

富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金

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	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	8
§4	管理人报告	10
4.1	基金管理人及基金经理情况	10
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	13
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5	托管人报告	16
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
§6	中期财务报告（未经审计）	17
6.1	资产负债表	17
6.2	利润表	18
6.3	净资产（基金净值）变动表	19
6.4	报表附注	20
§7	投资组合报告	45
7.1	期末基金资产组合情况	45

7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	45
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.....	46
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	59
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	61
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.....	61
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.....	61
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.....	61
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.....	61
7.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	61
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	61
7.12	投资组合报告附注.....	62
§8	基金份额持有人信息.....	63
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	63
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	63
8.3	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.....	63
§9	开放式基金份额变动.....	64
§10	重大事件揭示.....	65
10.1	基金份额持有人大会决议.....	65
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.....	65
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	65
10.4	基金投资策略的改变.....	65
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	65
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.....	65
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	65
10.8	其他重大事件.....	69
§11	影响投资者决策的其他重要信息.....	70
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.....	70
§12	备查文件目录.....	71

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金
基金简称	富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强
基金主代码	006034
交易代码	006034
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 12 月 25 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	96,847,669.86 份
基金合同存续期	不定期

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 MSCI 中国 A 股国际通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 0.5%，年化跟踪误差不超过 8%。本基金的股票、存托凭证、债券、资产支持证券、金融衍生工具投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	95%×MSCI 中国 A 股国际通指数收益率+5%×银行人民币活期存款利率（税后）
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	北京市西城区金融大街

	区世纪大道 1196 号世纪汇 办公楼二座 27-30 层	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	上海证券报
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023年01月01日至2023年06月30日)
本期已实现收益	1,741,615.25
本期利润	5,022,222.03
加权平均基金份额本期利润	0.0440
本期加权平均净值利润率	2.30%
本期基金份额净值增长率	2.66%
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	85,982,209.81
期末可供分配基金份额利润	0.8878
期末基金资产净值	182,829,879.67
期末基金份额净值	1.8878
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	88.78%

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

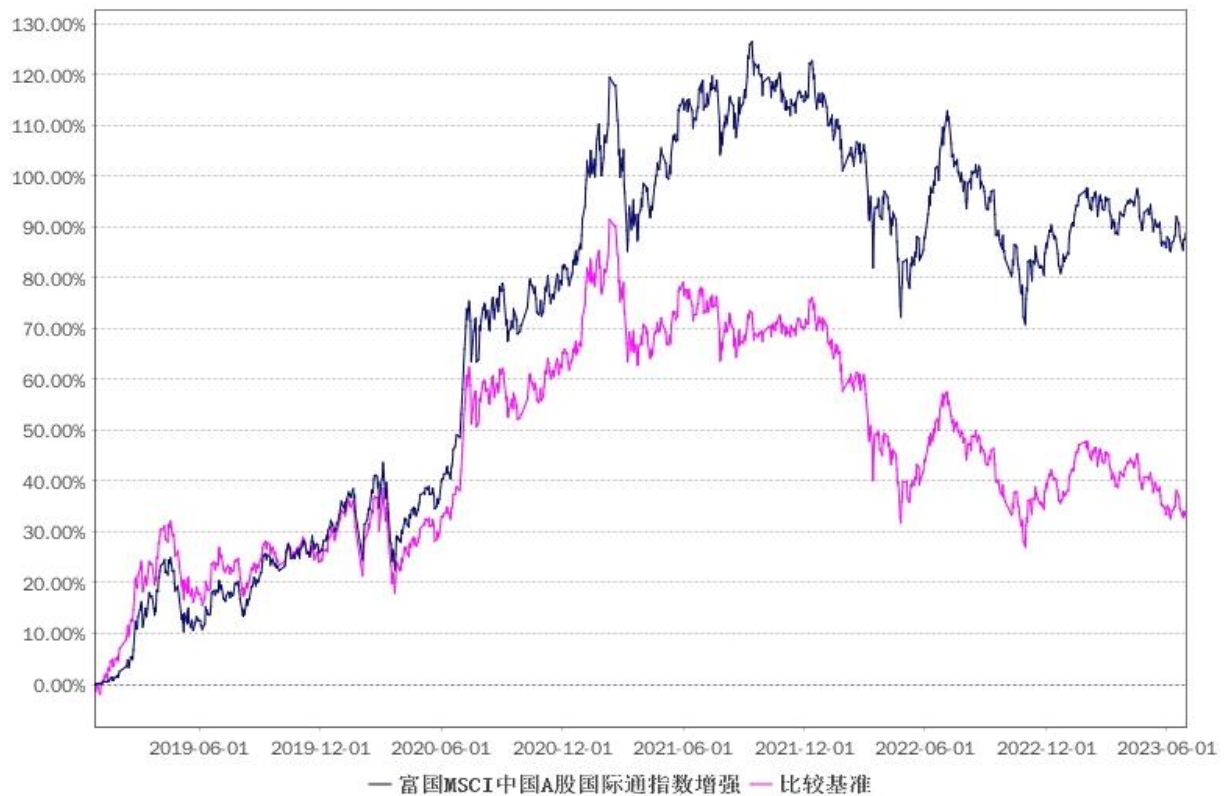
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.54%	0.74%	0.42%	0.82%	1.12%	-0.08%
过去三个月	-2.71%	0.69%	-6.02%	0.75%	3.31%	-0.06%
过去六个月	2.66%	0.70%	-2.55%	0.75%	5.21%	-0.05%
过去一年	-9.65%	0.87%	-14.63%	0.90%	4.98%	-0.03%
过去三年	25.23%	1.15%	-4.31%	1.13%	29.54%	0.02%

自基金合同生效起至今	88.78%	1.17%	33.95%	1.17%	54.83%	0.00%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

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



注：1、截止日期为2023年6月30日。

2、本基金于2018年12月25日成立，建仓期6个月，从2018年12月25日起至2019年6月24日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐幼华	本基金现任基金经理	2018-12-25	—	18	硕士，曾任上海京华创业投资有限公司投资部经理助理；自 2006 年 7 月加入富国基金管理有限公司，历任助理数量研究员、研究员、基金经理助理、基金经理、量化与海

					外投资部量化投资副总监，量化与海外投资部量化投资总监；现任富国基金量化投资部副总经理，兼任富国基金资深定量基金经理。自2011年05月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金基金经理；自2011年10月起任富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理；自2018年05月起任富国港股通量化精选股票型证券投资基金基金经理；自2018年05月起任富国中证1000指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理；自2018年07月起任富国大盘价值量化精选混合型证券投资基金基金经理；自2018年12月起任富国MSCI中国A股国际通指数增强型证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。
方旻	本基金现任基金经理	2019-01-07	—	13	硕士，自2010年2月加入富国基金管理有限公司，历任定量研究员、基金经理助理、基金经理、量化与海外投资部量化投资总监助理、高级定量基金经理、量化投资部量化投资副总监、量化投资部量化投资总监；现任富国基金量化投资部量化投资总监兼资深定量基金经理。自2014年11月起任富国沪深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 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金的管理人严格按照《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 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金基金合同》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，以为投资者减少和分散风险、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 24 次同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

