C	制造业	18,983,272.50	67.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	259,288.00	0.93
E	建筑业	107,010.00	0.38
F	批发和零售业	301,436.59	1.08
G	交通运输、仓储和邮政业	382,634.00	1.37
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,318,241.93	11.85
J	金融业	790,785.00	2.82
K	房地产业	63,558.00	0.23
L	租赁和商务服务业	247,010.60	0.88
M	科学研究和技术服务业	405,293.00	1.45
N	水利、环境和公共设施管理业	36,800.00	0.13
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—

P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	103,323.50	0.37
R	文化、体育和娱乐业	229,465.00	0.82
S	综合	9,656.00	0.03
	合计	26,091,749.12	93.17

### 7.3 期末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	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	600	1,014,600.00	3.62
2	300750	宁德时代	2,340	535,368.60	1.91
3	600276	恒瑞医药	8,100	387,990.00	1.39
4	601012	隆基绿能	10,800	309,636.00	1.11
5	600406	国电南瑞	13,320	307,692.00	1.10
6	300395	菲利华	6,200	305,040.00	1.09
7	300014	亿纬锂能	5,000	302,500.00	1.08
8	002475	立讯精密	9,100	295,295.00	1.05
9	000725	京东方A	70,600	288,754.00	1.03
10	600570	恒生电子	6,400	283,456.00	1.01
11	600887	伊利股份	9,700	274,704.00	0.98
12	688599	天合光能	5,843	248,970.23	0.89
13	688126	沪硅产业	11,800	246,620.00	0.88
14	000858	五粮液	1,500	245,355.00	0.88
15	603993	洛阳钼业	45,300	241,449.00	0.86
16	601601	中国太保	9,100	236,418.00	0.84
17	300274	阳光电源	2,000	233,260.00	0.83
18	002594	比亚迪	900	232,443.00	0.83
19	002027	分众传媒	32,500	221,325.00	0.79
20	600050	中国联通	45,100	216,480.00	0.77
21	000651	格力电器	5,800	211,758.00	0.76
22	300760	迈瑞医疗	700	209,860.00	0.75
23	601816	京沪高铁	37,000	194,620.00	0.69
24	300352	北信源	38,300	193,032.00	0.69
25	600582	天地科技	33,100	192,973.00	0.69
26	000333	美的集团	3,200	188,544.00	0.67
27	600809	山西汾酒	1,000	185,070.00	0.66
28	603369	今世缘	3,500	184,800.00	0.66
29	688116	天奈科技	4,000	183,000.00	0.65
30	002415	海康威视	5,100	168,861.00	0.60
31	600166	福田汽车	49,200	167,280.00	0.60
32	000338	潍柴动力	13,000	161,980.00	0.58

33	002032	苏泊尔	3,200	160,000.00	0.57
34	688233	神工股份	5,000	157,900.00	0.56
35	688981	中芯国际	3,100	156,612.00	0.56
36	600399	抚顺特钢	15,200	155,040.00	0.55
37	600547	山东黄金	6,600	154,968.00	0.55
38	601328	交通银行	26,600	154,280.00	0.55
39	688707	振华新材	5,000	153,950.00	0.55
40	000100	TCL科技	37,360	147,198.40	0.53
41	000568	泸州老窖	700	146,699.00	0.52
42	002065	东华软件	20,500	144,730.00	0.52
43	300661	圣邦股份	1,740	142,906.20	0.51
44	300003	乐普医疗	6,300	142,443.00	0.51
45	688777	中控技术	2,268	142,385.04	0.51
46	688111	金山办公	300	141,666.00	0.51
47	300763	锦浪科技	1,300	135,330.00	0.48
48	300316	晶盛机电	1,900	134,710.00	0.48
49	300383	光环新网	12,300	132,225.00	0.47
50	603345	安井食品	900	132,120.00	0.47
51	002698	博实股份	7,500	131,175.00	0.47
52	605117	德业股份	860	128,613.00	0.46
53	300142	沃森生物	4,800	126,960.00	0.45
54	002180	纳思达	3,700	126,725.00	0.45
55	600760	中航沈飞	2,800	126,000.00	0.45
56	688690	纳微科技	3,234	125,640.90	0.45
57	000682	东方电子	12,900	125,388.00	0.45
58	002439	启明星辰	4,200	124,992.00	0.45
59	002421	达实智能	35,500	124,960.00	0.45
60	600690	海尔智家	5,300	124,444.00	0.44
61	300957	贝泰妮	1,400	124,432.00	0.44
62	600489	中金黄金	11,800	121,894.00	0.44
63	002049	紫光国微	1,300	121,225.00	0.43
64	600750	江中药业	5,500	120,615.00	0.43
65	688385	复旦微电	2,400	120,240.00	0.43
66	300768	迪普科技	7,200	119,304.00	0.43
67	603986	兆易创新	1,100	116,875.00	0.42
68	002832	比音勒芬	3,300	116,853.00	0.42
69	300855	图南股份	3,280	115,849.60	0.41
70	600850	电科数字	4,900	115,591.00	0.41
71	600536	中国软件	2,390	112,043.20	0.40
72	002459	晶澳科技	2,680	111,756.00	0.40
73	600795	国电电力	28,700	109,921.00	0.39



