

富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）

二〇二四年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人： 富国基金管理有限公司

基金托管人： 中国农业银行股份有限公司

送出日期： 2024 年 08 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§2	基金简介	6
2.1	基金基本情况	6
2.2	基金产品说明	6
2.3	基金管理人和基金托管人	6
2.4	信息披露方式	7
2.5	其他相关资料	7
§3	主要财务指标和基金净值表现	8
3.1	主要会计数据和财务指标	8
3.2	基金净值表现	9
§4	管理人报告	12
4.1	基金管理人及基金经理情况	12
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	16
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	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	18
§5	托管人报告	19
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	19
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	19
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	19
§6	中期财务报告（未经审计）	20
6.1	资产负债表	20
6.2	利润表	21
6.3	净资产变动表	22
6.4	报表附注	23
§7	投资组合报告	51
7.1	期末基金资产组合情况	51

7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	51
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.....	52
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	76
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	78
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.....	78
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.....	78
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.....	78
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.....	78
7.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	78
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	78
7.12	投资组合报告附注.....	79
§8	基金份额持有人信息.....	80
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	80
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	80
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	80
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.....	81
§9	开放式基金份额变动.....	82
§10	重大事件揭示.....	83
10.1	基金份额持有人大会决议.....	83
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.....	83
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	83
10.4	基金投资策略的改变.....	83
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	83
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.....	83
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	84
10.8	其他重大事件.....	86
§11	影响投资者决策的其他重要信息.....	87
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.....	87
§12	备查文件目录.....	88



## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富国中证 1000 指数增强型证券投资基金 (LOF)	
基金简称	富国中证 1000 指数增强 (LOF)	
场内简称	1000 增强 LOF	
基金主代码	161039	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 05 月 31 日	
基金管理人	富国基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,439,045,930.24 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	2018 年 6 月 20 日	
下属分级基金的基金简称	富国中证 1000 指数增强 (LOF) A	富国中证 1000 指数增强 (LOF) C
下属分级基金场内简称	1000 增强 LOF	—
下属分级基金的交易代码	161039	013331
报告期末下属分级基金的份额总额	857,514,088.36 份	581,531,841.88 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 1000 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金以“指数化投资为主、主动性投资为辅”，主要策略为复制目标指数，即投资组合将以成份股在目标指数中的基准权重为基础，利用富国定量投资模型在有限范围内进行超配或低配选择。本基金在复制目标指数的基础上一定程度地调整个股，力求投资收益能够跟踪并适度超越目标指数。本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8%。本基金的股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生工具投资策略及参与转融通证券出借业务策略详见法律文件。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率 × 95% + 银行人民币活期存款利率 (税后) × 5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

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

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	A类：中国证券登记结算有限责任公司；C类：富国基金管理有限公司	北京市西城区太平桥大街17号

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

##### (1) 富国中证 1000 指数增强 (LOF) A

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024年01月01日至2024年06月30日)
本期已实现收益	-193,219,559.94
本期利润	-195,213,750.67
加权平均基金份额本期利润	-0.2190
本期加权平均净值利润率	-12.80%
本期基金份额净值增长率	-10.23%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年06月30日)
期末可供分配利润	367,946,500.11
期末可供分配基金份额利润	0.4291
期末基金资产净值	1,403,416,313.78
期末基金份额净值	1.6366
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年06月30日)
基金份额累计净值增长率	63.66%

##### (2) 富国中证 1000 指数增强 (LOF) C

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024年01月01日至2024年06月30日)
本期已实现收益	-142,813,482.40
本期利润	-183,194,726.68
加权平均基金份额本期利润	-0.2776
本期加权平均净值利润率	-16.29%
本期基金份额净值增长率	-10.32%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年06月30日)
期末可供分配利润	244,053,615.91
期末可供分配基金份额利润	0.4197
期末基金资产净值	946,293,762.60
期末基金份额净值	1.6272
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年06月30日)
基金份额累计净值增长率	-21.05%

注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式



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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### (1) 富国中证 1000 指数增强 (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	-6.56%	1.35%	-8.15%	1.36%	1.59%	-0.01%
过去三个月	-6.03%	1.42%	-9.51%	1.42%	3.48%	0.00%
过去六个月	-10.23%	1.83%	-15.97%	1.87%	5.74%	-0.04%
过去一年	-16.71%	1.44%	-24.61%	1.47%	7.90%	-0.03%
过去三年	-15.69%	1.31%	-29.31%	1.36%	13.62%	-0.05%
自基金合同生效起至今	63.66%	1.34%	-19.75%	1.44%	83.41%	-0.10%

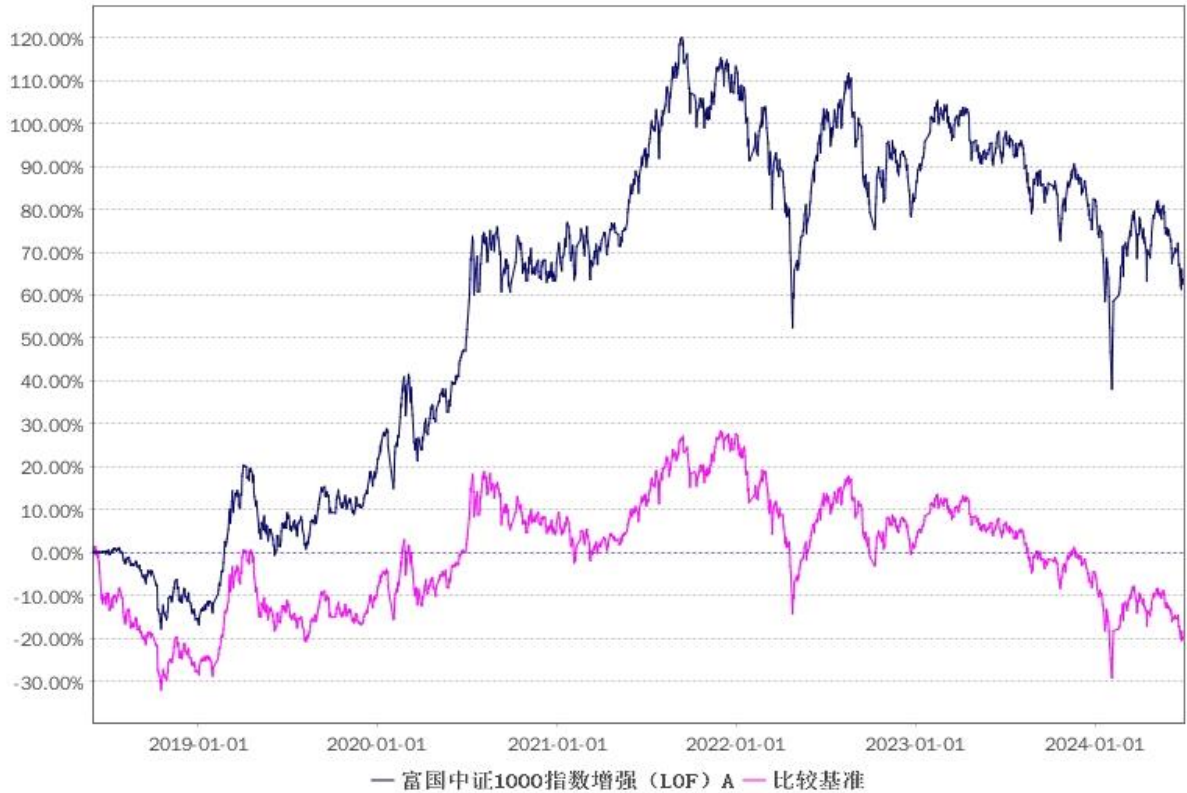
##### (2) 富国中证 1000 指数增强 (LOF) C

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	-6.57%	1.35%	-8.15%	1.36%	1.58%	-0.01%
过去三个月	-6.08%	1.42%	-9.51%	1.42%	3.43%	0.00%
过去六个月	-10.32%	1.83%	-15.97%	1.87%	5.65%	-0.04%
过去一年	-16.88%	1.44%	-24.61%	1.47%	7.73%	-0.03%
自基金分级生效日起至今	-21.05%	1.32%	-32.79%	1.36%	11.74%	-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

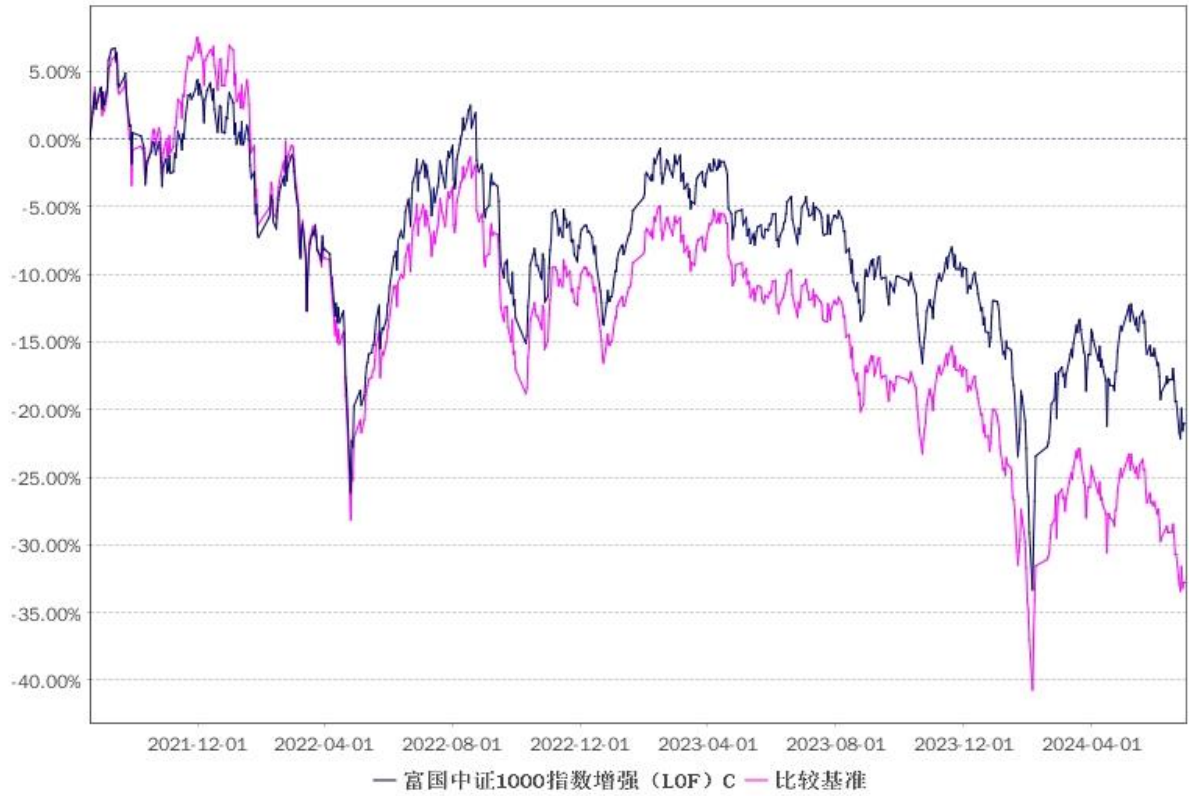
(1) 自基金合同生效以来富国中证 1000 指数增强 (LOF) A 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2024 年 6 月 30 日。

2、本基金于 2018 年 5 月 31 日成立，建仓期 6 个月，从 2018 年 5 月 31 日起至 2018 年 11 月 29 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

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



注：1、截止日期为 2024 年 6 月 30 日。

2、本基金自 2021 年 8 月 19 日起增加 C 类份额，相关数据按实际存续期计算。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国新兴产业股票型证券投资基金、富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、富国天利增长债券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国中债-1-3 年国开行债券指数证券投资基金、富国全球科技互联网股票型证券投资基金（QDII）、富国鑫旺稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、富国富钱包货币市场基金、富国首创水务封闭式基础设施证券投资基金等 350 只公开募集证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王保合	本基金现任基金经理	2022-10-27	—	18	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 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；自 2023 年 09 月起任富国致弘量化选股股票型证券投资基金基金经理；自 2023 年 12 月起任富国致航量化选股股票型证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。</p>
徐幼华	本基金现任基金经理	2018-05-31	—	19	<p>硕士，曾任上海京华创业投资有限公司投资部经理助理；自 2006 年 7 月加入富国基金管理有限公司，历任助理数量研究员、研究员、基金经理助理、基金经理、量化与海外投资部量化投资副总监，量化与</p>

					海外投资部量化投资总监；现任富国基金量化投资部副总经理，兼任富国基金资深定量基金经理。自2011年05月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金基金经理；自2011年10月起任富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理；自2018年05月起任富国港股通量化精选股票型证券投资基金基金经理；自2018年05月起任富国中证1000指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理；自2018年07月起任富国大盘价值量化精选混合型证券投资基金基金经理；自2018年12月起任富国MSCI中国A股国际通指数增强型证券投资基金基金经理；自2024年04月起任富国MSCI中国A50互联互通增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。
方旻	本基金现任基金经理	2018-05-31	—	14	硕士，自2010年2月加入富国基金管理有限公司，历任定量研究员、基金经理助理、基金经理、量化与海外投资部量化投资总监助理、高级定量基金经理、量化投资部量化投资副总监、量化投资部量化投资总监；现任富国基金量化投资部量化投资总监兼资深定量基金经理。自2014年11月起任富国沪深300增强证券投资基金基金经理；自2014年11月起任富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理；自2014年11月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金基金经理；自2014年11月起任上证综指交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自2015年10月起任富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；自2018年05月起任富国中证1000指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理；自2019年01月起任富国MSCI中国A股国际