分 TMT 公司涨幅过大，投资者选择获利了结，叠加人民币进一步贬值及节前避险情绪升温，A 股迎来调整。

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

在投资管理上，我们坚持采取量化策略进行投资和风险管理，积极获取超额收益率。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.8878 元；份额累计净值为 1.8878 元；本报告期，本基金份额净值增长率为 2.66%，同期业绩比较基准收益率为-2.55%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2023 下半年，积极因素正进一步累积，悲观预期将逐步修正。首先，外部的扰动将逐步缓解。当前市场已将 7 月美联储会议的加息预期较充分地计入，并且后续 8 月没有美联储议息会议的情况下，市场将阶段性进入鹰派信息的“空窗期”，来自美债利率上行、汇率贬值等外部压力已在缓和。其次，6 月份多项经济数据已经止跌企稳、甚至拐头向上，市场对于经济增长的悲观预期仍有望逐步修正。2 季度 GDP 数据虽略不及预期，但 6 月经济数据已经边际回暖。生产端，尽管工业增加值、服务业生产指数两年复合增速仍低于疫情前水平，但 5-6 月已出现持续改善。消费端，边际上居民收入改善，5-6 月商品消费加速。投资端，基建、制造业投资维持强势。近期各项经济政策也在密集加码落地，如促进家居消费若干措施、促民营经济、城中村改造等政策密集加码。此外，当前市场本身仍处在一个隐含风险溢价较高、多数行业拥挤度较低的位置，具备整体修复的空间。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金

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
资 产：		
银行存款	10,808,569.51	10,845,248.18
结算备付金	451,718.76	110,494.89
存出保证金	31,812.08	19,254.50
交易性金融资产	172,760,702.66	157,642,470.73
其中：股票投资	172,760,702.66	157,642,470.73
基金投资	—	—
债券投资	—	—
资产支持证券投资	—	—
贵金属投资	—	—
其他投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收清算款	9,611,605.90	134,913.22
应收股利	—	—
应收申购款	593,879.43	139,616.46
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	194,258,288.34	168,891,997.98
负债和净资产	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付清算款	—	—
应付赎回款	10,733,956.28	18,002.73
应付管理人报酬	165,646.31	154,956.45
应付托管费	24,846.95	23,243.46
应付销售服务费	—	—
应付投资顾问费	—	—
应交税费	—	0.43

应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	503,959.13	360,688.98
负债合计	11,428,408.67	556,892.05
净资产：		
实收基金	96,847,669.86	91,548,428.71
其他综合收益	—	—
未分配利润	85,982,209.81	76,786,677.22
净资产合计	182,829,879.67	168,335,105.93
负债和净资产总计	194,258,288.34	168,891,997.98

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.8878 元，基金份额总额 96,847,669.86 份。

6.2 利润表

会计主体：富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金

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)
一、营业总收入	6,415,290.84	-4,499,695.31
1.利息收入	39,891.36	25,769.60
其中：存款利息收入	39,891.36	25,769.60
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）	2,993,255.87	-11,472,180.17
其中：股票投资收益	583,307.54	-13,269,483.13
基金投资收益	—	—
债券投资收益	27,680.69	85,149.43
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	2,382,267.64	1,712,153.53
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）	3,280,606.78	6,900,224.17
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—

5.其他收入（损失以“-”号填列）	101,536.83	46,491.09
减：二、营业总支出	1,393,068.81	1,138,004.03
1. 管理人报酬	1,083,336.49	863,962.67
2. 托管费	162,500.51	129,594.39
3. 销售服务费	—	—
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	0.10	0.06
8. 其他费用	147,231.71	144,446.91
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	5,022,222.03	-5,637,699.34
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	5,022,222.03	-5,637,699.34
五、其他综合收益的税后净额	—	—
六、综合收益总额	5,022,222.03	-5,637,699.34

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金

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）	91,548,428.71	76,786,677.22	168,335,105.93
加：会计政策变更	—	—	—
二、本期期初净资产（基金净值）	91,548,428.71	76,786,677.22	168,335,105.93
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	5,299,241.15	9,195,532.59	14,494,773.74
（一）、综合收益总额	—	5,022,222.03	5,022,222.03
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	5,299,241.15	4,173,310.56	9,472,551.71
其中：1. 基金申购款	51,560,407.52	44,954,294.93	96,514,702.45
2. 基金赎回款	—	—	—
	46,261,166.37	40,780,984.37	-87,042,150.74
（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)	96,847,669.86	85,982,209.81	182,829,879.67
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)	93,960,909.57	108,880,724.30	202,841,633.87
加: 会计政策变更	—	—	—
二、本期期初净资产(基金净值)	93,960,909.57	108,880,724.30	202,841,633.87
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	2,000,136.85	-4,328,226.22	-2,328,089.37
(一)、综合收益总额	—	-5,637,699.34	-5,637,699.34
(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)	2,000,136.85	1,309,473.12	3,309,609.97
其中: 1.基金申购款	33,817,596.86	32,677,565.18	66,495,162.04
2.基金赎回款	—	-31,368,092.06	-63,185,552.07
31,817,460.01			
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	—	—	—
(四)、其他综合收益结转留存收益	—	—	—
四、本期期末净资产(基金净值)	95,961,046.42	104,552,498.08	200,513,544.50

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 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金(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]818 号文《关于准予富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金注册的批复》的核准,由基金管理人富国基金管理有限公司向社会公开发行募集。基金合同于 2018 年 12 月 25 日正式生效,首次设立募集规模为 227,607,631.34 份基金份

额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国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 MSCI 中国 A 股国际通指数的成份股、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、债券（包括国家债券、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）、中期票据等）、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）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。

本基金的投资组合比例为：本基金的股票及存托凭证资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于 MSCI 中国 A 股国际通指数成份股和备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于 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。如法律法规对该比例要求有变更的，在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

本基金业绩比较基准为： $95\% \times \text{MSCI 中国 A 股国际通指数收益率} + 5\% \times \text{银行人民币活期存款利率（税后）}$ 。

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	10,808,569.51
等于：本金	10,807,218.36
加：应计利息	1,351.15
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	10,808,569.51

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	177,327,465.83	—	172,760,702.66	—
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	177,327,465.83	—	172,760,702.66	—

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	40,431.73
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	243,852.69
其中：交易所市场	243,852.69
银行间市场	—
应付利息	—
预提信息披露费	60,000.00
预提审计费	54,364.21
应付指数使用费	105,310.50
合计	503,959.13