74	002373	千方科技	8,000	109,120.00	0.39
75	688235	百济神州	1,000	109,110.00	0.39
76	688009	中国通号	18,400	106,720.00	0.38
77	300604	长川科技	2,200	104,478.00	0.37
78	603306	华懋科技	3,600	104,472.00	0.37
79	603185	弘元绿能	1,400	104,370.00	0.37
80	002152	广电运通	8,900	104,308.00	0.37
81	300054	鼎龙股份	4,200	103,866.00	0.37
82	605499	东鹏饮料	600	103,740.00	0.37
83	300015	爱尔眼科	5,570	103,323.50	0.37
84	688598	金博股份	600	102,900.00	0.37
85	688005	容百科技	1,900	102,638.00	0.37
86	688131	皓元医药	1,800	102,564.00	0.37
87	300699	光威复材	3,300	101,805.00	0.36
88	600755	厦门国贸	13,100	101,394.00	0.36
89	688173	希荻微	4,400	100,672.00	0.36
90	002600	领益智造	14,500	100,195.00	0.36
91	000818	航锦科技	3,000	100,110.00	0.36
92	688389	普门科技	4,200	98,658.00	0.35
93	002467	二六三	19,700	97,909.00	0.35
94	688499	利元亨	1,540	97,820.80	0.35
95	000851	高鸿股份	17,800	96,832.00	0.35
96	688608	恒玄科技	800	96,824.00	0.35
97	002430	杭氧股份	2,800	96,208.00	0.34
98	600761	安徽合力	4,800	95,664.00	0.34
99	002371	北方华创	300	95,295.00	0.34
100	300567	精测电子	1,000	95,150.00	0.34
101	002465	海格通信	9,000	93,060.00	0.33
102	603298	杭叉集团	3,900	91,845.00	0.33
103	000625	长安汽车	7,100	91,803.00	0.33
104	002185	华天科技	9,800	90,160.00	0.32
105	601728	中国电信	16,000	90,080.00	0.32
106	002176	江特电机	7,200	85,824.00	0.31
107	300203	聚光科技	4,200	85,134.00	0.30
108	601985	中国核电	11,900	83,895.00	0.30
109	603466	风语筑	6,000	83,400.00	0.30
110	603799	华友钴业	1,800	82,638.00	0.30
111	601998	中信银行	13,700	81,926.00	0.29
112	688185	康希诺	1,000	81,500.00	0.29
113	301089	拓新药业	1,300	80,522.00	0.29
114	002050	三花智控	2,600	78,676.00	0.28