					通指数增强型证券投资基金基金经理；自 2020 年 02 月起任富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金基金经理；自 2022 年 11 月起任富国中证 1000 优选股票型证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。
--	--	--	--	--	--

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

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险、力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定收益为目标，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制，银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合，对同一投资标的采用

相同投资策略的，必须通过交易系统采取同时、同价下达投资指令，确保公平对待其所管理的组合。事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1日、3日、5日）的季度公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统，对涉及公平性交易的投资行为进行分析评估，分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品，并重点分析同类组合（股票型、混合型、债券型）间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为，若发现异常交易行为，风险管理部视情况要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存，以备后查。本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，未出现违反公平交易制度的情况。

#### **4.3.2 异常交易行为的专项说明**

本报告期内未发现异常交易行为。

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现 13 次同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

### **4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明**

#### **4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析**

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



业绩期进入尾声后，内资风险偏好抬升，合力推动沪指突破 3100 点。6 月进入验证期，国内经济复苏再度放缓，PMI 回落枯荣线以下、信用扩张疲软、经济“供强需弱”特征延续。接连落空的预期验证放大悲观情绪，沪指连续调整至 3000 点以下。

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

在投资管理上，我们坚持采取量化策略进行投资和风险管理，积极获取超额收益率。

#### **4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金份额净值 A 级为 1.6366 元，C 级为 1.6272 元；份额累计净值 A 级为 1.6366 元，C 级为 1.6272 元；本报告期，本基金份额净值增长率 A 级为-10.23%，C 级为-10.32%，同期业绩比较基准收益率 A 级为-15.97%，C 级为-15.97%。

#### **4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望**

展望 2024 下半年，风险偏好有望迎来修复窗口。从国内来看，为完成两会政府工作报告中提出的经济增长目标，下半年相关财政政策及货币政策有望进一步发力。从海外看，随着美国通胀数据和就业数据持续走弱，美联储开启降息的概率进一步提升，新兴市场资金有望迎来回流，有助于风险偏好的提升。

#### **4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明**

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

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

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

进行收益分配。

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

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

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

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

## § 6 中期财务报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>		
货币资金	375,289,990.45	183,593,140.66
结算备付金	17,297,053.33	18,671,402.26
存出保证金	24,922,057.36	202,439.33
交易性金融资产	1,961,598,426.3 6	3,066,626,126.62
其中：股票投资	1,961,598,426.3 6	3,057,404,834.23
基金投资	—	—
债券投资	—	9,221,292.39
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	—	152,859.71
应收股利	—	—
应收申购款	1,286,797.12	50,989,836.44
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	501.29
资产总计	2,380,394,324.6 2	3,320,236,306.31
<b>负债和净资产</b>	<b>本期末</b> 2024 年 06 月 30 日	<b>上年度末</b> 2023 年 12 月 31 日
<b>负 债：</b>		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付清算款	21,902,124.05	—
应付赎回款	2,987,959.66	8,014,881.79
应付管理人报酬	1,997,153.41	2,809,097.88
应付托管费	299,573.02	421,364.71

应付销售服务费	161,654.05	243,499.57
应付投资顾问费	—	—
应交税费	1.01	114.66
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	3,335,783.04	3,226,818.21
负债合计	30,684,248.24	14,715,776.82
<b>净资产：</b>		
实收基金	1,439,045,930.24	1,816,900,462.56
其他综合收益	—	—
未分配利润	910,664,146.14	1,488,620,066.93
净资产合计	2,349,710,076.38	3,305,520,529.49
负债和净资产总计	2,380,394,324.62	3,320,236,306.31

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.6328 元，基金份额总额 1,439,045,930.24 份。其中：富国中证 1000 指数增强（LOF）A 份额净值 1.6366 元，份额总额 857,514,088.36 份；富国中证 1000 指数增强（LOF）C 份额净值 1.6272 元，份额总额 581,531,841.88 份。

## 6.2 利润表

会计主体：富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日)	上年度可比期间 (2023 年 01 月 01 日 至 2023 年 06 月 30 日)
<b>一、营业总收入</b>	-361,884,220.92	215,342,339.59
1.利息收入	1,557,573.06	1,245,483.38
其中：存款利息收入	1,552,414.37	1,098,309.97
债券利息收入	—	—
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	—	—
其他利息收入	5,158.69	147,173.41
2.投资收益（损失以“-”填列）	-321,472,962.86	83,603,589.29
其中：股票投资收益	-345,736,345.13	56,182,066.29
基金投资收益	—	—
债券投资收益	45,741.62	1,635,026.73
资产支持证券投资收益	—	—

贵金属投资收益	—	—
衍生工具收益	2,362,198.84	—
股利收益	21,855,441.81	25,786,496.27
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）	-42,375,435.01	129,720,958.94
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	406,603.89	772,307.98
<b>减：二、营业总支出</b>	<b>16,524,256.43</b>	<b>19,305,082.81</b>
1. 管理人报酬	13,097,123.54	15,743,751.84
2. 托管费	1,964,568.52	2,361,562.80
3. 销售服务费	1,106,308.22	855,252.54
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	55,360.18	534.47
8. 其他费用	300,895.97	343,981.16
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-378,408,477.35</b>	<b>196,037,256.78</b>
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-378,408,477.35</b>	<b>196,037,256.78</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>-378,408,477.35</b>	<b>196,037,256.78</b>

### 6.3 净资产变动表

会计主体：富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 (2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日)		
	实收基金	未分配 利润	净资产 合计
一、上期期末净资产	1,816,900,462.56	1,488,620,066.93	3,305,520,529.49
二、本期期初净资产	1,816,900,462.56	1,488,620,066.93	3,305,520,529.49
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-377,854,532.32	-577,955,920.79	-955,810,453.11
(一)、综合收益总额	—	-378,408,477.35	-378,408,477.35
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-377,854,532.32	-199,547,443.44	-577,401,975.76
其中：1. 基金申购款	717,503,479.74	501,511,784.15	1,219,015,263.89

2. 基金赎回款	-	-701,059,227.59	-
	1,095,358,012.06		1,796,417,239.65
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	1,439,045,930.24	910,664,146.14	2,349,710,076.38
项目	上年度可比期间 (2023年01月01日至2023年06月30日)		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,483,528,856.30	1,223,358,702.70	2,706,887,559.00
二、本期期初净资产	1,483,528,856.30	1,223,358,702.70	2,706,887,559.00
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-28,915,658.61	177,348,635.58	148,432,976.97
(一)、综合收益总额	-	196,037,256.78	196,037,256.78
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-28,915,658.61	-18,688,621.20	-47,604,279.81
其中：1.基金申购款	829,290,420.93	808,079,303.00	1,637,369,723.93
2.基金赎回款	-858,206,079.54	-826,767,924.20	-
			1,684,974,003.74
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	1,454,613,197.69	1,400,707,338.28	2,855,320,535.97

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

陈戈

林志松

徐慧

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

富国中证 1000 指数增强型证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”)，

系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2018]30号文《关于准予富国中证1000指数增强型证券投资基金（LOF）注册的批复》的核准，由富国基金管理有限公司作为管理人向社会公开发行募集。基金合同于2018年5月31日正式生效，首次设立募集规模为512,114,043.76份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。根据基金管理人于2021年8月17日发布的《富国基金管理有限公司关于旗下部分基金增加C类基金份额并相应修订基金合同及托管协议的公告》，自2021年8月19日起，本基金增加C类份额。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，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。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证1000指数的成份股、备选成份股、其他股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、质押及买断式回购、银行存款（包括银行定期存款、银行协议存款、银行通知存款等）、同业存单、衍生工具（股指期货、权证等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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

本基金的业绩比较基准为：中证1000指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（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2024年6月30日的财务状况以及2024年1月1日至2024年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

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

#### **6.4.5 会计差错更正的说明**

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### **6.4.6 税项**

##### **1 印花税**

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；根据财政部、税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股

股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

## 2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

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

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

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

## 3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定

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

#### 4 企业所得税

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

#### 5 个人所得税

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

有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 (2024 年 06 月 30 日)
活期存款	375,289,990.45
等于：本金	375,216,162.34
加：应计利息	73,828.11
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	375,289,990.45

注：本基金本报告期末未持有定期存款。

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 (2024 年 06 月 30 日)			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	2,206,409,926.63	—	1,961,598,426.36	244,811,500.27
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	2,206,409,926.63	—	1,961,598,426.36	— 244,811,500.27
----	------------------	---	------------------	---------------------

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末（2024年06月30日）			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	—	—	—	—
货币衍生工具	—	—	—	—
权益衍生工具	213,600,840.00	—	—	—
股指期货	213,600,840.00	—	—	—
其他衍生工具	—	—	—	—
合计	213,600,840.00	—	—	—

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为0。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IM2409	IM2409	119.00	113,768,760.00	-5,365,040.00
IM2407	IM2407	93.00	90,358,800.00	-4,108,240.00
合计				-9,473,280.00
减：可抵销期货暂收款				-9,473,280.00
净额				—

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易。

#### 6.4.7.5 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.6其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2024年06月30日）
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	2,873.23
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	2,981,006.62
其中：交易所市场	2,981,006.62
银行间市场	—
应付利息	—
预提信息披露费	60,000.00
预提审计费	82,349.14
应付指数使用费	209,554.05
合计	3,335,783.04

#### 6.4.7.7实收基金

富国中证1000指数增强（LOF）A：

金额单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,016,344,929.26	1,016,344,929.26
本期申购	153,045,780.81	153,045,780.81
本期赎回（以“-”号填列）	-311,876,621.71	-311,876,621.71
本期末	857,514,088.36	857,514,088.36

富国中证1000指数增强（LOF）C：

金额单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	800,555,533.30	800,555,533.30
本期申购	564,457,698.93	564,457,698.93
本期赎回（以“-”号填列）	-783,481,390.35	-783,481,390.35
本期末	581,531,841.88	581,531,841.88

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8未分配利润

富国中证1000指数增强（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
上年度末	657,307,562.98	179,276,124.98	836,583,687.96
本期期初	657,307,562.98	179,276,124.98	836,583,687.96
本期利润	—	-1,994,190.73	-195,213,750.67
	193,219,559.94		

本期基金份额交易产生的变动数	-96,141,502.93	673,791.06	-95,467,711.87
其中：基金申购款	76,039,739.27	31,627,407.33	107,667,146.60
基金赎回款	172,181,242.20	-30,953,616.27	-203,134,858.47
本期已分配利润	—	—	—
本期末	367,946,500.11	177,955,725.31	545,902,225.42

富国中证1000指数增强（LOF）C：

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	510,673,263.40	141,363,115.57	652,036,378.97
本期期初	510,673,263.40	141,363,115.57	652,036,378.97
本期利润	142,813,482.40	-40,381,244.28	-183,194,726.68
本期基金份额交易产生的变动数	123,806,165.09	19,726,433.52	-104,079,731.57
其中：基金申购款	290,719,131.81	103,125,505.74	393,844,637.55
基金赎回款	414,525,296.90	-83,399,072.22	-497,924,369.12
本期已分配利润	—	—	—
本期末	244,053,615.91	120,708,304.81	364,761,920.72

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
活期存款利息收入	1,268,066.69
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	231,546.38
其他	52,801.30
合计	1,552,414.37

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
股票投资收益——买卖股票差价收入	-345,736,345.13
股票投资收益——证券出借差价收入	—
合计	-345,736,345.13

#### 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
卖出股票成交总额	4,185,942,728.82
减：卖出股票成本总额	4,523,469,691.09
减：交易费用	8,209,382.86
买卖股票差价收入	-345,736,345.13

#### 6.4.7.10.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益——证券出借差价收入。

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
债券投资收益——利息收入	6,819.55
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	38,922.07
合计	45,741.62

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	9,265,022.64
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	9,049,156.00
减：应计利息总额	176,933.04
减：交易费用	11.53
买卖债券差价收入	38,922.07

#### 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

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
股指期货投资收益	2,362,198.84

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
股票投资产生的股利收益	21,855,441.81
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	21,855,441.81

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
1. 交易性金融资产	-32,902,155.01
股票投资	-32,900,131.01
债券投资	-2,024.00
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	-9,473,280.00
权证投资	—
股指期货	-9,473,280.00
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	-42,375,435.01

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
基金赎回费收入	404,267.50
基金转换费收入	2,336.39
合计	406,603.89

#### 6.4.7.18 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
审计费用	27,349.14
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	3,911.28
指数使用费	209,554.05
其他	81.50
合计	300,895.97

#### 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、注册登记机构、基金销售机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东、基金代销机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
申万宏源西部证券有限公司	基金管理人的股东控制的子公司、基金代销机构
富国鑫旺均衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）	纳入基金管理人合并财务报表合并范围内的证券投资基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）		上年度可比期间（2023年01月01日至2023年06月30日）	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
海通证券	704,513,031.76	9.22	930,693,531.40	8.69
申万宏源	530,611,200.82	6.94	473,199,474.31	4.42

###### 6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）		上年度可比期间（2023年01月01日至2023年06月30日）	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
海通证券	—	—	1,156,528.00	7.02
申万宏源	—	—	480,687.42	2.92