6.4.7.7实收基金

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	91,548,428.71	91,548,428.71
本期申购	51,560,407.52	51,560,407.52
本期赎回（以“-”号填列）	-46,261,166.37	-46,261,166.37
本期末	96,847,669.86	96,847,669.86

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

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	82,911,137.48	—	76,786,677.22
本期利润	1,741,615.25	3,280,606.78	5,022,222.03
本期基金份额交易产生的变动数	4,443,677.32	-270,366.76	4,173,310.56
其中：基金申购款	47,029,036.85	—	44,954,294.93
基金赎回款	—	2,074,741.92	—
	42,585,359.53	1,804,375.16	40,780,984.37
本期已分配利润	—	—	—
本期末	89,096,430.05	—	85,982,209.81
		3,114,220.24	

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	29,108.61
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	4,158.98
其他	6,623.77
合计	39,891.36

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	354,828,071.61
减：卖出股票成本总额	353,316,837.87
减：交易费用	927,926.20
买卖股票差价收入	583,307.54

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	273.17
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	27,407.52
合计	27,680.69

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01日至2023年06月30日）
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,686,493.28
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,617,670.00
减：应计利息总额	41,410.22
减：交易费用	5.54
债券投资收益-差价收入	27,407.52

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	2,382,267.64
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	2,382,267.64

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	3,280,606.78
股票投资	3,280,606.78
债券投资	—
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	3,280,606.78

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	101,183.60
基金转换费收入	353.23

合计	101,536.83
----	------------

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	16,364.21
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	380.00
指数使用费	70,487.50
合计	147,231.71

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
申万宏源证券承销保荐有限责任公司	基金管理人的股东控制的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（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	86,197,652.23	12.05	76,033,262.11	20.85
申万宏源	93,318,899.29	13.04	59,941,472.42	16.44

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	39,970.07	0.44	—	—

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	62,171.76	12.05	15,863.29	6.51
申万宏源	67,312.53	13.04	54,697.21	22.43
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	54,987.08	16.47	40,620.95	21.08
海通证券	69,820.07	20.92	53,360.81	27.69

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	1,083,336.49	863,962.67
其中：支付销售机构的客户维护费	192,942.33	135,685.59

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.00%的年费率计提。

计算方法如下： $H=E \times 1.00\% / \text{当年天数}$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2023年01月01 日至2023年06月30 日）	上年度可比期间（2022年01 月01日至2022年06月30 日）
当期发生的基金应支付的托管费	162,500.51	129,594.39

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率计提。托管费的计

算方法如下：

$H=E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.3 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

注：本报告期内及上年度可比期间内本基金的基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

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	10,808,569.51	29,108.61	16,207,196.13	22,767.62

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（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	688469	中芯集成	IPO网下申购	23,528	133,874.32
海通证券股份有限公司	688515	裕太微	IPO网下申购	1,016	93,939.36
海通证券股份有限公司	688531	日联科技	IPO网下申购	750	114,285.00

金额单位：人民币元

上年度可比期间（2022年01月01日至2022年06月30日）					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
申万宏源证券承销保荐有限责任公司	688267	中触媒	IPO网下申购	834	35,119.32
海通证券股份有限公司	688062	迈威生物	IPO网下申购	4,527	158,327.30
海通证券股份有限公司	688220	翱捷科技	IPO网下申购	1,047	173,134.75

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001282	三联锻造	2023-05-15	6个月	新股限售	27.93	33.03	91	2,541.63	3,005.73	—
001286	陕西能源	2023-03-31	6个月	新股限售	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	—
001287	中电港	2023-03-30	6个月	新股限售	11.88	21.02	327	3,884.76	6,873.54	—
001324	长青科技	2023-05-12	6个月	新股限售	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	—
001360	南矿集团	2023-03-31	6个月	新股限售	15.38	14.87	138	2,122.44	2,052.06	—

001380	华纬科技	2023-05-09	6个月	新股限售	28.84	30.78	100	2,884.00	3,078.00	—
300804	广康生化	2023-06-15	6个月	新股限售	42.45	32.97	185	7,853.25	6,099.45	—
301170	锡南科技	2023-06-16	6个月	新股限售	34.00	34.93	156	5,304.00	5,449.08	—
301202	朗威股份	2023-06-28	1个月内 (含)	新股认购	25.82	25.82	1,748	45,133.36	45,133.36	—
301202	朗威股份	2023-06-28	6个月	新股限售	25.82	25.82	195	5,034.90	5,034.90	—
301203	国泰环保	2023-03-28	6个月	新股限售	46.13	34.40	172	7,934.36	5,916.80	—
301225	恒勃股份	2023-06-08	6个月	新股限售	35.66	33.26	204	7,274.64	6,785.04	—
301246	宏源药业	2023-03-10	6个月	新股限售	50.00	30.71	248	12,400.00	7,616.08	—
301261	恒工精密	2023-06-29	1个月内 (含)	新股认购	36.90	36.90	1,192	43,984.80	43,984.80	—
301261	恒工精密	2023-06-29	6个月	新股限售	36.90	36.90	133	4,907.70	4,907.70	—
301262	海看股份	2023-06-13	6个月	新股限售	30.22	25.50	286	8,642.92	7,293.00	—
301281	科源制药	2023-03-28	6个月	新股限售	44.18	25.10	143	6,317.74	3,589.30	—
301281	科源制药	2023-05-26	5个月	新股限售_转增	—	25.10	57	—	1,430.70	—
301293	三博脑科	2023-04-25	6个月	新股限售	29.60	71.42	200	5,920.00	14,284.00	—
301303	真兰仪表	2023-02-13	6个月	新股限售	26.80	22.32	408	10,934.40	9,106.56	—
301315	威士顿	2023-06-13	6个月	新股限售	32.29	51.12	183	5,909.07	9,354.96	—
301317	鑫磊股份	2023-01-12	6个月	新股限售	20.67	26.17	443	9,156.81	11,593.31	—
301322	绿通科技	2023-02-27	6个月	新股限售	131.11	53.24	72	9,439.92	3,833.28	—
301322	绿通科技	2023-05-25	4个月	新股限售_转增	—	53.24	36	—	1,916.64	—
301323	新莱福	2023-05-29	6个月	新股限售	39.06	39.36	134	5,234.04	5,274.24	—
301332	德尔玛	2023-05-09	6个月	新股限售	14.81	13.73	505	7,479.05	6,933.65	—
301337	亚华电子	2023-05-16	6个月	新股限售	32.60	30.37	174	5,672.40	5,284.38	—
301345	涛涛车业	2023-03-10	6个月	新股限售	73.45	46.64	80	5,876.00	3,731.20	—
301357	北方长龙	2023-04-11	6个月	新股限售	50.00	48.39	124	6,200.00	6,000.36	—
301358	湖南裕能	2023-02-01	6个月	新股限售	23.77	42.89	313	7,440.01	13,424.57	—
301376	致欧科技	2023-06-14	6个月	新股限售	24.66	22.51	255	6,288.30	5,740.05	—
301386	未来电器	2023-03-21	6个月	新股限售	29.99	23.79	234	7,017.66	5,566.86	—
301387	光大同创	2023-04-10	6个月	新股限售	58.32	45.36	165	9,622.80	7,484.40	—
301395	仁信新材	2023-06-21	1个月内 (含)	新股认购	26.68	26.68	2,376	63,391.68	63,391.68	—
301395	仁信新材	2023-06-21	6个月	新股限售	26.68	26.68	265	7,070.20	7,070.20	—
301397	溯联股份	2023-06-15	6个月	新股限售	53.27	40.20	122	6,498.94	4,904.40	—
301408	华人健康	2023-02-22	6个月	新股限售	16.24	16.95	528	8,574.72	8,949.60	—
301486	致尚科技	2023-06-30	1个月内 (含)	新股认购	57.66	57.66	1,143	65,905.38	65,905.38	—
301486	致尚科技	2023-06-30	6个月	新股限售	57.66	57.66	127	7,322.82	7,322.82	—
301488	豪恩汽电	2023-06-26	1个月内 (含)	新股认购	39.78	39.78	1,683	66,949.74	66,949.74	—