115	601965	中国汽研	3,800	78,470.00	0.28
116	601899	紫金矿业	6,800	77,316.00	0.28
117	688733	壹石通	2,471	76,502.16	0.27
118	600879	航天电子	9,000	76,410.00	0.27
119	688278	特宝生物	1,739	76,359.49	0.27
120	002241	歌尔股份	4,300	76,325.00	0.27
121	601766	中国中车	11,600	75,400.00	0.27
122	300059	东方财富	5,300	75,260.00	0.27
123	603529	爱玛科技	2,300	74,106.00	0.26
124	688091	上海谊众	1,000	73,630.00	0.26
125	300408	三环集团	2,500	73,375.00	0.26
126	002291	遥望科技	5,600	73,360.00	0.26
127	603005	晶方科技	3,600	72,720.00	0.26
128	688268	华特气体	900	72,657.00	0.26
129	000603	盛达资源	6,000	72,540.00	0.26
130	002179	中航光电	1,590	72,106.50	0.26
131	300379	东方通	3,500	71,995.00	0.26
132	603713	密尔克卫	800	71,272.00	0.25
133	300347	泰格医药	1,100	70,994.00	0.25
134	300832	新产业	1,200	70,800.00	0.25
135	300136	信维通信	3,500	70,280.00	0.25
136	601098	中南传媒	6,000	69,600.00	0.25
137	002651	利君股份	8,900	69,153.00	0.25
138	000063	中兴通讯	1,500	68,310.00	0.24
139	002987	京北方	3,100	67,952.00	0.24
140	688390	固德威	400	66,744.00	0.24
141	001696	宗申动力	9,400	66,552.00	0.24
142	688123	聚辰股份	1,220	65,538.40	0.23
143	002294	信立泰	2,100	65,499.00	0.23
144	000729	燕京啤酒	5,200	64,844.00	0.23
145	002156	通富微电	2,800	63,280.00	0.23
146	600562	国睿科技	3,900	63,180.00	0.23
147	300416	苏试试验	2,900	62,524.00	0.22
148	605369	拱东医疗	1,100	61,644.00	0.22
149	601058	赛轮轮胎	5,400	61,506.00	0.22
150	688100	威胜信息	2,000	59,620.00	0.21
151	002249	大洋电机	10,400	59,280.00	0.21
152	603032	德新科技	1,700	58,718.00	0.21
153	300366	创意信息	4,700	58,092.00	0.21
154	300251	光线传媒	7,100	57,439.00	0.21
155	600436	片仔癀	200	57,272.00	0.20

156	688516	奥特维	303	57,085.20	0.20
157	000157	中联重科	8,400	56,700.00	0.20
158	000975	银泰黄金	4,800	56,160.00	0.20
159	002129	TCL 中环	1,675	55,610.00	0.20
160	688106	金宏气体	2,000	54,400.00	0.19
161	300035	中科电气	4,500	54,090.00	0.19
162	300034	钢研高纳	1,300	51,207.00	0.18
163	002847	盐津铺子	600	51,030.00	0.18
164	601288	农业银行	14,300	50,479.00	0.18
165	605376	博迁新材	1,600	50,208.00	0.18
166	688008	澜起科技	874	50,185.08	0.18
167	000596	古井贡酒	200	49,476.00	0.18
168	600517	国网英大	8,600	49,020.00	0.18
169	300438	鹏辉能源	1,000	48,040.00	0.17
170	688315	诺禾致源	1,800	47,790.00	0.17
171	002317	众生药业	2,800	47,572.00	0.17
172	002410	广联达	1,460	47,435.40	0.17
173	600583	海油工程	8,000	46,800.00	0.17
174	600550	保变电气	9,200	46,368.00	0.17
175	603927	中科软	1,200	46,272.00	0.17
176	688559	海目星	977	45,928.77	0.16
177	002946	新乳业	3,200	45,920.00	0.16
178	688200	华峰测控	300	45,900.00	0.16
179	600803	新奥股份	2,400	45,552.00	0.16
180	600487	亨通光电	3,100	45,446.00	0.16
181	600185	格力地产	6,600	45,276.00	0.16
182	300724	捷佳伟创	400	44,940.00	0.16
183	688696	极米科技	321	44,744.19	0.16
184	300183	东软载波	2,700	44,577.00	0.16
185	300896	爱美客	100	44,495.00	0.16
186	688107	安路科技	800	44,312.00	0.16
187	688276	百克生物	700	43,820.00	0.16
188	002568	百润股份	1,200	43,620.00	0.16
189	000921	海信家电	1,600	43,120.00	0.15
190	300451	创业慧康	5,100	42,738.00	0.15
191	600089	特变电工	1,900	42,351.00	0.15
192	002941	新疆交建	2,700	41,796.00	0.15
193	002643	万润股份	2,400	41,784.00	0.15
194	688778	厦钨新能	840	41,580.00	0.15
195	600600	青岛啤酒	400	41,452.00	0.15
196	688798	艾为电子	700	41,405.00	0.15