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）
-------	-----------------------------

	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
海通证券	518,456.50	9.22	518,456.50	17.39
申万宏源	390,476.44	6.94	390,476.44	13.10
关联方名称	上年度可比期间 (2023年01月01日至2023年06月30日)			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
海通证券	671,319.04	8.69	454,394.51	12.31
申万宏源	341,615.91	4.42	255,629.38	6.93

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

2、自2024年7月1日起，根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 (2024年01月01日至2024年06月30日)	上年度可比期间 (2023年01月01日至2023年06月30日)
当期发生的基金应支付的管理费	13,097,123.54	15,743,751.84
其中：支付销售机构的客户维护费	2,710,954.46	2,955,368.49
应支付基金管理人的净管理费	10,386,169.08	12,788,383.35

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.0%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.0\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）	上年度可比期间（2023年01月01日至2023年06月30日）
当期发生的基金应支付的托管费	1,964,568.52	2,361,562.80

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

$$H = E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富国中证1000指数增强（LOF）A	富国中证1000指数增强（LOF）C	合计
富国基金管理有限公司	—	711,662.88	711,662.88
海通证券股份有限公司	—	85.90	85.90
申万宏源证券有限公司	—	1,233.32	1,233.32
合计	—	712,982.10	712,982.10

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间（2023年01月01日至2023年06月30日）		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富国中证1000指数增强（LOF）A	富国中证1000指数增强（LOF）C	合计
富国基金管理有限公司	—	505,368.62	505,368.62
海通证券股份有限公司	—	72.49	72.49
申万宏源西部证券有限公司	—	1.32	1.32
申万宏源证券有限公司	—	248.00	248.00
合计	—	505,690.43	505,690.43

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

金额单位：人民币元

上年度可比期间（2023年01月01日至2023年06月30日）						
关联方名称	交易金额	费率区间（%）	加权平均费率（%）	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
海通证券	2,597,467.00	3.20~7.00	4.11	3,487.28	238,109.00	101.32

注：本基金本报告期末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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）		上年度可比期间（2023年01月01日至2023年06月30日）	
	富国中证1000指数增强（LOF）A	富国中证1000指数增强（LOF）C	富国中证1000指数增强（LOF）A	富国中证1000指数增强（LOF）C
基金合同生效日（2018年05月31日）持有的基金份额	—	—	—	—
期初持有的基金份额	14,851,583.18	—	14,851,583.18	485.18
期间申购/买入总份额	—	—	—	—
期间因拆分变动份额	—	—	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	—	—	—
期末持有的基金份额	14,851,583.18	—	14,851,583.18	485.18
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.73%	—	1.41%	0.00%

注：本基金管理人投资本基金按照公告的费率条款执行，不存在费率优惠的情况。

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

富国中证1000指数增强（LOF）C：

份额单位：份

关联方名称	本期末（2024年06月30日）		上年度末（2023年12月31日）	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）
富国鑫汇养老目标日期2045五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）	—	—	2,546,471.24	0.32
富国鑫旺均衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）	5,195,818.25	0.89	6,224,605.66	0.78

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期（2024年01月01日至2024年06月30日）		上年度可比期间（2023年01月01日至2023年06月30日）	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	375,289,990.45	1,268,066.69	206,884,623.35	828,893.15

公司				
----	--	--	--	--

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期（2024年01月01日至2024年06月30日）					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
海通证券股份有限公司	301565	中仑新材	IPO网下申购	7,103	84,383.64
海通证券股份有限公司	603344	星德胜	IPO网下申购	1,813	34,773.34

金额单位：人民币元

上年度可比期间（2023年01月01日至2023年06月30日）					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
海通证券股份有限公司	688515	裕太微	IPO网下申购	4,183	386,760.18
海通证券股份有限公司	688507	索辰科技	IPO网下申购	1,495	367,112.20
海通证券股份有限公司	688531	日联科技	IPO网下申购	3,460	527,234.80
海通证券股份有限公司	688469	中芯集成	IPO网下申购	137,994	785,185.86

#### 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（2024年06月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001359	平安电工	2024-03-19	6个月	新股限售	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	—
001379	腾达科技	2024-01-11	6个月	新股限售	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	—



001387	雪祺电气	2024-01-04	6个月	新股限售	15.38	15.25	133	2,045.54	2,028.25	—
001387	雪祺电气	2024-06-03	2个月	新股限售 转增	—	15.25	40	—	610.00	—
001389	广合科技	2024-03-26	6个月	新股限售	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	—
301502	华阳智能	2024-01-26	6个月	新股限售	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	—
301538	骏鼎达	2024-03-13	6个月	新股限售	55.82	91.24	107	5,972.74	9,762.68	—
301538	骏鼎达	2024-05-22	4个月	新股限售 转增	—	91.24	43	—	3,923.32	—
301539	宏鑫科技	2024-04-03	6个月	新股限售	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	—
301565	中仑新材	2024-06-13	6个月	新股限售	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	—
301566	达利凯普	2023-12-22	6个月	新股限售	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	—
301580	爱迪特	2024-06-19	6个月	新股限售	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	—
301587	中瑞股份	2024-03-27	6个月	新股限售	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	—
301588	美新科技	2024-03-06	6个月	新股限售	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	—
301591	肯特股份	2024-02-20	6个月	新股限售	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	—
601033	永兴股份	2024-01-11	6个月	新股限售	16.20	15.96	1,258	20,379.60	20,077.68	—
603082	北自科技	2024-01-23	6个月	新股限售	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	—
603285	键邦股份	2024-06-28	1个月内 (含)	新股认购	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	—
603285	键邦股份	2024-06-28	6个月	新股限售	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	—
603341	龙旗科技	2024-02-23	6个月	新股限售	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	—
603344	星德胜	2024-03-13	6个月	新股限售	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	—
603375	盛景微	2024-01-17	6个月	新股限售	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	—
603381	永臻股份	2024-06-19	6个月	新股限售	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	—
688584	上海合晶	2024-02-01	6个月	新股限售	22.66	15.89	866	19,623.56	13,760.74	—
688692	达梦数据	2024-06-04	6个月	新股限售	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	—
688695	中创股份	2024-03-06	6个月	新股限售	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	—

#### 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
300630	普利制药	2024年05月06日	重大事项停牌	9.56	2024年07月08日	9.88	65,000.00	939,559.00	621,400.00	—

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### **6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### **6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

#### **6.4.13 金融工具风险及管理**

##### **6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

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

##### **6.4.13.2 信用风险**

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

##### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的信用债。

##### **6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末（2024年06月30日）	上年度末（2023年12月31日）
AAA	—	—
AAA 以下	—	250,316.83
未评级	—	—
合计	—	250,316.83

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无重大流动性风险。

#### **6.4.13.4 市场风险**

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

##### **6.4.13.4.1 利率风险**

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

###### **6.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

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

单位：人民币元

本期末（2024年06月30日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	375,289,990.45	—	—	—	—	—	375,289,990.45
结算备付金	17,297,053.33	—	—	—	—	—	17,297,053.33
存出保证金	426,750.16	—	—	—	—	24,495,307.20	24,922,057.36
交易性金融资产	—	—	—	—	—	1,961,598,426.36	1,961,598,426.36
应收申购款	19,478.38	—	—	—	—	1,267,318.74	1,286,797.12
资产总计	393,033,272.32	—	—	—	—	1,987,361,052.30	2,380,394,324.62
负债							
应付清算款	—	—	—	—	—	21,902,124.05	21,902,124.05
应付赎回款	—	—	—	—	—	2,987,959.66	2,987,959.66
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	1,997,153.41	1,997,153.41
应付托管费	—	—	—	—	—	299,573.02	299,573.02
应付销售服务费	—	—	—	—	—	161,654.05	161,654.05
应交税费	—	—	—	—	—	1.01	1.01
其他负债	—	—	—	—	—	3,335,783.04	3,335,783.04
负债总计	—	—	—	—	—	30,684,248.24	30,684,248.24
利率敏感度缺口	393,033,272.32	—	—	—	—	1,956,676,804.06	2,349,710,076.38
上年度末（2023年12月31日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	183,593,140.66	—	—	—	—	—	183,593,140.66

结算备付金	18,671,402.26	—	—	—	—	—	18,671,402.26
存出保证金	202,439.33	—	—	—	—	—	202,439.33
交易性金融资产	8,970,975.56	—	250,316.83	—	—	3,057,404,834.23	3,066,626,126.62
应收清算款	—	—	—	—	—	152,859.71	152,859.71
其他资产	—	—	—	—	—	501.29	501.29
应收申购款	30,027,348.39	—	—	—	—	20,962,488.05	50,989,836.44
资产总计	241,465,306.20	—	250,316.83	—	—	3,078,520,683.28	3,320,236,306.31
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	8,014,881.79	8,014,881.79
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	2,809,097.88	2,809,097.88
应付托管费	—	—	—	—	—	421,364.71	421,364.71
应付销售服务费	—	—	—	—	—	243,499.57	243,499.57
应交税费	—	—	—	—	—	114.66	114.66
其他负债	—	—	—	—	—	3,226,818.21	3,226,818.21
负债总计	—	—	—	—	—	14,715,776.82	14,715,776.82
利率敏感度缺口	241,465,306.20	—	250,316.83	—	—	3,063,804,906.46	3,305,520,529.49

#### 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。本基金本期末未持有债券资产（不含可转债），因此本期末市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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（2024年06月30日）	上年度末（2023年12月31日）
分析	1. 基准点利率增加 0.1%	—	-368.71
	2. 基准点利率减少 0.1%	—	368.71

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

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

款、银行协议存款、银行通知存款等）、同业存单、衍生工具（股指期货、权证等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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

本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末（2024 年 06 月 30 日）		上年度末（2023 年 12 月 31 日）	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	1,961,598,426.36	83.48	3,057,404,834.23	92.49
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	9,221,292.39	0.28
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	1,961,598,426.36	83.48	3,066,626,126.62	92.77

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。下表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，业绩比较基准所对应的市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关；2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 06 月	上年度末（2023 年 12 月



	30 日)	31 日)
1. 业绩比较基准增加 1%	22,887,096.20	31,937,908.62
2. 业绩比较基准减少 1%	-22,887,096.20	-31,937,908.62

#### 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 (2024 年 06 月 30 日)	上年度末 (2023 年 12 月 31 日)
第一层次	1,960,756,068.27	3,050,919,053.54
第二层次	655,177.27	12,267,112.46
第三层次	187,180.82	3,439,960.62
合计	1,961,598,426.36	3,066,626,126.62

###### 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业务等情况，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	1,961,598,426.36	82.41
	其中：股票	1,961,598,426.36	82.41
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	392,587,043.78	16.49
8	其他各项资产	26,208,854.48	1.10
9	合计	2,380,394,324.62	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	2,142,779.00	0.09
B	采矿业	16,929,283.00	0.72
C	制造业	234,140,872.31	9.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	23,228,516.98	0.99
E	建筑业	3,857,381.96	0.16
F	批发和零售业	2,394,337.52	0.10
G	交通运输、仓储和邮政业	11,683,547.70	0.50
H	住宿和餐饮业	924,560.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	28,839,456.89	1.23
J	金融业	7,794,365.00	0.33
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	3,707,899.04	0.16

N	水利、环境和公共设施管理业	1,397,868.00	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	2,016,579.00	0.09
Q	卫生和社会工作	1,286,475.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	12,220,798.00	0.52
S	综合	—	—
	合计	352,564,719.40	15.00

### 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	2,150,345.33	0.09
B	采矿业	31,682,952.96	1.35
C	制造业	1,133,104,389.40	48.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	25,743,212.44	1.10
E	建筑业	8,452,565.00	0.36
F	批发和零售业	61,237,327.58	2.61
G	交通运输、仓储和邮政业	16,991,397.12	0.72
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	225,053,257.19	9.58
J	金融业	11,744,142.83	0.50
K	房地产业	26,410,430.00	1.12
L	租赁和商务服务业	17,460,987.40	0.74
M	科学研究和技术服务业	8,646,666.91	0.37
N	水利、环境和公共设施管理业	4,139,497.68	0.18
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	6,069,221.00	0.26
R	文化、体育和娱乐业	30,147,314.12	1.28
S	综合	—	—
	合计	1,609,033,706.96	68.48

### 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

#### 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	000902	新洋丰	1,675,000	19,882,250.00	0.85
2	002249	大洋电机	4,149,430	19,626,803.90	0.84
3	002139	拓邦股份	1,731,000	18,383,220.00	0.78