301488	豪恩汽电	2023-06-26	6个月	新股限售	39.78	39.78	187	7,438.86	7,438.86	—
601065	江盐集团	2023-03-31	6个月	新股限售	10.36	11.84	228	2,362.08	2,699.52	—
603125	常青科技	2023-03-30	6个月	新股限售	25.98	24.53	79	2,052.42	1,937.87	—
688249	晶合集成	2023-04-24	6个月	新股限售	19.86	18.06	1,160	23,037.60	20,949.60	—
688352	硕中科技	2023-04-11	6个月	新股限售	12.10	12.07	618	7,477.80	7,459.26	—
688361	中科飞测	2023-05-12	6个月	新股限售	23.60	64.67	223	5,262.80	14,421.41	—
688429	时创能源	2023-06-20	6个月	新股限售	19.20	25.53	249	4,780.80	6,356.97	—
688458	美芯晟	2023-05-15	6个月	新股限售	75.00	90.76	74	5,550.00	6,716.24	—
688469	中芯集成	2023-04-28	6个月	新股限售	5.69	5.41	2,353	13,388.57	12,729.73	—
688472	阿特斯	2023-06-02	6个月	新股限售	11.10	17.04	766	8,502.60	13,052.64	—
688479	友车科技	2023-05-04	6个月	新股限售	33.99	29.49	141	4,792.59	4,158.09	—
688484	南芯科技	2023-03-28	6个月	新股限售	39.99	36.71	206	8,237.94	7,562.26	—
688523	航天环宇	2023-05-26	6个月	新股限售	21.86	23.85	336	7,344.96	8,013.60	—
688531	日联科技	2023-03-24	6个月	新股限售	152.38	135.97	75	11,428.50	10,197.75	—
688535	华海诚科	2023-03-28	6个月	新股限售	35.00	51.23	134	4,690.00	6,864.82	—
688543	国科军工	2023-06-14	6个月	新股限售	43.67	53.05	137	5,982.79	7,267.85	—
688576	西山科技	2023-05-30	6个月	新股限售	135.80	120.41	75	10,185.00	9,030.75	—
688581	安杰思	2023-05-12	6个月	新股限售	125.80	118.03	50	6,290.00	5,901.50	—
688593	新相微	2023-05-25	6个月	新股限售	11.18	14.59	623	6,965.14	9,089.57	—
688603	天承科技	2023-06-30	1个月内 (含)	新股认购	55.00	55.00	970	53,350.00	53,350.00	—
688603	天承科技	2023-06-30	6个月	新股限售	55.00	55.00	108	5,940.00	5,940.00	—
688623	二元科技	2023-05-31	6个月	新股限售	125.88	86.79	52	6,545.76	4,513.08	—
688631	莱斯信息	2023-06-19	6个月	新股限售	25.28	29.87	171	4,322.88	5,107.77	—

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，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

单位：人民币元

本期末（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	10,808,569.51	—	—	—	—	—	10,808,569.51
结算备付金	451,718.76	—	—	—	—	—	451,718.76
存出保证金	31,812.08	—	—	—	—	—	31,812.08
交易性金融资产	—	—	—	—	—	172,760,702.66	172,760,702.66
应收清算款	—	—	—	—	—	9,611,605.90	9,611,605.90
应收申购款	2,555.30	—	—	—	—	591,324.13	593,879.43
资产总计	11,294,655.65	—	—	—	—	182,963,632.69	194,258,288.34
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	10,733,956.28	10,733,956.28
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	165,646.31	165,646.31
应付托管费	—	—	—	—	—	24,846.95	24,846.95
其他负债	—	—	—	—	—	503,959.13	503,959.13
负债总计	—	—	—	—	—	11,428,408.67	11,428,408.67
利率敏感度缺口	11,294,655.65	—	—	—	—	171,535,224.02	182,829,879.67
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	10,845,248.18	—	—	—	—	—	10,845,248.18
结算备付金	110,494.89	—	—	—	—	—	110,494.89
存出保证金	19,254.50	—	—	—	—	—	19,254.50

交易性金融资产	—	—	—	—	—	157,642,470.73	157,642,470.73
应收清算款	—	—	—	—	—	134,913.22	134,913.22
应收申购款	16,242.00	—	—	—	—	123,374.46	139,616.46
资产总计	10,991,239.57	—	—	—	—	157,900,758.41	168,891,997.98
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	18,002.73	18,002.73
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	154,956.45	154,956.45
应付托管费	—	—	—	—	—	23,243.46	23,243.46
应交税费	—	—	—	—	—	0.43	0.43
其他负债	—	—	—	—	—	360,688.98	360,688.98
负债总计	—	—	—	—	—	556,892.05	556,892.05
利率敏感度缺口	10,991,239.57	—	—	—	—	157,343,866.36	168,335,105.93

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末及上年度末均未持有债券资产（不含可转债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括 MSCI 中国 A 股国际通指数的成份股、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、债券（包括国家债券、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）、中期票据等）、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）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占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于 MSCI 中国 A 股国际通指数成份股和备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于 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（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	172,760,702.66	94.49	157,642,470.73	93.65
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
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	172,760,702.66	94.49	157,642,470.73	93.65

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。		
	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. 业绩比较基准增加 1%	1,660,542.83	1,653,000.88
	2. 业绩比较基准减少 1%	-1,660,542.83	-1,653,000.88

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	171,999,989.83	157,248,099.47
第二层次	376,429.44	157,092.00
第三层次	384,283.39	237,279.26
合计	172,760,702.66	157,642,470.73