197	603636	南威软件	2,800	41,076.00	0.15
198	601615	明阳智能	2,400	40,512.00	0.14
199	002653	海思科	1,700	40,120.00	0.14
200	601882	海天精工	1,200	39,960.00	0.14
201	688166	博瑞医药	1,800	39,582.00	0.14
202	300803	指南针	800	38,872.00	0.14
203	603100	川仪股份	1,000	38,860.00	0.14
204	002812	恩捷股份	400	38,540.00	0.14
205	603595	东尼电子	900	38,538.00	0.14
206	300124	汇川技术	600	38,526.00	0.14
207	300910	瑞丰新材	760	38,228.00	0.14
208	600478	科力远	5,300	37,842.00	0.14
209	000800	一汽解放	4,500	37,665.00	0.13
210	603379	三美股份	1,600	37,616.00	0.13
211	002028	思源电气	800	37,376.00	0.13
212	000066	中国长城	2,700	37,341.00	0.13
213	002549	凯美特气	3,200	36,800.00	0.13
214	300146	汤臣倍健	1,500	35,970.00	0.13
215	600350	山东高速	5,600	35,672.00	0.13
216	002422	科伦药业	1,200	35,616.00	0.13
217	601028	玉龙股份	3,300	35,475.00	0.13
218	688776	国光电气	420	34,809.60	0.12
219	002429	兆驰股份	6,300	34,650.00	0.12
220	002268	电科网安	1,200	33,444.00	0.12
221	601126	四方股份	2,200	33,418.00	0.12
222	688676	金盘科技	1,100	33,319.00	0.12
223	301015	百洋医药	1,200	33,312.00	0.12
224	688082	盛美上海	300	33,120.00	0.12
225	300769	德方纳米	300	33,069.00	0.12
226	300285	国瓷材料	1,200	32,880.00	0.12
227	600776	东方通信	2,300	32,775.00	0.12
228	000400	许继电气	1,400	32,270.00	0.12
229	300628	亿联网络	900	31,563.00	0.11
230	688012	中微公司	200	31,290.00	0.11
231	600988	赤峰黄金	2,300	30,958.00	0.11
232	600248	陕建股份	6,400	30,528.00	0.11
233	002271	东方雨虹	1,100	29,986.00	0.11
234	688819	天能股份	800	29,472.00	0.11
235	688036	传音控股	200	29,400.00	0.10
236	601222	林洋能源	3,500	28,665.00	0.10
237	000425	徐工机械	4,200	28,434.00	0.10

238	600420	国药现代	2,500	28,225.00	0.10
239	603171	税友股份	700	27,986.00	0.10
240	601628	中国人寿	800	27,968.00	0.10
241	688266	泽璟制药	600	27,930.00	0.10
242	601318	中国平安	600	27,840.00	0.10
243	300887	谱尼测试	700	27,706.00	0.10
244	601600	中国铝业	5,000	27,450.00	0.10
245	603997	继峰股份	1,900	27,170.00	0.10
246	688639	华恒生物	300	27,144.00	0.10
247	601865	福莱特	700	26,957.00	0.10
248	688578	艾力斯	1,000	26,950.00	0.10
249	002581	未名医药	1,400	26,726.00	0.10
250	688586	江航装备	1,900	26,429.00	0.09
251	603179	新泉股份	600	26,334.00	0.09
252	600662	外服控股	4,600	26,312.00	0.09
253	002245	蔚蓝锂芯	2,400	26,280.00	0.09
254	300065	海兰信	2,100	26,019.00	0.09
255	300767	震安科技	1,000	25,360.00	0.09
256	603868	飞科电器	400	25,236.00	0.09
257	601988	中国银行	6,400	25,024.00	0.09
258	605168	三人行	290	24,922.60	0.09
259	603979	金诚信	800	24,880.00	0.09
260	600498	烽火通信	1,200	24,444.00	0.09
261	002460	赣锋锂业	400	24,384.00	0.09
262	601975	招商南油	8,500	24,310.00	0.09
263	003006	百亚股份	1,400	24,192.00	0.09
264	000860	顺鑫农业	700	23,583.00	0.08
265	300579	数字认证	800	23,120.00	0.08
266	601668	中国建筑	3,900	22,386.00	0.08
267	688234	天岳先进	300	22,182.00	0.08
268	002498	汉缆股份	5,500	22,055.00	0.08
269	688066	航天宏图	360	21,924.00	0.08
270	603893	瑞芯微	300	21,855.00	0.08
271	002223	鱼跃医疗	600	21,594.00	0.08
272	688356	键凯科技	200	21,310.00	0.08
273	002020	京新药业	1,600	20,512.00	0.07
274	600863	内蒙华电	4,800	19,920.00	0.07
275	600095	湘财股份	2,500	19,500.00	0.07
276	300738	奥飞数据	1,900	19,380.00	0.07
277	600941	中国移动	200	18,660.00	0.07
278	600048	保利发展	1,400	18,242.00	0.07