4	300170	汉得信息	2,767,600	16,993,064.00	0.72
5	002498	汉缆股份	5,039,961	16,581,471.69	0.71
6	603328	依顿电子	2,016,000	15,845,760.00	0.67
7	002646	天佑德酒	1,519,290	15,542,336.70	0.66
8	002053	云南能投	1,270,800	15,363,972.00	0.65
9	300134	大富科技	2,155,500	14,700,510.00	0.63
10	000650	仁和药业	2,311,000	13,634,900.00	0.58
11	300303	聚飞光电	2,685,900	13,053,474.00	0.56
12	300166	东方国信	2,092,800	12,807,936.00	0.55
13	601609	金田股份	2,258,400	12,782,544.00	0.54
14	002237	恒邦股份	1,097,700	12,634,527.00	0.54
15	600623	华谊集团	2,174,900	12,570,922.00	0.53
16	002048	宁波华翔	970,300	12,555,682.00	0.53
17	300182	捷成股份	3,305,800	12,264,518.00	0.52
18	002550	千红制药	2,202,800	11,873,092.00	0.51
19	002782	可立克	1,061,100	11,756,988.00	0.50
20	300369	绿盟科技	2,253,920	11,517,531.20	0.49
21	600007	中国国贸	509,450	11,187,522.00	0.48
22	300735	光弘科技	501,600	10,834,560.00	0.46
23	000969	安泰科技	1,365,273	10,826,614.89	0.46
24	002446	盛路通信	1,913,700	10,812,405.00	0.46
25	600480	凌云股份	1,087,200	10,687,176.00	0.45
26	002544	普天科技	571,000	10,671,990.00	0.45
27	300432	富临精工	1,643,900	10,586,716.00	0.45
28	300123	亚光科技	2,224,300	10,320,752.00	0.44
29	000811	冰轮环境	1,048,700	10,119,955.00	0.43
30	603699	纽威股份	587,000	10,049,440.00	0.43
31	603123	翠微股份	1,643,732	9,763,768.08	0.42
32	002291	遥望科技	2,208,900	9,498,270.00	0.40
33	002488	金固股份	2,155,200	9,461,328.00	0.40
34	601369	陕鼓动力	1,178,002	9,447,576.04	0.40
35	002745	木林森	1,142,000	9,204,520.00	0.39
36	002635	安洁科技	594,200	9,174,448.00	0.39
37	002390	信邦制药	2,744,700	9,084,957.00	0.39
38	300379	东方通	1,121,400	9,060,912.00	0.39
39	603299	苏盐井神	946,100	8,987,950.00	0.38
40	600312	平高电气	453,800	8,826,410.00	0.38
41	002123	梦网科技	1,243,300	8,740,399.00	0.37
42	688158	优刻得	851,384	8,709,658.32	0.37
43	600812	华北制药	2,064,300	8,504,916.00	0.36
44	002283	天润工业	1,978,200	8,486,478.00	0.36

45	600572	康恩贝	1,842,070	8,234,052.90	0.35
46	600776	东方通信	814,685	8,008,353.55	0.34
47	603583	捷昌驱动	390,575	7,959,918.50	0.34
48	000058	深赛格	1,445,100	7,760,187.00	0.33
49	002274	华昌化工	1,024,500	7,601,790.00	0.32
50	002100	天康生物	1,056,500	7,321,545.00	0.31
51	600420	国药现代	672,400	7,181,232.00	0.31
52	301316	慧博云通	487,700	7,159,436.00	0.30
53	002697	红旗连锁	1,532,400	7,095,012.00	0.30
54	000062	深圳华强	789,400	7,025,660.00	0.30
55	002332	仙琚制药	615,600	7,023,996.00	0.30
56	002467	二六三	2,048,187	6,840,944.58	0.29
57	002004	华邦健康	1,779,500	6,762,100.00	0.29
58	002773	康弘药业	311,300	6,739,645.00	0.29
59	000682	东方电子	609,253	6,726,153.12	0.29
60	000597	东北制药	1,711,500	6,623,505.00	0.28
61	002396	星网锐捷	489,300	6,463,653.00	0.28
62	601311	骆驼股份	799,769	6,414,147.38	0.27
63	600273	嘉化能源	891,800	6,367,452.00	0.27
64	300085	银之杰	780,300	6,304,824.00	0.27
65	300850	新强联	417,800	6,275,356.00	0.27
66	600391	航发科技	407,500	6,214,375.00	0.26
67	000503	国新健康	922,100	6,150,407.00	0.26
68	002097	山河智能	1,018,200	6,139,746.00	0.26
69	300674	宇信科技	551,300	6,108,404.00	0.26
70	600728	佳都科技	1,637,800	6,076,238.00	0.26
71	000810	创维数字	699,300	5,999,994.00	0.26
72	000550	江铃汽车	274,300	5,955,053.00	0.25
73	002617	露笑科技	1,220,200	5,856,960.00	0.25
74	300366	创意信息	806,249	5,837,242.76	0.25
75	601101	昊华能源	633,100	5,818,189.00	0.25
76	000543	皖能电力	655,200	5,798,520.00	0.25
77	600610	中毅达	1,451,200	5,775,776.00	0.25
78	688586	江航装备	616,117	5,729,888.10	0.24
79	600037	歌华有线	956,300	5,718,674.00	0.24
80	601908	京运通	2,260,300	5,718,559.00	0.24
81	000837	秦川机床	770,400	5,670,144.00	0.24
82	688380	中微半导	338,416	5,658,315.52	0.24
83	300687	赛意信息	390,700	5,438,544.00	0.23
84	600100	同方股份	1,067,900	5,435,611.00	0.23
85	301291	明阳电气	178,845	5,374,292.25	0.23

86	600797	浙大网新	1,156,400	5,354,132.00	0.23
87	000795	英洛华	964,300	5,342,222.00	0.23
88	002174	游族网络	699,200	5,306,928.00	0.23
89	600458	时代新材	525,300	5,305,530.00	0.23
90	601801	皖新传媒	764,000	5,294,520.00	0.23
91	000030	富奥股份	1,074,900	5,277,759.00	0.22
92	002171	楚江新材	799,300	5,267,387.00	0.22
93	600252	中恒集团	2,402,403	5,213,214.51	0.22
94	002020	京新药业	487,000	5,098,890.00	0.22
95	600123	兰花科创	566,500	5,070,175.00	0.22
96	002038	双鹭药业	680,200	5,013,074.00	0.21
97	002099	海翔药业	980,700	5,011,377.00	0.21
98	002276	万马股份	695,000	4,983,150.00	0.21
99	002190	成飞集成	352,900	4,982,948.00	0.21
100	600997	开滦股份	725,100	4,974,186.00	0.21
101	600012	皖通高速	352,600	4,925,822.00	0.21
102	601279	英利汽车	1,312,500	4,895,625.00	0.21
103	600556	天下秀	1,339,300	4,875,052.00	0.21
104	300451	创业慧康	1,399,900	4,843,654.00	0.21
105	300065	海兰信	704,465	4,656,513.65	0.20
106	002267	陕天然气	613,356	4,636,971.36	0.20
107	000403	派林生物	171,700	4,577,522.00	0.19
108	002204	大连重工	1,066,700	4,554,809.00	0.19
109	603906	龙蟠科技	577,600	4,499,504.00	0.19
110	002317	众生药业	392,000	4,480,560.00	0.19
111	603766	隆鑫通用	653,500	4,430,730.00	0.19
112	600449	宁夏建材	373,200	4,385,100.00	0.19
113	601015	陕西黑猫	1,531,774	4,288,967.20	0.18
114	002043	兔宝宝	413,300	4,285,921.00	0.18
115	002456	欧菲光	547,800	4,278,318.00	0.18
116	002421	达实智能	1,831,500	4,267,395.00	0.18
117	003040	楚天龙	345,100	4,244,730.00	0.18
118	601811	新华文轩	300,800	4,214,208.00	0.18
119	688007	光峰科技	258,326	4,159,048.60	0.18
120	603169	兰石重装	912,300	4,105,350.00	0.17
121	600490	鹏欣资源	1,554,500	4,041,700.00	0.17
122	688800	瑞可达	143,806	4,038,072.48	0.17
123	600929	雪天盐业	759,017	4,022,790.10	0.17
124	002534	西子洁能	395,827	3,962,228.27	0.17
125	300079	数码视讯	946,200	3,841,572.00	0.16
126	605365	立达信	239,800	3,805,626.00	0.16

127	605222	起帆电缆	245,900	3,772,106.00	0.16
128	600285	羚锐制药	155,700	3,769,497.00	0.16
129	603919	金徽酒	206,600	3,753,922.00	0.16
130	002036	联创电子	554,200	3,740,850.00	0.16
131	300226	上海钢联	220,300	3,731,882.00	0.16
132	601163	三角轮胎	241,400	3,674,108.00	0.16
133	600461	洪城环境	312,500	3,618,750.00	0.15
134	603301	振德医疗	173,100	3,610,866.00	0.15
135	000426	兴业银锡	265,100	3,600,058.00	0.15
136	600761	安徽合力	165,880	3,589,643.20	0.15
137	603936	博敏电子	426,800	3,585,120.00	0.15
138	600366	宁波韵升	678,600	3,542,292.00	0.15
139	600409	三友化工	703,800	3,533,076.00	0.15
140	300348	长亮科技	515,200	3,513,664.00	0.15
141	600773	西藏城投	339,500	3,503,640.00	0.15
142	600064	南京高科	574,300	3,486,001.00	0.15
143	688033	天宜上佳	579,200	3,475,200.00	0.15
144	300773	拉卡拉	276,900	3,441,867.00	0.15
145	688400	凌云光	203,600	3,396,048.00	0.14
146	600595	中孚实业	1,363,800	3,395,862.00	0.14
147	300080	易成新能	1,172,792	3,377,640.96	0.14
148	002537	海联金汇	651,523	3,368,373.91	0.14
149	300143	盈康生命	447,100	3,366,663.00	0.14
150	688209	英集芯	270,558	3,357,624.78	0.14
151	300573	兴齐眼药	20,280	3,325,920.00	0.14
152	002023	海特高新	361,000	3,303,150.00	0.14
153	000860	顺鑫农业	196,600	3,291,084.00	0.14
154	300039	上海凯宝	611,400	3,270,990.00	0.14
155	688556	高测股份	267,800	3,184,142.00	0.14
156	600151	航天机电	701,900	3,172,588.00	0.14
157	002349	精华制药	472,500	3,099,600.00	0.13
158	002250	联化科技	640,700	3,075,360.00	0.13
159	002545	东方铁塔	448,300	3,052,923.00	0.13
160	000019	深粮控股	525,700	3,017,518.00	0.13
161	300887	谱尼测试	404,300	2,991,820.00	0.13
162	002585	双星新材	602,600	2,988,896.00	0.13
163	688167	炬光科技	54,279	2,985,345.00	0.13
164	300323	华灿光电	679,700	2,956,695.00	0.13
165	300068	南都电源	353,300	2,925,324.00	0.12
166	603533	掌阅科技	154,900	2,891,983.00	0.12
167	002681	奋达科技	784,400	2,863,060.00	0.12



168	002651	利君股份	520,000	2,854,800.00	0.12
169	002068	黑猫股份	400,000	2,840,000.00	0.12
170	600877	电科芯片	261,500	2,803,280.00	0.12
171	688232	新点软件	141,351	2,787,441.72	0.12
172	002777	久远银海	184,000	2,758,160.00	0.12
173	600888	新疆众和	386,982	2,735,962.74	0.12
174	603323	苏农银行	559,595	2,691,651.95	0.11
175	600562	国睿科技	195,640	2,672,442.40	0.11
176	600110	诺德股份	871,100	2,656,855.00	0.11
177	300045	华力创通	149,300	2,635,145.00	0.11
178	600618	氯碱化工	299,900	2,633,122.00	0.11
179	688091	上海谊众	114,955	2,596,833.45	0.11
180	000801	四川九洲	259,100	2,591,000.00	0.11
181	300821	东岳硅材	376,400	2,574,576.00	0.11
182	600320	振华重工	751,640	2,570,608.80	0.11
183	301238	瑞泰新材	170,900	2,558,373.00	0.11
184	603595	东尼电子	123,200	2,536,688.00	0.11
185	601038	一拖股份	159,900	2,528,019.00	0.11
186	603118	共进股份	375,923	2,518,684.10	0.11
187	002003	伟星股份	198,400	2,489,920.00	0.11
188	603489	八方股份	91,540	2,469,749.20	0.11
189	600993	马应龙	92,400	2,464,308.00	0.10
190	603439	贵州三力	192,900	2,461,404.00	0.10
191	600916	中国黄金	251,100	2,415,582.00	0.10
192	300113	顺网科技	234,500	2,401,280.00	0.10
193	600810	神马股份	383,300	2,376,460.00	0.10
194	600711	ST盛屯	639,300	2,346,231.00	0.10
195	600559	老白干酒	128,998	2,345,183.64	0.10
196	300857	协创数据	40,900	2,331,300.00	0.10
197	000029	深深房A	219,200	2,330,096.00	0.10
198	600502	安徽建工	541,000	2,326,300.00	0.10
199	301239	普瑞眼科	65,400	2,310,582.00	0.10
200	600185	格力地产	538,400	2,288,200.00	0.10
201	603915	国茂股份	221,700	2,281,293.00	0.10
202	300133	华策影视	370,200	2,273,028.00	0.10
203	603393	新天然气	65,300	2,268,522.00	0.10
204	601949	中国出版	381,200	2,252,892.00	0.10
205	300456	赛微电子	140,200	2,224,974.00	0.09
206	300679	电连技术	55,300	2,224,719.00	0.09
207	000065	北方国际	212,700	2,205,699.00	0.09
208	688023	安恒信息	55,013	2,201,070.13	0.09