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	172,760,702.66	88.93
	其中：股票	172,760,702.66	88.93
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	11,260,288.27	5.80
8	其他各项资产	10,237,297.41	5.27
9	合计	194,258,288.34	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	98,800.00	0.05
B	采矿业	926,010.00	0.51
C	制造业	17,176,090.59	9.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,136,480.47	0.62
E	建筑业	48,708.00	0.03
F	批发和零售业	677,111.19	0.37
G	交通运输、仓储和邮政业	137,252.00	0.08
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,056,409.66	1.67
J	金融业	1,589,155.00	0.87
K	房地产业	3,022.00	0.00
L	租赁和商务服务业	6,960.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	303,231.00	0.17

N	水利、环境和公共设施管理业	72,576.80	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	298,284.00	0.16
Q	卫生和社会工作	14,284.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	1,207,748.00	0.66
S	综合	—	—
	合计	26,752,122.71	14.63

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	401,759.00	0.22
B	采矿业	6,224,256.00	3.40
C	制造业	88,692,509.29	48.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,716,397.00	1.49
E	建筑业	3,526,837.00	1.93
F	批发和零售业	2,680,132.18	1.47
G	交通运输、仓储和邮政业	3,827,165.00	2.09
H	住宿和餐饮业	185,797.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,477,320.43	4.09
J	金融业	27,140,862.50	14.84
K	房地产业	1,148,821.00	0.63
L	租赁和商务服务业	1,189,026.00	0.65
M	科学研究和技术服务业	32,270.00	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	46,060.00	0.03
Q	卫生和社会工作	503,094.55	0.28
R	文化、体育和娱乐业	216,273.00	0.12
S	综合	—	—
	合计	146,008,579.95	79.86

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	600519	贵州茅台	5,800	9,807,800.00	5.36
2	000858	五粮液	22,600	3,696,682.00	2.02
3	300750	宁德时代	11,760	2,690,570.40	1.47

4	601766	中国中车	362,800	2,358,200.00	1.29
5	000538	云南白药	41,340	2,169,523.20	1.19
6	000338	潍柴动力	156,200	1,946,252.00	1.06
7	600406	国电南瑞	84,160	1,944,096.00	1.06
8	000725	京东方A	475,100	1,943,159.00	1.06
9	300760	迈瑞医疗	6,400	1,918,720.00	1.05
10	601012	隆基绿能	65,500	1,877,885.00	1.03
11	600276	恒瑞医药	38,680	1,852,772.00	1.01
12	601318	中国平安	38,800	1,800,320.00	0.98
13	600104	上汽集团	121,800	1,725,906.00	0.94
14	601607	上海医药	74,100	1,660,581.00	0.91
15	600919	江苏银行	224,570	1,650,589.50	0.90
16	601600	中国铝业	297,200	1,631,628.00	0.89
17	601211	国泰君安	113,700	1,590,663.00	0.87
18	603993	洛阳钼业	296,800	1,581,944.00	0.87
19	600000	浦发银行	214,500	1,552,980.00	0.85
20	601088	中国神华	49,500	1,522,125.00	0.83
21	000651	格力电器	39,900	1,456,749.00	0.80
22	601319	中国人保	246,200	1,437,808.00	0.79
23	600015	华夏银行	258,600	1,399,026.00	0.77
24	600690	海尔智家	55,400	1,300,792.00	0.71
25	002736	国信证券	148,000	1,292,040.00	0.71
26	600885	宏发股份	39,600	1,261,260.00	0.69
27	601818	光大银行	395,500	1,214,185.00	0.66
28	002304	洋河股份	9,100	1,195,285.00	0.65
29	002027	分众传媒	174,600	1,189,026.00	0.65
30	300059	东方财富	82,760	1,175,192.00	0.64
31	601877	正泰电器	42,300	1,169,595.00	0.64
32	601668	中国建筑	199,000	1,142,260.00	0.62
33	601229	上海银行	193,800	1,114,350.00	0.61
34	002600	领益智造	159,600	1,102,836.00	0.60
35	601006	大秦铁路	146,900	1,091,467.00	0.60
36	603369	今世缘	20,500	1,082,400.00	0.59
37	600036	招商银行	32,000	1,048,320.00	0.57
38	601398	工商银行	215,300	1,037,746.00	0.57
39	300003	乐普医疗	45,161	1,021,090.21	0.56
40	600050	中国联通	210,900	1,012,320.00	0.55
41	002594	比亚迪	3,900	1,007,253.00	0.55
42	600887	伊利股份	35,300	999,696.00	0.55
43	600018	上港集团	189,500	994,875.00	0.54
44	300124	汇川技术	15,400	988,834.00	0.54

45	601658	邮储银行	200,600	980,934.00	0.54
46	600999	招商证券	71,900	975,683.00	0.53
47	601618	中国中冶	243,200	965,504.00	0.53
48	600660	福耀玻璃	26,800	960,780.00	0.53
49	600741	华域汽车	51,460	949,951.60	0.52
50	600219	南山铝业	314,500	949,790.00	0.52
51	601138	工业富联	36,400	917,280.00	0.50
52	002202	金风科技	85,900	912,258.00	0.50
53	300433	蓝思科技	77,271	908,706.96	0.50
54	600309	万华化学	10,300	904,752.00	0.49
55	000895	双汇发展	36,600	896,334.00	0.49
56	688396	华润微	16,819	881,483.79	0.48
57	002475	立讯精密	26,600	863,170.00	0.47
58	000596	古井贡酒	3,400	841,092.00	0.46
59	600900	长江电力	37,600	829,456.00	0.45
60	000063	中兴通讯	17,700	806,058.00	0.44
61	688009	中国通号	138,730	804,634.00	0.44
62	688111	金山办公	1,700	802,774.00	0.44
63	601328	交通银行	137,800	799,240.00	0.44
64	000001	平安银行	71,000	797,330.00	0.44
65	002128	电投能源	58,200	769,404.00	0.42
66	601601	中国太保	28,800	748,224.00	0.41
67	000800	一汽解放	88,700	742,419.00	0.41
68	300142	沃森生物	28,000	740,600.00	0.41
69	600884	杉杉股份	46,900	710,066.00	0.39
70	000157	中联重科	104,400	704,700.00	0.39
71	600039	四川路桥	70,800	694,548.00	0.38
72	600362	江西铜业	35,400	671,892.00	0.37
73	600016	民生银行	176,600	662,250.00	0.36
74	300207	欣旺达	38,900	634,848.00	0.35
75	600332	白云山	19,400	618,472.00	0.34
76	600177	雅戈尔	97,900	617,749.00	0.34
77	300014	亿纬锂能	10,200	617,100.00	0.34
78	601688	华泰证券	44,700	615,519.00	0.34
79	601169	北京银行	128,800	596,344.00	0.33
80	002384	东山精密	22,100	572,390.00	0.31
81	601216	君正集团	139,600	572,360.00	0.31
82	600998	九州通	54,731	568,107.78	0.31
83	300661	圣邦股份	6,890	565,875.70	0.31
84	603799	华友钴业	11,900	546,329.00	0.30
85	002938	鹏鼎控股	22,200	539,238.00	0.29