279	301029	怡合达	400	17,872.00	0.06
280	300101	振芯科技	900	17,451.00	0.06
281	000028	国药一致	400	17,444.00	0.06
282	603612	索通发展	1,000	17,330.00	0.06
283	688099	晶晨股份	200	16,864.00	0.06
284	603456	九洲药业	600	16,428.00	0.06
285	002155	湖南黄金	1,300	15,860.00	0.06
286	603938	三孚股份	800	15,832.00	0.06
287	688508	芯朋微	271	15,715.29	0.06
288	601006	大秦铁路	2,100	15,603.00	0.06
289	688105	诺唯赞	500	15,245.00	0.05
290	600363	联创光电	400	14,840.00	0.05
291	603939	益丰药房	400	14,800.00	0.05
292	300308	中际旭创	100	14,745.00	0.05
293	002446	盛路通信	1,500	14,175.00	0.05
294	603043	广州酒家	500	14,130.00	0.05
295	600400	红豆股份	4,300	14,104.00	0.05
296	688206	概伦电子	500	14,020.00	0.05
297	002747	埃斯顿	500	14,000.00	0.05
298	603530	神马电力	900	13,995.00	0.05
299	601208	东材科技	1,100	13,970.00	0.05
300	300687	赛意信息	500	13,890.00	0.05
301	300470	中密控股	300	13,866.00	0.05
302	603363	傲农生物	1,500	13,755.00	0.05
303	600557	康缘药业	500	13,730.00	0.05
304	688779	长远锂科	1,200	13,524.00	0.05
305	002215	诺普信	1,800	13,518.00	0.05
306	002645	华宏科技	1,100	13,486.00	0.05
307	002675	东诚药业	900	13,239.00	0.05
308	603801	志邦家居	400	13,208.00	0.05
309	002085	万丰奥威	1,900	13,167.00	0.05
310	688029	南微医学	160	13,049.60	0.05
311	688161	威高骨科	300	12,993.00	0.05
312	002636	金安国纪	1,400	12,922.00	0.05
313	605020	永和股份	500	12,905.00	0.05
314	688711	宏微科技	220	12,834.80	0.05
315	688660	电气风电	2,300	12,811.00	0.05
316	603871	嘉友国际	800	12,568.00	0.04
317	300942	易瑞生物	1,000	12,490.00	0.04
318	603098	森特股份	600	12,300.00	0.04
319	000895	双汇发展	500	12,245.00	0.04