209	601137	博威合金	143,100	2,180,844.00	0.09
210	600648	外高桥	246,000	2,179,560.00	0.09
211	300596	利安隆	80,200	2,175,826.00	0.09
212	688559	海目星	65,500	2,154,295.00	0.09
213	600864	哈投股份	451,700	2,145,575.00	0.09
214	300587	天铁股份	522,800	2,112,112.00	0.09
215	300457	赢合科技	118,375	2,110,626.25	0.09
216	600933	爱柯迪	142,700	2,110,533.00	0.09
217	000990	诚志股份	281,100	2,091,384.00	0.09
218	688031	星环科技	56,817	2,085,752.07	0.09
219	603368	柳药集团	118,851	2,079,892.50	0.09
220	688278	特宝生物	38,666	2,070,564.30	0.09
221	603871	嘉友国际	116,948	2,068,810.12	0.09
222	301268	铭利达	132,300	2,057,265.00	0.09
223	603730	岱美股份	206,540	2,053,007.60	0.09
224	000758	中色股份	402,062	2,042,474.96	0.09
225	603358	华达科技	70,704	2,039,810.40	0.09
226	688235	百济神州	17,448	2,021,176.32	0.09
227	600750	江中药业	87,200	2,015,192.00	0.09
228	688578	艾力斯	31,512	2,008,574.88	0.09
229	000688	国城矿业	209,900	1,998,248.00	0.09
230	300953	震裕科技	36,700	1,989,140.00	0.08
231	600552	凯盛科技	209,300	1,973,699.00	0.08
232	605333	沪光股份	70,400	1,960,640.00	0.08
233	688639	华恒生物	25,623	1,957,340.97	0.08
234	000061	农产品	402,300	1,955,178.00	0.08
235	688239	航宇科技	56,117	1,952,871.60	0.08
236	688105	诺唯赞	96,800	1,936,968.00	0.08
237	603013	亚普股份	143,300	1,930,251.00	0.08
238	600751	海航科技	861,400	1,912,308.00	0.08
239	002643	万润股份	190,950	1,909,500.00	0.08
240	301308	江波龙	20,100	1,904,274.00	0.08
241	600328	中盐化工	277,500	1,903,650.00	0.08
242	603466	风语筑	222,800	1,902,712.00	0.08
243	000012	南玻A	370,400	1,866,816.00	0.08
244	688568	中科星图	38,818	1,851,618.60	0.08
245	002516	旷达科技	508,100	1,849,484.00	0.08
246	603989	艾华集团	130,785	1,838,837.10	0.08
247	001309	德明利	21,200	1,831,680.00	0.08
248	605589	圣泉集团	90,100	1,828,129.00	0.08
249	002265	建设工业	211,200	1,822,656.00	0.08

250	688076	诺泰生物	23,219	1,817,583.32	0.08
251	000657	中钨高新	198,400	1,813,376.00	0.08
252	600874	创业环保	323,900	1,810,601.00	0.08
253	600478	科力远	478,200	1,802,814.00	0.08
254	000915	华特达因	59,201	1,785,502.16	0.08
255	688798	艾为电子	31,411	1,778,490.82	0.08
256	605020	永和股份	91,800	1,760,724.00	0.07
257	600330	天通股份	258,600	1,758,480.00	0.07
258	002215	诺普信	235,000	1,750,750.00	0.07
259	688408	中信博	19,000	1,749,520.00	0.07
260	002101	广东鸿图	165,900	1,746,927.00	0.07
261	300398	飞凯材料	140,300	1,725,690.00	0.07
262	002434	万里扬	349,400	1,712,060.00	0.07
263	300856	科思股份	53,300	1,706,133.00	0.07
264	601778	晶科科技	745,100	1,698,828.00	0.07
265	002126	银轮股份	96,900	1,687,029.00	0.07
266	000821	京山轻机	148,400	1,681,372.00	0.07
267	001236	弘业期货	236,200	1,679,382.00	0.07
268	600720	中交设计	187,800	1,671,420.00	0.07
269	300783	三只松鼠	75,800	1,657,746.00	0.07
270	002928	华夏航空	261,300	1,656,642.00	0.07
271	688439	振华风光	24,915	1,655,601.75	0.07
272	688016	心脉医疗	16,875	1,654,593.75	0.07
273	002212	天融信	339,400	1,652,878.00	0.07
274	001914	招商积余	164,900	1,652,298.00	0.07
275	688690	纳微科技	94,713	1,645,164.81	0.07
276	603108	润达医疗	108,400	1,641,176.00	0.07
277	002416	爱施德	185,100	1,638,135.00	0.07
278	688596	正帆科技	49,250	1,625,250.00	0.07
279	688711	宏微科技	101,137	1,624,260.22	0.07
280	688127	蓝特光学	88,191	1,621,832.49	0.07
281	002987	京北方	153,320	1,614,459.60	0.07
282	603267	鸿远电子	47,000	1,602,700.00	0.07
283	301090	华润材料	243,500	1,602,230.00	0.07
284	600323	瀚蓝环境	76,200	1,592,580.00	0.07
285	603033	三维股份	135,840	1,589,328.00	0.07
286	002847	盐津铺子	37,030	1,583,773.10	0.07
287	002705	新宝股份	111,600	1,570,212.00	0.07
288	600395	盘江股份	260,700	1,566,807.00	0.07
289	601886	江河集团	320,600	1,564,528.00	0.07
290	688352	颀中科技	137,100	1,564,311.00	0.07

291	600577	精达股份	393,100	1,560,607.00	0.07
292	688484	南芯科技	42,000	1,558,200.00	0.07
293	002891	中宠股份	73,900	1,542,293.00	0.07
294	600966	博汇纸业	319,000	1,524,820.00	0.06
295	002837	英维克	71,130	1,521,470.70	0.06
296	601375	中原证券	442,400	1,508,584.00	0.06
297	300031	宝通科技	104,400	1,500,228.00	0.06
298	600602	云赛智联	134,300	1,482,672.00	0.06
299	688575	亚辉龙	62,415	1,455,517.80	0.06
300	603678	火炬电子	58,600	1,446,834.00	0.06
301	002549	凯美特气	282,100	1,441,531.00	0.06
302	600459	贵研铂业	106,620	1,440,436.20	0.06
303	601619	嘉泽新能	474,300	1,437,129.00	0.06
304	002226	江南化工	318,600	1,427,328.00	0.06
305	603567	珍宝岛	134,900	1,420,497.00	0.06
306	002011	盾安环境	143,900	1,414,537.00	0.06
307	000415	渤海租赁	552,100	1,407,855.00	0.06
308	600557	康缘药业	89,600	1,406,720.00	0.06
309	301327	华宝新能	24,500	1,403,850.00	0.06
310	603666	亿嘉和	88,800	1,401,264.00	0.06
311	002091	江苏国泰	202,700	1,380,387.00	0.06
312	301071	力量钻石	48,900	1,355,019.00	0.06
313	601969	海南矿业	209,100	1,325,694.00	0.06
314	301207	华兰疫苗	75,000	1,325,250.00	0.06
315	600006	东风股份	207,200	1,324,008.00	0.06
316	603229	奥翔药业	131,000	1,316,550.00	0.06
317	600125	铁龙物流	219,500	1,310,415.00	0.06
318	300026	红日药业	420,700	1,283,135.00	0.05
319	002737	葵花药业	54,700	1,278,886.00	0.05
320	300319	麦捷科技	137,000	1,278,210.00	0.05
321	002318	久立特材	54,600	1,273,818.00	0.05
322	002287	奇正藏药	65,000	1,272,700.00	0.05
323	688147	微导纳米	51,100	1,272,390.00	0.05
324	601126	四方股份	65,800	1,264,676.00	0.05
325	300409	道氏技术	146,600	1,254,896.00	0.05
326	000950	重药控股	254,900	1,241,363.00	0.05
327	688776	国光电气	22,300	1,235,420.00	0.05
328	300693	盛弘股份	58,500	1,224,990.00	0.05
329	300109	新开源	105,550	1,222,269.00	0.05
330	002222	福晶科技	52,800	1,189,584.00	0.05
331	002612	朗姿股份	85,874	1,186,778.68	0.05

332	600586	金晶科技	202,900	1,176,820.00	0.05
333	000429	粤高速A	112,700	1,173,207.00	0.05
334	688050	爱博医疗	15,980	1,171,653.60	0.05
335	002581	未名医药	120,881	1,166,501.65	0.05
336	002990	盛视科技	57,900	1,165,527.00	0.05
337	002706	良信股份	169,400	1,162,084.00	0.05
338	688372	伟测科技	29,500	1,160,235.00	0.05
339	002183	怡亚通	408,100	1,159,004.00	0.05
340	001270	铖昌科技	31,560	1,158,883.20	0.05
341	002913	奥士康	41,300	1,107,253.00	0.05
342	300257	开山股份	109,000	1,100,900.00	0.05
343	300624	万兴科技	20,600	1,093,242.00	0.05
344	001338	永顺泰	111,100	1,088,780.00	0.05
345	002302	西部建设	207,900	1,081,080.00	0.05
346	600223	福瑞达	152,900	1,081,003.00	0.05
347	600491	龙元建设	393,600	1,078,464.00	0.05
348	002335	科华数据	50,200	1,060,726.00	0.05
349	603348	文灿股份	38,200	1,057,758.00	0.05
350	603162	海通发展	113,200	1,052,760.00	0.04
351	600295	鄂尔多斯	105,600	1,047,552.00	0.04
352	688266	泽璟制药	19,300	1,046,446.00	0.04
353	002895	川恒股份	57,000	1,043,670.00	0.04
354	000735	罗牛山	240,701	1,042,235.33	0.04
355	300482	万孚生物	42,300	1,032,120.00	0.04
356	600575	淮河能源	262,600	1,021,514.00	0.04
357	300294	博雅生物	30,900	1,019,700.00	0.04
358	603103	横店影视	73,600	1,018,624.00	0.04
359	000028	国药一致	31,600	1,018,468.00	0.04
360	002239	奥特佳	437,400	1,006,020.00	0.04
361	002041	登海种业	124,000	1,001,920.00	0.04
362	603025	大豪科技	72,100	996,422.00	0.04
363	603983	丸美股份	36,100	993,833.00	0.04
364	000951	中国重汽	69,065	989,010.80	0.04
365	000913	钱江摩托	62,500	985,000.00	0.04
366	688598	金博股份	34,644	980,425.20	0.04
367	300203	聚光科技	96,400	972,676.00	0.04
368	600682	南京新百	194,000	968,060.00	0.04
369	300638	广和通	56,480	965,808.00	0.04
370	600363	联创光电	34,500	949,440.00	0.04
371	002967	广电计量	78,600	927,480.00	0.04
372	002315	焦点科技	34,400	927,424.00	0.04

373	300772	运达股份	96,560	926,976.00	0.04
374	300841	康华生物	18,300	926,712.00	0.04
375	688327	云从科技	81,742	924,502.02	0.04
376	688368	晶丰明源	16,682	924,182.80	0.04
377	301078	孩子王	181,600	918,896.00	0.04
378	002145	中核钛白	280,000	918,400.00	0.04
379	000049	德赛电池	39,100	916,895.00	0.04
380	002698	博实股份	74,000	907,980.00	0.04
381	600717	天津港	212,000	905,240.00	0.04
382	000766	通化金马	55,600	900,164.00	0.04
383	002993	奥海科技	24,172	899,198.40	0.04
384	002292	奥飞娱乐	150,200	898,196.00	0.04
385	600685	中船防务	32,141	896,733.90	0.04
386	603505	金石资源	31,600	882,588.00	0.04
387	300183	东软载波	76,000	880,080.00	0.04
388	300726	宏达电子	38,400	875,520.00	0.04
389	601222	林洋能源	139,500	874,665.00	0.04
390	688336	三生国健	42,897	872,953.95	0.04
391	603071	物产环能	69,300	868,329.00	0.04
392	688707	振华新材	88,900	865,886.00	0.04
393	001311	多利科技	35,760	864,676.80	0.04
394	301171	易点天下	58,800	864,360.00	0.04
395	002194	武汉凡谷	107,100	862,155.00	0.04
396	600710	苏美达	105,700	861,455.00	0.04
397	600850	电科数字	47,100	852,510.00	0.04
398	688185	康希诺	20,714	851,138.26	0.04
399	000555	神州信息	90,600	844,392.00	0.04
400	002859	洁美科技	42,000	843,360.00	0.04
401	002324	普利特	98,400	841,320.00	0.04
402	300233	金城医药	55,800	832,536.00	0.04
403	600197	伊力特	46,600	829,946.00	0.04
404	600422	昆药集团	46,400	827,312.00	0.04
405	002275	桂林三金	66,500	825,265.00	0.04
406	002746	仙坛股份	142,800	818,244.00	0.03
407	002960	青鸟消防	64,600	816,544.00	0.03
408	002649	博彦科技	102,203	813,535.88	0.03
409	600587	新华医疗	50,570	795,971.80	0.03
410	000600	建投能源	125,500	790,650.00	0.03
411	002675	东诚药业	64,400	789,544.00	0.03
412	600882	妙可蓝多	63,100	786,857.00	0.03
413	688270	臻镭科技	30,113	785,949.30	0.03