86	688126	沪硅产业	25,800	539,220.00	0.29
87	002230	科大讯飞	7,800	530,088.00	0.29
88	600031	三一重工	31,300	520,519.00	0.28
89	601168	西部矿业	49,200	517,092.00	0.28
90	600436	片仔癀	1,800	515,448.00	0.28
91	002074	国轩高科	18,600	513,732.00	0.28
92	600030	中信证券	25,600	506,368.00	0.28
93	600848	上海临港	42,300	505,485.00	0.28
94	000027	深圳能源	76,600	504,794.00	0.28
95	002049	紫光国微	5,400	503,550.00	0.28
96	300015	爱尔眼科	27,121	503,094.55	0.28
97	600875	东方电气	26,500	494,225.00	0.27
98	600380	健康元	38,300	486,793.00	0.27
99	600845	宝信软件	9,334	474,260.54	0.26
100	000630	铜陵有色	162,000	468,180.00	0.26
101	000513	丽珠集团	11,900	463,029.00	0.25
102	600438	通威股份	13,200	452,892.00	0.25
103	601899	紫金矿业	39,100	444,567.00	0.24
104	002340	格林美	62,300	430,493.00	0.24
105	002180	纳思达	12,487	427,679.75	0.23
106	000100	TCL 科技	107,770	424,613.80	0.23
107	600926	杭州银行	35,800	420,650.00	0.23
108	688599	天合光能	9,604	409,226.44	0.22
109	002152	广电运通	34,700	406,684.00	0.22
110	002422	科伦药业	13,600	403,648.00	0.22
111	601615	明阳智能	23,300	393,304.00	0.22
112	688777	中控技术	6,090	382,330.20	0.21
113	601108	财通证券	51,800	375,032.00	0.21
114	601231	环旭电子	24,800	371,008.00	0.20
115	600009	上海机场	8,000	363,360.00	0.20
116	601727	上海电气	79,300	362,401.00	0.20
117	601166	兴业银行	22,800	356,820.00	0.20
118	600028	中国石化	54,900	349,164.00	0.19
119	600570	恒生电子	7,800	345,462.00	0.19
120	601816	京沪高铁	65,300	343,478.00	0.19
121	601336	新华保险	9,300	341,961.00	0.19
122	600547	山东黄金	14,500	340,460.00	0.19
123	600905	三峡能源	63,400	340,458.00	0.19
124	002065	东华软件	47,500	335,350.00	0.18
125	000938	紫光股份	10,200	324,870.00	0.18
126	002371	北方华创	1,000	317,650.00	0.17

127	600011	华能国际	33,700	312,062.00	0.17
128	600598	北大荒	23,300	310,589.00	0.17
129	300308	中际旭创	2,100	309,645.00	0.17
130	002500	山西证券	54,400	303,552.00	0.17
131	601360	三六零	23,200	290,928.00	0.16
132	601825	沪农商行	53,100	289,395.00	0.16
133	603986	兆易创新	2,700	286,875.00	0.16
134	600699	均胜电子	15,500	273,420.00	0.15
135	601985	中国核电	38,500	271,425.00	0.15
136	002465	海格通信	25,800	266,772.00	0.15
137	002030	达安基因	26,700	266,199.00	0.15
138	300033	同花顺	1,500	262,920.00	0.14
139	300628	亿联网络	7,440	260,920.80	0.14
140	601669	中国电建	45,400	260,596.00	0.14
141	600989	宝丰能源	20,600	259,766.00	0.14
142	002459	晶澳科技	6,196	258,373.20	0.14
143	603858	步长制药	12,200	251,198.00	0.14
144	300763	锦浪科技	2,400	249,840.00	0.14
145	300454	深信服	2,200	249,150.00	0.14
146	300316	晶盛机电	3,500	248,150.00	0.14
147	600115	中国东航	52,100	247,996.00	0.14
148	300751	迈为股份	1,440	243,907.20	0.13
149	000776	广发证券	16,500	242,715.00	0.13
150	600583	海油工程	41,400	242,190.00	0.13
151	605117	德业股份	1,600	239,280.00	0.13
152	601288	农业银行	67,000	236,510.00	0.13
153	000425	徐工机械	34,400	232,888.00	0.13
154	000568	泸州老窖	1,100	230,527.00	0.13
155	600089	特变电工	10,300	229,587.00	0.13
156	603688	石英股份	2,000	227,680.00	0.12
157	601111	中国国航	27,500	226,600.00	0.12
158	000408	藏格矿业	9,800	221,186.00	0.12
159	600803	新奥股份	11,600	220,168.00	0.12
160	600096	云天化	12,800	218,496.00	0.12
161	000933	神火股份	16,800	218,400.00	0.12
162	601021	春秋航空	3,800	218,386.00	0.12
163	002568	百润股份	6,000	218,100.00	0.12
164	300122	智飞生物	4,900	216,580.00	0.12
165	603939	益丰药房	5,760	213,120.00	0.12
166	002966	苏州银行	32,500	212,875.00	0.12
167	603529	爱玛科技	6,600	212,652.00	0.12

168	002244	滨江集团	23,900	210,798.00	0.12
169	601699	潞安环能	12,900	210,528.00	0.12
170	601868	中国能建	89,100	208,494.00	0.11
171	002236	大华股份	10,500	207,375.00	0.11
172	603233	大参林	7,340	205,593.40	0.11
173	688779	长远锂科	18,186	204,956.22	0.11
174	002156	通富微电	9,000	203,400.00	0.11
175	603218	日月股份	10,700	203,193.00	0.11
176	002268	电科网安	7,100	197,877.00	0.11
177	603392	万泰生物	2,948	196,837.96	0.11
178	600029	南方航空	32,600	196,578.00	0.11
179	600048	保利发展	14,900	194,147.00	0.11
180	600061	国投资本	27,100	192,952.00	0.11
181	002555	三七互娱	5,400	188,352.00	0.10
182	688256	寒武纪	1,000	188,000.00	0.10
183	603589	口子窖	3,800	187,530.00	0.10
184	688390	固德威	1,120	186,883.20	0.10
185	002797	第一创业	32,300	184,756.00	0.10
186	002603	以岭药业	7,100	182,399.00	0.10
187	002078	太阳纸业	16,700	178,523.00	0.10
188	688008	澜起科技	3,000	172,260.00	0.09
189	002185	华天科技	18,600	171,120.00	0.09
190	600183	生益科技	11,900	168,980.00	0.09
191	600566	济川药业	5,800	168,432.00	0.09
192	600038	中直股份	4,200	167,244.00	0.09
193	000069	华侨城A	37,300	164,120.00	0.09
194	603185	弘元绿能	2,200	164,010.00	0.09
195	601390	中国中铁	21,600	163,728.00	0.09
196	603659	璞泰来	4,230	161,670.60	0.09
197	300408	三环集团	5,500	161,425.00	0.09
198	002241	歌尔股份	8,800	156,200.00	0.09
199	002673	西部证券	24,400	154,940.00	0.08
200	600809	山西汾酒	800	148,056.00	0.08
201	600588	用友网络	7,200	147,600.00	0.08
202	300832	新产业	2,500	147,500.00	0.08
203	688187	时代电气	3,491	146,133.26	0.08
204	601225	陕西煤业	8,000	145,520.00	0.08
205	000625	长安汽车	10,500	135,765.00	0.07
206	600426	华鲁恒升	4,400	134,772.00	0.07
207	600688	上海石化	42,300	131,553.00	0.07
208	600258	首旅酒店	6,900	130,755.00	0.07