320	688303	大全能源	300	12,135.00	0.04
321	601019	山东出版	1,300	11,921.00	0.04
322	603919	金徽酒	500	11,740.00	0.04
323	300723	一品红	400	11,720.00	0.04
324	300017	网宿科技	1,600	11,376.00	0.04
325	688520	神州细胞	200	11,348.00	0.04
326	601958	金钼股份	1,000	11,150.00	0.04
327	688425	铁建重工	2,300	11,063.00	0.04
328	600872	中炬高新	300	11,037.00	0.04
329	688002	睿创微纳	239	10,707.20	0.04
330	000423	东阿阿胶	200	10,690.00	0.04
331	000009	中国宝安	800	9,656.00	0.03
332	002724	海洋王	1,100	9,548.00	0.03
333	300122	智飞生物	200	8,840.00	0.03
334	600309	万华化学	100	8,784.00	0.03
335	688617	惠泰医疗	22	8,222.50	0.03
336	002466	天齐锂业	100	6,991.00	0.02
337	688556	高测股份	127	6,748.78	0.02
338	002372	伟星新材	300	6,162.00	0.02
339	300633	开立医疗	100	5,450.00	0.02
340	000156	华数传媒	600	5,220.00	0.02
341	300037	新宙邦	100	5,189.00	0.02
342	603658	安图生物	100	5,173.00	0.02
343	600559	老白干酒	200	4,902.00	0.02
344	000559	万向钱潮	800	4,360.00	0.02
345	002851	麦格米特	100	3,647.00	0.01
346	688063	派能科技	18	3,568.50	0.01
347	601319	中国人保	600	3,504.00	0.01
348	300357	我武生物	100	3,363.00	0.01
349	600150	中国船舶	100	3,291.00	0.01
350	603279	景津装备	100	3,136.00	0.01
351	300482	万孚生物	100	2,663.00	0.01
352	605338	巴比食品	100	2,525.00	0.01
353	300696	爱乐达	100	2,460.00	0.01
354	002138	顺络电子	100	2,391.00	0.01
355	002979	雷赛智能	100	2,376.00	0.01
356	300433	蓝思科技	200	2,352.00	0.01
357	002930	宏川智慧	100	2,277.00	0.01
358	300755	华致酒行	97	2,179.59	0.01
359	688772	珠海冠宇	100	2,015.00	0.01
360	603337	杰克股份	100	1,904.00	0.01

361	301002	崧盛股份	73	1,506.72	0.01
362	600535	天士力	100	1,451.00	0.01
363	002048	宁波华翔	100	1,340.00	0.00
364	002739	万达电影	100	1,254.00	0.00
365	688148	芳源股份	100	1,220.00	0.00
366	603010	万盛股份	100	1,087.00	0.00
367	605006	山东玻纤	120	900.00	0.00
368	002614	奥佳华	100	814.00	0.00
369	000528	柳工	100	790.00	0.00
370	002345	潮宏基	100	786.00	0.00
371	603300	华铁应急	140	763.00	0.00
372	600073	上海梅林	100	730.00	0.00
373	000686	东北证券	100	694.00	0.00
374	300182	捷成股份	100	631.00	0.00
375	000488	晨鸣纸业	100	485.00	0.00
376	601678	滨化股份	100	464.00	0.00
377	688396	华润微	8	419.28	0.00
378	600466	蓝光发展	100	40.00	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	000913	钱江摩托	1,986,166.00	3.53
2	603529	爱玛科技	1,981,111.00	3.52
3	600039	四川路桥	1,966,512.00	3.49
4	600519	贵州茅台	1,959,404.00	3.48
5	688390	固德威	1,800,296.11	3.20
6	688063	派能科技	1,709,938.42	3.04
7	300496	中科创达	1,519,820.00	2.70
8	600559	老白干酒	1,518,304.00	2.70
9	688700	东威科技	1,414,496.65	2.51
10	002475	立讯精密	1,351,393.00	2.40
11	300438	鹏辉能源	1,338,583.00	2.38
12	300759	康龙化成	1,289,921.00	2.29
13	300910	瑞丰新材	1,236,601.00	2.20
14	002049	紫光国微	1,224,749.00	2.17
15	300014	亿纬锂能	1,211,176.00	2.15
16	000690	宝新能源	1,203,992.00	2.14
17	688126	沪硅产业	1,185,883.10	2.11
18	002459	晶澳科技	1,185,527.00	2.10



19	300896	爱美客	1,169,970.00	2.08
20	600547	山东黄金	1,157,342.00	2.05
21	601012	隆基绿能	1,156,483.00	2.05
22	600406	国电南瑞	1,153,248.00	2.05
23	002410	广联达	1,152,148.00	2.05
24	002738	中矿资源	1,143,126.00	2.03
25	688559	海目星	1,126,795.78	2.00