414	600740	山西焦化	198,100	776,552.00	0.03
415	002701	奥瑞金	186,500	775,840.00	0.03
416	688289	圣湘生物	44,100	775,278.00	0.03
417	000034	神州数码	33,400	764,526.00	0.03
418	002991	甘源食品	12,600	764,190.00	0.03
419	002453	华软科技	177,800	762,762.00	0.03
420	600075	新疆天业	220,900	762,105.00	0.03
421	688048	长光华芯	24,381	761,662.44	0.03
422	688315	诺禾致源	69,656	760,643.52	0.03
423	301205	联特科技	12,114	760,153.50	0.03
424	000517	荣安地产	280,700	752,276.00	0.03
425	688503	聚和材料	26,588	747,122.80	0.03
426	601890	亚星锚链	104,900	739,545.00	0.03
427	601702	华峰铝业	40,300	735,878.00	0.03
428	600667	太极实业	128,700	734,877.00	0.03
429	002096	易普力	61,600	733,040.00	0.03
430	600508	上海能源	51,600	730,140.00	0.03
431	300232	洲明科技	138,700	724,014.00	0.03
432	688333	铂力特	14,900	721,905.00	0.03
433	600643	爱建集团	189,000	712,530.00	0.03
434	300463	迈克生物	62,600	712,388.00	0.03
435	002006	精工科技	52,700	707,234.00	0.03
436	002075	沙钢股份	186,600	703,482.00	0.03
437	603132	金徽股份	51,100	703,136.00	0.03
438	603719	良品铺子	60,000	700,200.00	0.03
439	600269	赣粤高速	134,600	695,882.00	0.03
440	688262	国芯科技	37,833	688,938.93	0.03
441	600971	恒源煤电	57,700	688,938.00	0.03
442	002978	安宁股份	24,700	688,142.00	0.03
443	603985	恒润股份	57,400	683,060.00	0.03
444	000690	宝新能源	133,400	680,340.00	0.03
445	601200	上海环境	79,600	676,600.00	0.03
446	002807	江阴银行	179,000	674,830.00	0.03
447	600456	宝钛股份	26,400	673,992.00	0.03
448	300757	罗博特科	7,700	672,595.00	0.03
449	300382	斯莱克	113,400	670,194.00	0.03
450	300702	天宇股份	36,500	650,795.00	0.03
451	002351	漫步者	49,287	648,124.05	0.03
452	605168	三人行	24,580	647,191.40	0.03
453	600266	城建发展	171,600	641,784.00	0.03
454	002925	盈趣科技	50,400	638,568.00	0.03

455	688680	海优新材	22,200	638,028.00	0.03
456	601001	晋控煤业	38,500	636,020.00	0.03
457	300049	福瑞股份	12,500	629,250.00	0.03
458	600338	西藏珠峰	67,900	627,396.00	0.03
459	603308	应流股份	50,000	621,000.00	0.03
460	688173	希荻微	56,259	620,536.77	0.03
461	603055	台华新材	60,500	612,865.00	0.03
462	002428	云南锗业	56,300	611,418.00	0.03
463	300101	振芯科技	41,000	605,570.00	0.03
464	688403	汇成股份	71,264	604,318.72	0.03
465	688166	博瑞医药	17,200	602,000.00	0.03
466	603997	继峰股份	58,600	599,478.00	0.03
467	603236	移远通信	12,800	598,144.00	0.03
468	300443	金雷股份	39,000	597,870.00	0.03
469	002151	北斗星通	24,700	597,246.00	0.03
470	000582	北部湾港	80,000	595,200.00	0.03
471	603920	世运电路	30,100	594,174.00	0.03
472	300633	开立医疗	14,900	589,742.00	0.03
473	605507	国邦医药	35,300	587,745.00	0.03
474	002233	塔牌集团	80,300	586,993.00	0.02
475	601921	浙版传媒	76,583	585,094.12	0.02
476	600389	江山股份	41,400	584,154.00	0.02
477	600531	豫光金铅	90,100	580,244.00	0.02
478	688388	嘉元科技	58,372	569,127.00	0.02
479	000567	海德股份	100,608	564,410.88	0.02
480	002941	新疆交建	56,500	563,870.00	0.02
481	000685	中山公用	77,100	555,891.00	0.02
482	600403	大有能源	213,400	550,572.00	0.02
483	688322	奥比中光	20,600	550,226.00	0.02
484	603599	广信股份	45,200	548,276.00	0.02
485	603556	海兴电力	11,700	547,911.00	0.02
486	002567	唐人神	102,100	547,256.00	0.02
487	600986	浙文互联	128,000	537,600.00	0.02
488	688106	金宏气体	29,950	524,724.00	0.02
489	688110	东芯股份	27,400	522,518.00	0.02
490	002158	汉钟精机	30,800	514,976.00	0.02
491	601606	长城军工	53,800	514,328.00	0.02
492	002911	佛燃能源	56,200	513,668.00	0.02
493	002163	海南发展	93,500	512,380.00	0.02
494	000813	德展健康	244,900	509,392.00	0.02
495	600477	杭萧钢构	218,600	509,338.00	0.02



496	688152	麒麟信安	13,100	507,232.00	0.02
497	600718	东软集团	61,300	506,951.00	0.02
498	600331	宏达股份	86,400	500,256.00	0.02
499	688700	东威科技	19,050	499,300.50	0.02
500	301087	可孚医疗	14,600	494,940.00	0.02
501	002402	和而泰	46,100	493,731.00	0.02
502	600246	万通发展	72,900	489,888.00	0.02
503	300620	光库科技	13,300	489,174.00	0.02
504	300363	博腾股份	40,700	486,365.00	0.02
505	605599	菜百股份	38,000	483,740.00	0.02
506	301301	川宁生物	37,500	479,250.00	0.02
507	688381	帝奥微	24,493	477,123.64	0.02
508	000676	智度股份	78,600	477,102.00	0.02
509	603100	川仪股份	20,200	474,902.00	0.02
510	002192	融捷股份	15,800	474,316.00	0.02
511	688321	微芯生物	26,800	471,680.00	0.02
512	300188	国投智能	42,400	471,064.00	0.02
513	000767	晋控电力	201,900	470,427.00	0.02
514	000968	蓝焰控股	73,900	470,004.00	0.02
515	603093	南华期货	54,200	469,372.00	0.02
516	300525	博思软件	36,800	467,360.00	0.02
517	688177	百奥泰	22,100	466,752.00	0.02
518	600120	浙江东方	138,700	463,258.00	0.02
519	300598	诚迈科技	16,490	463,039.20	0.02
520	002484	江海股份	34,800	461,100.00	0.02
521	300910	瑞丰新材	10,500	459,060.00	0.02
522	300151	昌红科技	29,000	458,780.00	0.02
523	003012	东鹏控股	75,000	458,250.00	0.02
524	002060	广东建工	133,800	457,596.00	0.02
525	002747	埃斯顿	32,100	456,462.00	0.02
526	301155	海力风电	11,200	450,576.00	0.02
527	300428	立中集团	24,200	449,878.00	0.02
528	600645	中源协和	27,900	449,190.00	0.02
529	002961	瑞达期货	40,900	447,855.00	0.02
530	000090	天健集团	111,300	447,426.00	0.02
531	688141	杰华特	27,400	442,784.00	0.02
532	600301	华锡有色	21,800	440,796.00	0.02
533	600206	有研新材	48,600	432,540.00	0.02
534	300768	迪普科技	36,500	432,525.00	0.02
535	300811	铂科新材	9,800	430,220.00	0.02
536	688001	华兴源创	18,900	426,762.00	0.02

537	688343	云天励飞	14,900	425,395.00	0.02
538	002125	湘潭电化	43,700	425,201.00	0.02
539	601333	广深铁路	131,100	424,764.00	0.02
540	000923	河钢资源	24,400	420,168.00	0.02
541	002906	华阳集团	15,700	420,132.00	0.02
542	301015	百洋医药	17,800	418,834.00	0.02
543	300224	正海磁材	45,100	417,626.00	0.02
544	600446	金证股份	42,000	417,060.00	0.02
545	688161	威高骨科	20,927	414,773.14	0.02
546	300747	锐科激光	23,300	413,575.00	0.02
547	300820	英杰电气	10,500	413,070.00	0.02
548	300737	科顺股份	96,000	412,800.00	0.02
549	600055	万东医疗	33,400	412,490.00	0.02
550	301175	中科环保	93,100	408,709.00	0.02
551	688392	骄成超声	9,600	407,424.00	0.02
552	603693	江苏新能	34,800	404,376.00	0.02
553	002597	金禾实业	20,300	403,767.00	0.02
554	603008	喜临门	23,100	400,323.00	0.02
555	601208	东材科技	54,800	397,848.00	0.02
556	600961	株冶集团	41,800	394,592.00	0.02
557	300180	华峰超纤	111,300	392,889.00	0.02
558	301293	三博脑科	10,400	391,976.00	0.02
559	000848	承德露露	49,700	390,642.00	0.02
560	000686	东北证券	69,300	386,694.00	0.02
561	601677	明泰铝业	33,138	383,075.28	0.02
562	001287	中电港	23,100	381,843.00	0.02
563	300685	艾德生物	21,600	381,024.00	0.02
564	688202	美迪西	14,600	380,330.00	0.02
565	688139	海尔生物	10,209	379,774.80	0.02
566	300855	图南股份	14,020	370,688.80	0.02
567	002258	利尔化学	46,140	370,042.80	0.02
568	000088	盐田港	81,200	367,836.00	0.02
569	000552	甘肃能化	106,000	367,820.00	0.02
570	300770	新媒股份	11,000	367,180.00	0.02
571	300077	国民技术	41,800	364,914.00	0.02
572	605090	九丰能源	12,400	359,600.00	0.02
573	605123	派克新材	6,400	359,552.00	0.02
574	300284	苏交科	44,200	357,136.00	0.02
575	600835	上海机电	31,000	356,810.00	0.02
576	000628	高新发展	8,000	354,960.00	0.02
577	300315	掌趣科技	85,000	354,450.00	0.02

578	600201	生物股份	49,100	354,011.00	0.02
579	000719	中原传媒	33,800	341,718.00	0.01
580	688326	经纬恒润	5,935	340,253.55	0.01
581	600821	金开新能	66,100	339,754.00	0.01
582	300298	三诺生物	13,400	339,556.00	0.01
583	000756	新华制药	23,000	333,040.00	0.01
584	600787	中储股份	67,600	325,156.00	0.01
585	603039	泛微网络	10,000	317,600.00	0.01
586	600963	岳阳林纸	85,700	314,519.00	0.01
587	603098	森特股份	39,900	313,614.00	0.01
588	300741	华宝股份	20,500	312,420.00	0.01
589	300130	新国都	18,500	307,840.00	0.01
590	603187	海容冷链	26,140	304,792.40	0.01
591	300579	数字认证	15,500	302,250.00	0.01
592	002539	云图控股	42,300	301,599.00	0.01
593	002727	一心堂	19,700	297,273.00	0.01
594	300470	中密控股	8,739	295,465.59	0.01
595	688298	东方生物	10,291	279,400.65	0.01
596	300627	华测导航	9,200	274,620.00	0.01
597	300634	彩讯股份	16,300	274,329.00	0.01
598	688088	虹软科技	9,500	274,170.00	0.01
599	002901	大博医疗	9,900	255,717.00	0.01
600	688100	威胜信息	6,648	253,621.20	0.01
601	300663	科蓝软件	25,000	246,750.00	0.01
602	000727	冠捷科技	118,800	244,728.00	0.01
603	000828	东莞控股	26,400	237,864.00	0.01
604	688789	宏华数科	2,200	237,160.00	0.01
605	000762	西藏矿业	13,000	235,040.00	0.01
606	000016	深康佳A	110,100	234,513.00	0.01
607	000761	本钢板材	92,500	232,175.00	0.01
608	001213	中铁特货	58,300	230,285.00	0.01
609	300129	泰胜风能	33,700	229,834.00	0.01
610	002605	姚记科技	11,000	224,620.00	0.01
611	600073	光明肉业	40,612	223,772.12	0.01
612	601952	苏垦农发	24,500	220,990.00	0.01
613	600775	南京熊猫	27,500	220,000.00	0.01
614	002063	远光软件	41,700	218,508.00	0.01
615	002389	航天彩虹	15,700	218,073.00	0.01
616	300660	江苏雷利	8,500	216,920.00	0.01
617	688337	普源精电	8,395	211,721.90	0.01
618	301498	乖宝宠物	3,900	209,820.00	0.01

619	603063	禾望电气	13,400	205,422.00	0.01
620	300267	尔康制药	98,200	204,256.00	0.01
621	002245	蔚蓝锂芯	26,100	202,275.00	0.01
622	601777	力帆科技	52,400	201,216.00	0.01
623	300115	长盈精密	16,300	195,437.00	0.01
624	000528	柳工	17,300	193,587.00	0.01
625	600996	贵广网络	24,300	186,624.00	0.01
626	002840	华统股份	11,200	185,808.00	0.01
627	601028	玉龙股份	14,800	185,000.00	0.01
628	000927	中国铁物	77,500	184,450.00	0.01
629	603113	金能科技	33,600	183,792.00	0.01
630	600216	浙江医药	16,600	182,268.00	0.01
631	603283	赛腾股份	2,300	175,720.00	0.01
632	002079	苏州固锝	20,300	172,956.00	0.01
633	688206	概伦电子	11,427	169,690.95	0.01
634	002015	协鑫能科	20,600	163,976.00	0.01
635	300602	飞荣达	10,600	160,166.00	0.01
636	603027	千禾味业	11,820	157,206.00	0.01
637	603083	剑桥科技	4,800	154,944.00	0.01
638	603212	赛伍技术	13,800	152,352.00	0.01
639	603866	桃李面包	29,300	148,551.00	0.01
640	003006	百亚股份	6,200	146,940.00	0.01
641	300352	北信源	36,526	140,259.84	0.01
642	603300	华铁应急	25,300	138,138.00	0.01
643	600063	皖维高新	38,700	136,224.00	0.01
644	600771	广誉远	7,200	135,576.00	0.01
645	688131	皓元医药	6,903	132,054.39	0.01
646	300260	新莱应材	5,900	123,546.00	0.01
647	600869	远东股份	33,000	115,170.00	0.00
648	603566	普莱柯	8,400	114,072.00	0.00
649	603477	巨星农牧	3,700	106,190.00	0.00
650	600635	大众公用	37,681	100,985.08	0.00
651	002061	浙江交科	27,000	98,550.00	0.00
652	301180	万祥科技	6,300	98,532.00	0.00
653	603171	税友股份	3,500	94,640.00	0.00
654	600903	贵州燃气	15,100	94,224.00	0.00
655	601869	长飞光纤	3,502	85,203.66	0.00
656	002985	北摩高科	3,800	83,714.00	0.00
657	000869	张裕A	3,700	78,995.00	0.00
658	600641	万业企业	6,700	78,725.00	0.00
659	600217	中再资环	19,500	73,320.00	0.00