209	601838	成都银行	10,500	128,205.00	0.07
210	300395	菲利华	2,600	127,920.00	0.07
211	002032	苏泊尔	2,500	125,000.00	0.07
212	600346	恒力石化	8,700	124,671.00	0.07
213	603345	安井食品	800	117,440.00	0.06
214	000977	浪潮信息	2,400	116,400.00	0.06
215	300357	我武生物	3,400	114,342.00	0.06
216	603613	国联股份	3,076	113,596.68	0.06
217	600563	法拉电子	800	109,840.00	0.06
218	000738	航发控制	4,500	109,800.00	0.06
219	603290	斯达半导	500	107,600.00	0.06
220	600886	国投电力	8,400	106,260.00	0.06
221	300699	光威复材	3,440	106,124.00	0.06
222	300413	芒果超媒	3,100	106,051.00	0.06
223	600023	浙能电力	20,200	102,414.00	0.06
224	600893	航发动力	2,400	101,424.00	0.06
225	600487	亨通光电	6,900	101,154.00	0.06
226	000876	新希望	8,600	100,448.00	0.05
227	000066	中国长城	7,200	99,576.00	0.05
228	600161	天坛生物	3,500	95,025.00	0.05
229	002176	江特电机	7,900	94,168.00	0.05
230	688180	君实生物	2,400	92,496.00	0.05
231	002518	科士达	2,300	92,023.00	0.05
232	600369	西南证券	24,300	88,695.00	0.05
233	603707	健友股份	6,520	88,020.00	0.05
234	002602	世纪华通	11,200	85,008.00	0.05
235	002352	顺丰控股	1,800	81,162.00	0.04
236	688385	复旦微电	1,500	75,150.00	0.04
237	002926	华西证券	9,000	74,790.00	0.04
238	001979	招商蛇口	5,700	74,271.00	0.04
239	000729	燕京啤酒	5,700	71,079.00	0.04
240	600196	复星医药	2,300	71,070.00	0.04
241	600019	宝钢股份	11,500	64,630.00	0.04
242	603885	吉祥航空	4,100	63,263.00	0.03
243	300251	光线传媒	7,800	63,102.00	0.03
244	601009	南京银行	7,800	62,400.00	0.03
245	600600	青岛啤酒	600	62,178.00	0.03
246	002064	华峰化学	9,000	61,740.00	0.03
247	000987	越秀资本	9,100	57,785.00	0.03
248	603866	桃李面包	5,700	57,684.00	0.03
249	002299	圣农发展	3,000	57,450.00	0.03

250	300999	金龙鱼	1,400	55,986.00	0.03
251	600754	锦江酒店	1,300	55,042.00	0.03
252	601377	兴业证券	8,800	53,856.00	0.03
253	002405	四维图新	4,600	53,268.00	0.03
254	601117	中国化学	6,300	52,164.00	0.03
255	000937	冀中能源	8,100	51,678.00	0.03
256	000830	鲁西化工	4,700	49,632.00	0.03
257	600489	中金黄金	4,800	49,584.00	0.03
258	688002	睿创微纳	1,100	49,280.00	0.03
259	688728	格科微	3,000	47,460.00	0.03
260	300144	宋城演艺	3,800	47,120.00	0.03
261	002607	中公教育	9,800	46,060.00	0.03
262	600549	厦门钨业	2,400	45,672.00	0.02
263	601198	东兴证券	5,500	44,110.00	0.02
264	002056	横店东磁	2,400	43,704.00	0.02
265	002294	信立泰	1,400	43,666.00	0.02
266	300529	健帆生物	1,800	41,724.00	0.02
267	002223	鱼跃医疗	1,100	39,589.00	0.02
268	600170	上海建工	14,700	39,543.00	0.02
269	002138	顺络电子	1,600	38,256.00	0.02
270	000783	长江证券	6,400	37,120.00	0.02
271	600522	中天科技	2,200	35,002.00	0.02
272	002714	牧原股份	800	33,720.00	0.02
273	688561	奇安信-U	641	33,210.21	0.02
274	600153	建发股份	3,000	32,730.00	0.02
275	300347	泰格医药	500	32,270.00	0.02
276	600536	中国软件	660	30,940.80	0.02
277	601016	节能风电	8,000	29,360.00	0.02
278	603338	浙江鼎力	500	28,005.00	0.02
279	300418	昆仑万维	600	24,168.00	0.01
280	002129	TCL 中环	725	24,070.00	0.01
281	601878	浙商证券	2,400	23,712.00	0.01
282	002624	完美世界	1,400	23,646.00	0.01
283	600584	长电科技	600	18,702.00	0.01
284	002153	石基信息	1,090	15,260.00	0.01
285	002311	海大集团	300	14,052.00	0.01
286	603456	九洲药业	400	10,952.00	0.01
287	300496	中科创达	100	9,635.00	0.01
288	002625	光启技术	300	4,578.00	0.00
289	600160	巨化股份	300	4,134.00	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	600497	驰宏锌锗	152,700	766,554.00	0.42
2	002085	万丰奥威	99,600	690,228.00	0.38
3	300136	信维通信	34,200	686,736.00	0.38
4	688819	天能股份	17,800	655,752.00	0.36
5	601222	林洋能源	74,800	612,612.00	0.34
6	000333	美的集团	10,100	595,092.00	0.33
7	600025	华能水电	73,500	524,055.00	0.29
8	000555	神州信息	42,300	520,290.00	0.28
9	002273	水晶光电	42,100	502,674.00	0.27
10	688981	中芯国际	8,200	414,264.00	0.23
11	688567	孚能科技	17,100	369,189.00	0.20
12	003816	中国广核	113,000	351,430.00	0.19
13	300627	华测导航	10,700	347,429.00	0.19
14	601801	皖新传媒	36,600	343,674.00	0.19
15	600582	天地科技	58,800	342,804.00	0.19
16	601869	长飞光纤	9,100	336,791.00	0.18
17	603599	广信股份	12,000	324,960.00	0.18
18	601928	凤凰传媒	27,700	315,780.00	0.17
19	601998	中信银行	52,800	315,744.00	0.17
20	688100	威胜信息	10,400	310,024.00	0.17
21	002203	海亮股份	25,200	302,652.00	0.17
22	601728	中国电信	53,700	302,331.00	0.17
23	601665	齐鲁银行	76,600	300,272.00	0.16
24	603377	东方时尚	37,100	298,284.00	0.16
25	601369	陕鼓动力	32,700	297,897.00	0.16
26	600143	金发科技	32,700	285,471.00	0.16
27	603883	老百姓	8,700	259,695.00	0.14
28	000878	云南铜业	23,300	257,465.00	0.14
29	600131	国网信通	12,700	256,413.00	0.14
30	603323	苏农银行	60,500	254,705.00	0.14
31	002925	盈趣科技	13,000	252,200.00	0.14
32	603096	新经典	12,300	250,428.00	0.14
33	601717	郑煤机	20,000	249,000.00	0.14
34	688116	天奈科技	5,338	244,213.50	0.13
35	688598	金博股份	1,402	240,443.00	0.13
36	603283	赛腾股份	5,000	222,500.00	0.12
37	600908	无锡银行	40,900	219,224.00	0.12