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	603529	爱玛科技	3,036,957.75	5.39
2	600039	四川路桥	2,756,663.00	4.89
3	300274	阳光电源	2,652,466.00	4.71
4	000913	钱江摩托	2,081,236.08	3.69
5	688063	派能科技	2,076,599.73	3.69
6	688390	固德威	2,019,521.40	3.58
7	300750	宁德时代	1,924,173.00	3.42
8	688559	海目星	1,918,832.33	3.41
9	300763	锦浪科技	1,753,924.57	3.11
10	300776	帝尔激光	1,724,940.00	3.06
11	600559	老白干酒	1,673,903.00	2.97
12	603613	国联股份	1,641,340.22	2.91
13	002459	晶澳科技	1,636,815.00	2.91
14	688556	高测股份	1,620,541.06	2.88
15	603605	珀莱雅	1,594,660.00	2.83
16	603185	弘元绿能	1,566,216.00	2.78
17	002738	中矿资源	1,560,803.40	2.77
18	300910	瑞丰新材	1,557,129.00	2.76
19	300496	中科创达	1,448,848.00	2.57
20	600160	巨化股份	1,414,376.00	2.51
21	600519	贵州茅台	1,380,038.00	2.45
22	688037	芯源微	1,378,181.41	2.45
23	002812	恩捷股份	1,375,049.00	2.44
24	603127	昭衍新药	1,368,438.00	2.43
25	605117	德业股份	1,367,168.00	2.43
26	603290	斯达半导	1,343,084.00	2.38
27	300596	利安隆	1,302,548.00	2.31
28	688617	惠泰医疗	1,295,217.50	2.30

29	002756	永兴材料	1,258,490.00	2.23
30	300373	扬杰科技	1,238,366.00	2.20
31	300759	康龙化成	1,221,706.00	2.17
32	688700	东威科技	1,189,632.36	2.11
33	300059	东方财富	1,187,238.16	2.11
34	688639	华恒生物	1,181,253.33	2.10
35	688800	瑞可达	1,178,852.80	2.09
36	002410	广联达	1,167,209.00	2.07
37	300725	药石科技	1,166,977.00	2.07
38	600563	法拉电子	1,159,594.00	2.06
39	002371	北方华创	1,156,701.33	2.05
40	300438	鹏辉能源	1,138,835.00	2.02
41	002484	江海股份	1,137,409.00	2.02
42	000690	宝新能源	1,137,112.00	2.02

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	204,625,514.09
卖出股票收入（成交）总额	231,360,391.56

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	914,145.12	3.26
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）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	914,145.12	3.26

#### 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	019679	22 国债 14	6,000	610,787.34	2.18
2	019688	22 国债 23	3,000	303,357.78	1.08

### 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

本基金可基于谨慎原则运用股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的衍生品合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

### 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

本基金根据合同约定，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	15,104.79
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	685.47
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	15,790.26

### 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

注：本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

### 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(%)
富国新兴成长量化精选混合(LOF) A	1,622	13,574.04	1,358,479.10	6.17	20,658,607.99	93.83
富国新兴成长量化精选混合(LOF) C	17	41,740.63	644.45	0.09	708,946.31	99.91
合计	1,639	13,866.19	1,359,123.55	5.98	21,367,554.30	94.02

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

富国新兴成长量化精选混合(LOF) A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	吴璇绚	126,611.00	17.26
2	杨凯	124,046.00	16.91
3	钱中明	46,825.00	6.38
4	赵天诒	45,300.00	6.17
5	苗增蔚	25,804.00	3.52
6	程晓松	23,000.00	3.14
7	李长海	21,300.00	2.90
8	程开银	20,000.00	2.73
9	赵成弼	13,000.00	1.77
10	金晓明	12,500.00	1.70

### 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	富国新兴成长量化精选混合(LOF) A	184,822.76	0.8395
	富国新兴成长量化精选混合(LOF) C	—	—

	合计	184,822.76	0.8132
--	----	------------	--------

#### 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	富国新兴成长量化 精选混合 (LOF) A	0~10
	富国新兴成长量化 精选混合 (LOF) C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基 金	富国新兴成长量化 精选混合 (LOF) A	0~10
	富国新兴成长量化 精选混合 (LOF) C	0
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	富国新兴成长量化精 选混合（LOF）A	富国新兴成长量化精 选混合（LOF）C
基金合同生效日(2017年07月21日) 基金份额总额	632,370,666.56	—
报告期期初基金份额总额	37,318,938.47	6,454,874.73
本报告期基金总申购份额	1,575,511.91	909,099.71
减：本报告期基金总赎回份额	16,877,363.29	6,654,383.68
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	22,017,087.09	709,590.76