660	603609	禾丰股份	9,900	64,746.00	0.00
661	603636	南威软件	7,600	58,520.00	0.00
662	000917	电广传媒	10,600	53,530.00	0.00
663	603877	太平鸟	3,700	50,801.00	0.00
664	300393	中来股份	8,600	49,622.00	0.00
665	688128	中国电研	2,671	45,967.91	0.00
666	300171	东富龙	3,800	45,182.00	0.00
667	002946	新乳业	4,800	42,048.00	0.00
668	688389	普门科技	2,379	38,682.54	0.00
669	300613	富瀚微	770	25,340.70	0.00
670	301217	铜冠铜箔	2,200	21,120.00	0.00
671	601033	永兴股份	1,258	20,077.68	0.00
672	688658	悦康药业	963	17,179.92	0.00
673	003009	中天火箭	400	15,472.00	0.00
674	603995	甬金股份	100	1,752.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000725	京东方A	3,524,200	14,413,978.00	0.61
2	000830	鲁西化工	1,007,400	11,675,766.00	0.50
3	002273	水晶光电	608,600	10,334,028.00	0.44
4	601019	山东出版	826,300	9,766,866.00	0.42
5	600219	南山铝业	2,422,950	9,231,439.50	0.39
6	002128	电投能源	417,400	8,807,140.00	0.37
7	600350	山东高速	985,100	8,718,135.00	0.37
8	600642	申能股份	910,706	8,041,533.98	0.34
9	000100	TCL 科技	1,831,010	7,909,963.20	0.34
10	600941	中国移动	65,100	6,998,250.00	0.30
11	600183	生益科技	320,800	6,756,048.00	0.29
12	600901	江苏金租	1,219,740	6,159,687.00	0.26
13	002152	广电运通	577,500	6,040,650.00	0.26
14	000683	远兴能源	827,800	5,720,098.00	0.24
15	002240	盛新锂能	401,400	5,386,788.00	0.23
16	603228	景旺电子	168,900	5,371,020.00	0.23
17	600380	健康元	474,100	5,295,697.00	0.23
18	301011	华立科技	311,900	4,806,379.00	0.20
19	000541	佛山照明	979,630	4,770,798.10	0.20
20	600863	内蒙华电	1,004,100	4,659,024.00	0.20
21	600497	驰宏锌锗	846,500	4,520,310.00	0.19

22	300122	智飞生物	153,000	4,288,590.00	0.18
23	603258	电魂网络	263,100	4,249,065.00	0.18
24	002078	太阳纸业	287,800	4,014,810.00	0.17
25	688510	航亚科技	213,888	3,937,678.08	0.17
26	002563	森马服饰	618,039	3,590,806.59	0.15
27	300378	鼎捷软件	214,027	3,482,219.29	0.15
28	688095	福昕软件	70,453	3,227,451.93	0.14
29	301391	卡莱特	65,240	2,856,207.20	0.12
30	600481	双良节能	598,100	2,793,127.00	0.12
31	600096	云天化	140,300	2,724,626.00	0.12
32	600483	福能股份	228,300	2,661,978.00	0.11
33	600398	海澜之家	278,900	2,577,036.00	0.11
34	600820	隧道股份	364,600	2,380,838.00	0.10
35	301018	申菱环境	122,300	2,377,512.00	0.10
36	000513	丽珠集团	63,240	2,353,160.40	0.10
37	002252	上海莱士	295,300	2,309,246.00	0.10
38	601766	中国中车	302,000	2,268,020.00	0.10
39	002035	华帝股份	361,600	2,252,768.00	0.10
40	603337	杰克股份	81,300	2,139,816.00	0.09
41	002073	软控股份	288,200	2,129,798.00	0.09
42	600998	九州通	418,969	2,044,568.72	0.09
43	002380	科远智慧	102,300	1,872,090.00	0.08
44	002153	石基信息	323,800	1,855,374.00	0.08
45	603508	思维列控	98,000	1,837,500.00	0.08
46	000630	铜陵有色	491,200	1,773,232.00	0.08
47	688525	佰维存储	26,300	1,687,145.00	0.07
48	603298	杭叉集团	85,196	1,673,249.44	0.07
49	603096	新经典	98,340	1,661,946.00	0.07
50	688133	泰坦科技	105,093	1,658,367.54	0.07
51	000157	中联重科	203,800	1,565,184.00	0.07
52	300394	天孚通信	17,100	1,511,982.00	0.06
53	300997	欢乐家	127,500	1,507,050.00	0.06
54	300371	汇中股份	178,200	1,491,534.00	0.06
55	688766	普冉股份	15,253	1,482,134.01	0.06
56	603160	汇顶科技	21,400	1,471,250.00	0.06
57	601117	中国化学	177,900	1,465,896.00	0.06
58	600886	国投电力	78,300	1,428,192.00	0.06
59	603569	长久物流	207,445	1,423,072.70	0.06
60	601328	交通银行	189,100	1,412,577.00	0.06
61	688516	奥特维	33,745	1,410,878.45	0.06
62	600900	长江电力	48,500	1,402,620.00	0.06

63	002533	金杯电工	140,900	1,401,955.00	0.06
64	300724	捷佳伟创	25,800	1,393,458.00	0.06
65	603408	建霖家居	102,400	1,350,656.00	0.06
66	688313	仕佳光子	138,100	1,314,712.00	0.06
67	000998	隆平高科	130,900	1,286,747.00	0.05
68	688253	英诺特	33,700	1,284,307.00	0.05
69	603977	国泰集团	126,100	1,282,437.00	0.05
70	002334	英威腾	212,700	1,271,946.00	0.05
71	000598	兴蓉环境	168,400	1,266,368.00	0.05
72	688361	中科飞测	26,600	1,258,180.00	0.05
73	688009	中国通号	206,440	1,238,640.00	0.05
74	600795	国电电力	206,600	1,237,534.00	0.05
75	603688	石英股份	41,300	1,222,893.00	0.05
76	000526	学大教育	19,800	1,219,680.00	0.05
77	603019	中科曙光	29,300	1,215,950.00	0.05
78	603606	东方电缆	24,100	1,176,321.00	0.05
79	002609	捷顺科技	152,000	1,152,160.00	0.05
80	300017	网宿科技	145,000	1,145,500.00	0.05
81	688506	百利天恒	6,300	1,142,820.00	0.05
82	002601	龙佰集团	60,600	1,125,342.00	0.05
83	301260	格力博	79,700	1,085,514.00	0.05
84	603501	韦尔股份	10,700	1,063,259.00	0.05
85	603520	司太立	106,300	1,014,102.00	0.04
86	688138	清溢光电	46,900	1,008,350.00	0.04
87	002385	大北农	259,000	997,150.00	0.04
88	300765	新诺威	38,980	983,465.40	0.04
89	002475	立讯精密	24,800	974,888.00	0.04
90	300601	康泰生物	62,400	974,064.00	0.04
91	688036	传音控股	12,700	972,058.00	0.04
92	300502	新易盛	9,200	971,060.00	0.04
93	000423	东阿阿胶	15,500	970,300.00	0.04
94	000521	长虹美菱	126,000	955,080.00	0.04
95	600548	深高速	89,700	953,511.00	0.04
96	002587	奥拓电子	176,200	947,956.00	0.04
97	600050	中国联通	199,900	939,530.00	0.04
98	601231	环旭电子	58,100	932,505.00	0.04
99	600161	天坛生物	38,160	931,104.00	0.04
100	301073	君亭酒店	50,800	924,560.00	0.04
101	688234	天岳先进	19,572	918,318.24	0.04
102	603518	锦泓集团	102,200	899,360.00	0.04
103	688276	百克生物	31,500	893,655.00	0.04

104	002138	顺络电子	32,300	886,958.00	0.04
105	601139	深圳燃气	128,800	860,384.00	0.04
106	601827	三峰环境	100,200	850,698.00	0.04
107	002765	蓝黛科技	179,000	841,300.00	0.04
108	601728	中国电信	136,700	840,705.00	0.04
109	688348	昱能科技	13,751	811,309.00	0.03
110	300308	中际旭创	5,820	802,461.60	0.03
111	002466	天齐锂业	26,800	801,588.00	0.03
112	002594	比亚迪	3,200	800,800.00	0.03
113	300492	华图山鼎	8,500	800,700.00	0.03
114	002659	凯文教育	243,700	796,899.00	0.03
115	600348	华阳股份	79,700	793,812.00	0.03
116	300364	中文在线	36,700	791,986.00	0.03
117	688222	成都先导	69,100	784,285.00	0.03
118	603119	浙江荣泰	43,470	770,288.40	0.03
119	000922	佳电股份	62,800	749,204.00	0.03
120	000975	山金国际	42,700	695,583.00	0.03
121	688733	壹石通	46,300	692,185.00	0.03
122	688236	春立医疗	48,800	691,984.00	0.03
123	688028	沃尔德	42,000	690,060.00	0.03
124	688533	上声电子	26,000	672,620.00	0.03
125	601500	通用股份	125,600	670,704.00	0.03
126	603998	方盛制药	65,200	669,604.00	0.03
127	300433	蓝思科技	34,700	633,275.00	0.03
128	300383	光环新网	74,100	626,145.00	0.03
129	300430	诚益通	41,400	624,312.00	0.03
130	301187	欧圣电气	25,700	623,225.00	0.03
131	300630	普利制药	65,000	621,400.00	0.03
132	002668	TCL 智家	67,600	612,456.00	0.03
133	300972	万辰集团	28,600	604,318.00	0.03
134	600674	川投能源	31,000	581,250.00	0.02
135	600114	东睦股份	40,300	579,917.00	0.02
136	002371	北方华创	1,800	575,802.00	0.02
137	600582	天地科技	83,000	571,870.00	0.02
138	301109	军信股份	36,600	547,170.00	0.02
139	300636	同和药业	53,300	542,061.00	0.02
140	002979	雷赛智能	29,700	540,540.00	0.02
141	603516	淳中科技	17,100	539,847.00	0.02
142	002019	亿帆医药	43,400	536,424.00	0.02
143	300567	精测电子	9,400	531,194.00	0.02
144	301267	华夏眼科	25,500	528,360.00	0.02



145	002531	天顺风能	59,100	528,354.00	0.02
146	603496	恒为科技	21,500	525,675.00	0.02
147	688025	杰普特	12,900	521,031.00	0.02
148	002876	三利谱	20,700	499,284.00	0.02
149	301029	怡合达	25,200	495,432.00	0.02
150	300002	神州泰岳	59,500	483,140.00	0.02
151	688136	科兴制药	28,800	482,688.00	0.02
152	688369	致远互联	30,100	473,473.00	0.02
153	603596	伯特利	11,900	462,910.00	0.02
154	600060	海信视像	18,700	462,638.00	0.02
155	300349	金卡智能	38,600	460,112.00	0.02
156	603619	中曼石油	18,900	442,638.00	0.02
157	300445	康斯特	27,300	439,530.00	0.02
158	000408	藏格矿业	18,200	438,074.00	0.02
159	688195	腾景科技	17,700	433,827.00	0.02
160	605368	蓝天燃气	31,800	433,752.00	0.02
161	603379	三美股份	10,900	426,626.00	0.02
162	688080	映翰通	14,000	424,620.00	0.02
163	603882	金域医学	15,300	416,007.00	0.02
164	000921	海信家电	12,800	412,672.00	0.02
165	002984	森麒麟	17,100	411,939.00	0.02
166	301030	仕净科技	16,480	405,737.60	0.02
167	600760	中航沈飞	10,000	401,000.00	0.02
168	300577	开润股份	18,700	389,521.00	0.02
169	688114	华大智造	8,200	388,762.00	0.02
170	601600	中国铝业	50,300	383,789.00	0.02
171	300285	国瓷材料	21,500	383,775.00	0.02
172	002429	兆驰股份	79,100	380,471.00	0.02
173	600885	宏发股份	13,400	370,912.00	0.02
174	000999	华润三九	8,660	368,742.80	0.02
175	003816	中国广核	78,800	364,844.00	0.02
176	601965	中国汽研	21,600	364,824.00	0.02
177	000401	冀东水泥	88,800	360,528.00	0.02
178	600435	北方导航	41,600	358,592.00	0.02
179	603979	金诚信	7,000	353,710.00	0.02
180	000516	国际医学	73,100	342,108.00	0.01
181	002415	海康威视	11,000	340,010.00	0.01
182	688609	九联科技	38,000	335,160.00	0.01
183	002738	中矿资源	12,500	335,000.00	0.01
184	002497	雅化集团	37,100	330,932.00	0.01
185	603859	能科科技	15,688	329,761.76	0.01