## § 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	—	—	—	—	—
渤海证券	2	—	—	—	—	—
长城证券	1	101,908.00	0.02	73.52	0.02	—
长江证券	3	29,235,086.08	6.71	21,086.11	6.71	—



德邦证券	2	—	—	—	—	—
东北证券	2	194,609.90	0.04	140.37	0.04	—
东财证券	2	26,173,167.05	6.01	18,878.21	6.01	—
方正证券	2	38,041,269.84	8.73	27,439.40	8.73	—
高盛中国	1	—	—	—	—	—
光大证券	2	27,493,529.23	6.31	19,830.50	6.31	—
广发证券	2	12,282,672.00	2.82	8,859.65	2.82	—
国海证券	2	14,436,725.79	3.31	10,413.10	3.31	—
国盛证券	2	13,859,377.01	3.18	9,996.28	3.18	—
国泰君安	2	15,090,181.71	3.46	10,883.95	3.46	—
国信证券	2	—	—	—	—	—
海通证券	2	55,550,381.76	12.75	40,068.59	12.75	—
华泰证券	1	13,467.00	0.00	9.71	0.00	—
平安证券	2	—	—	—	—	—
瑞银证券	2	—	—	—	—	—
上海证券	1	—	—	—	—	—
申万宏源	2	41,080,537.94	9.43	29,631.27	9.43	—
太平洋证券	2	4,174,767.20	0.96	3,011.03	0.96	—
天风证券	2	—	—	—	—	—
西南证券	2	—	—	—	—	—
湘财证券	1	—	—	—	—	—
信达证券	2	—	—	—	—	—
兴业证券	1	33,437,422.95	7.67	24,118.66	7.67	—
招商证券	1	19,945,051.50	4.58	14,386.56	4.58	—
中航证券	2	45,735,282.56	10.50	32,989.55	10.50	—
中金公司	2	—	—	—	—	—
中泰证券	2	29,542,196.12	6.78	21,307.76	6.78	—
中信建投	1	7,721,231.08	1.77	5,569.29	1.77	—
中信证券	2	21,658,160.78	4.97	15,621.84	4.97	—
中银证券	1	—	—	—	—	—

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	—	—	—	—	—	—
渤海证券	—	—	—	—	—	—
长城证券	—	—	—	—	—	—
长江证券	—	—	—	—	—	—
德邦证券	—	—	—	—	—	—
东北证券	—	—	—	—	—	—
东财证券	—	—	—	—	—	—
方正证券	—	—	—	—	—	—
高盛中国	—	—	—	—	—	—
光大证券	—	—	—	—	—	—
广发证券	—	—	—	—	—	—
国海证券	—	—	—	—	—	—
国盛证券	—	—	—	—	—	—
国泰君安	—	—	—	—	—	—
国信证券	—	—	—	—	—	—
海通证券	199,603.00	21.65	—	—	—	—
华泰证券	—	—	—	—	—	—
平安证券	—	—	—	—	—	—
瑞银证券	—	—	—	—	—	—
上海证券	—	—	—	—	—	—
申万宏源	—	—	—	—	—	—
太平洋证券	—	—	—	—	—	—
天风证券	—	—	—	—	—	—
西南证券	—	—	—	—	—	—
湘财证券	—	—	—	—	—	—
信达证券	—	—	—	—	—	—
兴业证券	299,940.00	32.53	—	—	—	—
招商证券	—	—	—	—	—	—
中航证券	299,877.00	32.53	—	—	—	—
中金公司	—	—	—	—	—	—
中泰证券	122,486.00	13.29	—	—	—	—

---

中信建投	—	—	—	—	—	—
中信证券	—	—	—	—	—	—
中银证券	—	—	—	—	—	—

## **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

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	2023-01-01 至 2023-04-20	12,273,843.13	—	12,273,843.13	—	—
	2	2023-01-01 至 2023-01-11	9,654,698.93	762,078.95	9,138,403.56	1,278,374.32	5.62%
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新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）的文件 2、富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）基金合同 3、富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（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、富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（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： <a href="http://www.fullgoal.com.cn">http://www.fullgoal.com.cn</a> 。