186	603087	甘李药业	7,000	324,240.00	0.01
187	600522	中天科技	20,400	323,340.00	0.01
188	301168	通灵股份	11,200	311,136.00	0.01
189	688772	珠海冠宇	20,876	311,052.40	0.01
190	600873	梅花生物	30,300	303,606.00	0.01
191	300258	精锻科技	37,300	303,249.00	0.01
192	600566	济川药业	9,500	301,245.00	0.01
193	605555	德昌股份	16,100	299,621.00	0.01
194	600547	山东黄金	10,900	298,442.00	0.01
195	300559	佳发教育	31,100	297,627.00	0.01
196	002487	大金重工	13,000	297,440.00	0.01
197	601958	金钼股份	28,400	295,644.00	0.01
198	603806	福斯特	19,600	288,120.00	0.01
199	601717	郑煤机	19,400	287,120.00	0.01
200	600529	山东药玻	11,100	281,274.00	0.01
201	688252	天德钰	18,800	273,164.00	0.01
202	002532	天山铝业	32,700	265,197.00	0.01
203	300562	乐心医疗	29,400	261,954.00	0.01
204	002422	科伦药业	8,500	257,805.00	0.01
205	300498	温氏股份	12,700	251,714.00	0.01
206	601985	中国核电	23,500	250,510.00	0.01
207	603416	信捷电气	8,700	248,646.00	0.01
208	601156	东航物流	11,900	242,165.00	0.01
209	300653	正海生物	11,800	240,130.00	0.01
210	600487	亨通光电	14,800	233,396.00	0.01
211	603277	银都股份	7,600	228,304.00	0.01
212	300803	指南针	6,100	222,101.00	0.01
213	300607	拓斯达	16,000	217,920.00	0.01
214	600489	中金黄金	14,500	214,600.00	0.01
215	002436	兴森科技	20,600	212,592.00	0.01
216	003000	劲仔食品	16,100	194,005.00	0.01
217	301033	迈普医学	4,900	191,639.00	0.01
218	600377	宁沪高速	14,900	187,740.00	0.01
219	300001	特锐德	9,100	183,092.00	0.01
220	002803	吉宏股份	16,200	180,306.00	0.01
221	605007	五洲特纸	14,100	178,083.00	0.01
222	603507	振江股份	5,400	177,228.00	0.01
223	600988	赤峰黄金	10,800	176,472.00	0.01
224	600282	南钢股份	35,300	175,794.00	0.01
225	603883	老百姓	9,230	169,462.80	0.01
226	300842	帝科股份	4,320	167,616.00	0.01

227	001965	招商公路	13,400	158,924.00	0.01
228	600872	中炬高新	7,000	158,830.00	0.01
229	002223	鱼跃医疗	4,100	154,160.00	0.01
230	603610	麒盛科技	15,200	150,176.00	0.01
231	300760	迈瑞医疗	500	145,455.00	0.01
232	603179	新泉股份	3,700	145,188.00	0.01
233	000895	双汇发展	6,100	144,997.00	0.01
234	002001	新和成	6,981	134,035.20	0.01
235	002206	海利得	32,500	124,150.00	0.01
236	000338	潍柴动力	7,600	123,424.00	0.01
237	688489	三未信安	4,618	123,023.52	0.01
238	300054	鼎龙股份	5,100	115,668.00	0.00
239	601567	三星医疗	3,300	115,500.00	0.00
240	301165	锐捷网络	3,800	113,392.00	0.00
241	300529	健帆生物	4,100	111,561.00	0.00
242	688071	华依科技	5,020	108,783.40	0.00
243	300037	新宙邦	3,800	108,528.00	0.00
244	605060	联德股份	7,500	107,775.00	0.00
245	002595	豪迈科技	2,800	106,876.00	0.00
246	301257	普蕊斯	3,530	99,722.50	0.00
247	002881	美格智能	5,000	99,200.00	0.00
248	300316	晶盛机电	3,300	94,809.00	0.00
249	301377	鼎泰高科	5,200	91,260.00	0.00
250	688617	惠泰医疗	200	91,220.00	0.00
251	603916	苏博特	12,994	87,189.74	0.00
252	688768	容知日新	3,602	84,322.82	0.00
253	002615	哈尔斯	13,200	81,840.00	0.00
254	300005	探路者	16,100	80,661.00	0.00
255	688320	禾川科技	3,111	76,343.94	0.00
256	688078	龙软科技	2,802	64,530.06	0.00
257	300217	东方电热	15,500	58,435.00	0.00
258	605166	聚合顺	5,500	57,695.00	0.00
259	600887	伊利股份	1,900	49,096.00	0.00
260	600019	宝钢股份	7,200	47,880.00	0.00
261	301004	嘉益股份	500	45,500.00	0.00
262	300009	安科生物	5,200	44,408.00	0.00
263	002831	裕同科技	1,700	43,503.00	0.00
264	002064	华峰化学	6,000	43,020.00	0.00
265	000887	中鼎股份	3,500	42,840.00	0.00
266	600023	浙能电力	5,700	40,527.00	0.00
267	002938	鹏鼎控股	1,000	39,760.00	0.00

268	603195	公牛集团	510	39,331.20	0.00
269	600062	华润双鹤	1,800	35,244.00	0.00
270	688246	嘉和美康	1,605	32,677.80	0.00
271	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
272	300926	博俊科技	1,400	28,028.00	0.00
273	002201	正威新材	5,780	27,339.40	0.00
274	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
275	603725	天安新材	3,700	22,977.00	0.00
276	688170	德龙激光	1,026	22,592.52	0.00
277	688117	圣诺生物	600	14,724.00	0.00
278	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
279	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
280	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
281	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
282	300639	凯普生物	2,478	11,398.80	0.00
283	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
284	600284	浦东建设	1,994	10,647.96	0.00
285	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
286	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
287	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
288	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
289	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
290	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
291	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
292	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
293	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
294	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
295	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
296	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
297	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
298	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
299	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00

## 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	002152	广电运通	25,022,902.00	0.76
2	002139	拓邦股份	21,463,468.00	0.65
3	002249	大洋电机	20,462,682.10	0.62
4	600623	华谊集团	17,515,489.00	0.53

5	000100	TCL 科技	17,268,859.00	0.52
6	002498	汉缆股份	16,799,129.00	0.51
7	601766	中国中车	16,716,370.00	0.51
8	000902	新洋丰	16,595,815.00	0.50
9	002273	水晶光电	16,199,513.00	0.49
10	002053	云南能投	16,023,076.00	0.48
11	000725	京东方A	15,758,109.00	0.48
12	300182	捷成股份	15,220,860.00	0.46
13	600577	精达股份	14,434,489.00	0.44
14	300170	汉得信息	14,375,075.00	0.43
15	002291	遥望科技	14,200,494.00	0.43
16	600497	驰宏锌锗	14,031,036.00	0.42
17	603985	恒润股份	13,896,221.00	0.42
18	603583	捷昌驱动	13,838,197.00	0.42
19	600547	山东黄金	13,821,030.20	0.42
20	300432	富临精工	13,519,774.00	0.41

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	002130	沃尔核材	38,193,300.00	1.16
2	600489	中金黄金	28,742,515.00	0.87
3	001696	宗申动力	26,208,993.60	0.79
4	002085	万丰奥威	25,906,962.60	0.78
5	601212	白银有色	25,297,883.00	0.77
6	600312	平高电气	24,819,986.00	0.75
7	600572	康恩贝	23,770,063.00	0.72
8	300319	麦捷科技	22,523,026.42	0.68
9	603985	恒润股份	21,673,114.00	0.66
10	000338	潍柴动力	21,366,342.00	0.65
11	603920	世运电路	21,318,328.00	0.64
12	600285	羚锐制药	20,132,341.64	0.61
13	300457	赢合科技	19,891,361.42	0.60
14	600267	海正药业	19,590,113.00	0.59
15	000682	东方电子	19,034,143.05	0.58
16	600577	精达股份	18,738,882.10	0.57
17	002421	达实智能	18,315,825.00	0.55
18	300900	广联航空	18,253,757.09	0.55
19	002152	广电运通	17,476,641.00	0.53

20	300497	富祥药业	17,410,138.70	0.53
----	--------	------	---------------	------

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,460,563,414.23
卖出股票收入（成交）总额	4,185,942,728.82

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

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

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

##### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 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	24,922,057.36
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	1,286,797.12
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	26,208,854.48

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未持有流通受限的股票。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中未持有流通受限股票。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
富国中证 1000 指数增强 (LOF) A	90,431	9,482.52	396,774,497.63	46.27	460,739,590.73	53.73
富国中证 1000 指数增强 (LOF) C	28,711	20,254.67	472,066,285.67	81.18	109,465,556.21	18.82
合计	119,142	12,078.41	868,840,783.30	60.38	570,205,146.94	39.62

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

富国中证 1000 指数增强 (LOF) A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	廖昌清	1,170,483.00	5.88
2	付小珍	1,016,648.00	5.11
3	陈颖	688,322.00	3.46
4	熊振国	573,600.00	2.88
5	刘树航	481,890.00	2.42
6	陈实	403,094.00	2.03
7	李群	400,023.00	2.01
8	赵国义	373,200.00	1.88
9	李春	222,700.00	1.12
10	李宣科	219,700.00	1.10

### 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 1000 指数增强 (LOF) A	730,381.03	0.0852
	富国中证 1000 指数增强 (LOF) C	147,771.14	0.0254
	合计	878,152.17	0.0610



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

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资 和研究部门负责人持有本开放式 基金	富国中证 1000 指数 增强 (LOF) A	0~10
	富国中证 1000 指数 增强 (LOF) C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基 金	富国中证 1000 指数 增强 (LOF) A	10~50
	富国中证 1000 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 1000 指数增强 (LOF) A	富国中证 1000 指数增强 (LOF) C
基金合同生效日(2018 年 05 月 31 日)基金份额总额	512,114,043.76	—
报告期期初基金份额总额	1,016,344,929.26	800,555,533.30
本报告期基金总申购份额	153,045,780.81	564,457,698.93
减：本报告期基金总赎回份额	311,876,621.71	783,481,390.35
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	857,514,088.36	581,531,841.88

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	富国基金管理有限公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2024-02-02
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
受到的具体措施类型	责令改正
受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定及制度未严格执行。
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已完成整改。
其他	—
措施 2	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	督察长
受到稽查或处罚等措施的时间	2024-02-02
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
受到的具体措施类型	出具警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定及制度未严格执行。
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已完成整改。
其他	—

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：无

## 10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
德邦证券	1	—	—	—	—	—
东北证券	2	1,311,728.35	0.02	965.30	0.02	—
东方证券	4	635,361,771.18	8.31	467,559.83	8.31	—
国海证券	2	2,065,626,610.28	27.02	1,520,081.23	27.02	—
国联证券	1	428,708,256.77	5.61	315,491.07	5.61	—
国泰君安	2	437,633,327.16	5.72	322,059.41	5.72	—
国投证券	2	120,161,098.00	1.57	88,425.23	1.57	—
海通证券	1	704,513,031.76	9.22	518,456.50	9.22	—
华兴证券	1	—	—	—	—	—
汇丰前海	2	—	—	—	—	—
开源证券	4	258,254,595.21	3.38	190,051.54	3.38	—
申万宏源	4	530,611,200.82	6.94	390,476.44	6.94	—
兴业证券	2	353,538,833.09	4.62	260,182.58	4.62	—
浙商证券	1	152,769,244.07	2.00	112,422.48	2.00	—
中泰证券	1	342,356,562.14	4.48	251,934.05	4.48	—
中信建投	2	—	—	—	—	—
中信证券	3	1,614,254,089.32	21.11	1,187,938.05	21.11	—

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

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

德邦证券	—	—	—	—	—	—
东北证券	—	—	—	—	—	—
东方证券	—	—	—	—	—	—
国海证券	—	—	—	—	—	—
国联证券	—	—	—	—	—	—
国泰君安	—	—	—	—	—	—
国投证券	—	—	—	—	—	—
海通证券	—	—	—	—	—	—
华兴证券	—	—	—	—	—	—
汇丰前海	—	—	—	—	—	—
开源证券	—	—	—	—	—	—
申万宏源	—	—	—	—	—	—
兴业证券	—	—	—	—	—	—
浙商证券	—	—	—	—	—	—
中泰证券	—	—	—	—	—	—
中信建投	—	—	—	—	—	—
中信证券	288,142.64	100.00	—	—	—	—

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2024年03月14日
2	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2024年06月14日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2024-01-01 至 2024-06-30	395,433,223.18	—	—	395,433,223.18	27.48%

#### 产品特有风险

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。

## § 12 备查文件目录

备查文件名称	备查文件存放地点	备查文件查阅方式
1、中国证监会批准设立富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）的文件 2、富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同 3、富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）托管协议 4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件 5、富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）财务报表及报表附注 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费） 公司地址： <a href="http://www.fullgoal.com.cn">http://www.fullgoal.com.cn</a> 。