38	300226	上海钢联	6,600	213,840.00	0.12
39	002410	广联达	6,560	213,134.40	0.12
40	002250	联化科技	19,700	206,062.00	0.11
41	001269	欧晶科技	2,800	205,884.00	0.11
42	603605	珀莱雅	1,824	205,017.60	0.11
43	600398	海澜之家	29,300	201,584.00	0.11
44	300803	指南针	4,100	199,219.00	0.11
45	603027	千禾味业	9,300	196,416.00	0.11
46	603639	海利尔	10,900	195,328.00	0.11
47	605499	东鹏饮料	1,100	190,190.00	0.10
48	002245	蔚蓝锂芯	16,700	182,865.00	0.10
49	600728	佳都科技	26,100	180,873.00	0.10
50	300593	新雷能	7,890	180,759.90	0.10
51	300850	新强联	4,800	179,424.00	0.10
52	300121	阳谷华泰	18,400	175,720.00	0.10
53	300590	移为通信	14,200	173,524.00	0.09
54	600129	太极集团	2,900	172,521.00	0.09
55	688072	拓荆科技	400	170,388.00	0.09
56	600580	卧龙电驱	11,600	169,476.00	0.09
57	601098	中南传媒	14,300	165,880.00	0.09
58	688520	神州细胞	2,921	165,737.54	0.09
59	002291	遥望科技	12,600	165,060.00	0.09
60	002839	张家港行	37,900	160,317.00	0.09
61	600938	中国海油	8,800	159,456.00	0.09
62	600562	国睿科技	9,700	157,140.00	0.09
63	300009	安科生物	15,500	155,000.00	0.08
64	600537	亿晶光电	19,900	152,036.00	0.08
65	600718	东软集团	14,200	151,372.00	0.08
66	605266	健之佳	1,800	150,894.00	0.08
67	603195	公牛集团	1,488	142,937.28	0.08
68	600755	厦门国贸	18,300	141,642.00	0.08
69	300035	中科电气	10,900	131,018.00	0.07
70	300383	光环新网	12,000	129,000.00	0.07
71	688733	壹石通	4,100	126,936.00	0.07
72	000997	新大陆	6,400	120,960.00	0.07
73	300012	华测检测	6,200	120,900.00	0.07
74	688707	振华新材	3,900	120,081.00	0.07
75	688559	海目星	2,500	117,525.00	0.06
76	688206	概伦电子	4,134	115,917.36	0.06
77	688105	诺唯赞	3,800	115,862.00	0.06
78	300775	三角防务	3,400	114,852.00	0.06

79	002373	千方科技	8,400	114,576.00	0.06
80	600312	平高电气	9,000	111,510.00	0.06
81	603466	风语筑	7,900	109,810.00	0.06
82	605333	沪光股份	6,500	107,510.00	0.06
83	002215	诺普信	14,000	105,140.00	0.06
84	603171	税友股份	2,600	103,948.00	0.06
85	603301	振德医疗	3,500	103,670.00	0.06
86	002396	星网锐捷	4,500	101,655.00	0.06
87	300767	震安科技	3,900	98,904.00	0.05
88	002458	益生股份	8,000	98,800.00	0.05
89	603601	再升科技	22,800	97,356.00	0.05
90	002391	长青股份	13,700	94,119.00	0.05
91	600483	福能股份	8,000	92,400.00	0.05
92	300762	上海瀚讯	7,800	91,806.00	0.05
93	002859	洁美科技	3,300	91,410.00	0.05
94	002139	拓邦股份	7,000	91,350.00	0.05
95	301039	中集车辆	6,600	87,318.00	0.05
96	603612	索通发展	4,900	84,917.00	0.05
97	603383	顶点软件	1,500	83,130.00	0.05
98	688267	中触媒	3,900	82,173.00	0.04
99	002990	盛视科技	2,200	80,960.00	0.04
100	601567	三星医疗	6,400	80,832.00	0.04
101	002595	豪迈科技	2,300	80,799.00	0.04
102	603181	皇马科技	7,200	80,208.00	0.04
103	301011	华立科技	3,400	79,662.00	0.04
104	605136	丽人丽妆	6,900	79,557.00	0.04
105	301090	华润材料	6,300	79,506.00	0.04
106	002415	海康威视	2,400	79,464.00	0.04
107	002912	中新赛克	1,800	79,218.00	0.04
108	600927	永安期货	4,700	76,422.00	0.04
109	600941	中国移动	800	74,640.00	0.04
110	301488	豪恩汽电	1,870	74,388.60	0.04
111	603228	景旺电子	2,900	74,385.00	0.04
112	600869	远东股份	13,400	73,968.00	0.04
113	688234	天岳先进	1,000	73,940.00	0.04
114	301486	致尚科技	1,270	73,228.20	0.04
115	301395	仁信新材	2,641	70,461.88	0.04
116	603306	华懋科技	2,400	69,648.00	0.04
117	000967	盈峰环境	13,200	66,660.00	0.04
118	603859	能科科技	1,300	66,469.00	0.04
119	688722	同益中	3,500	64,890.00	0.04

120	600597	光明乳业	6,200	64,480.00	0.04
121	601187	厦门银行	12,600	63,252.00	0.03
122	002698	博实股份	3,500	61,215.00	0.03
123	688603	天承科技	1,078	59,290.00	0.03
124	000682	东方电子	6,000	58,320.00	0.03
125	002929	润建股份	1,300	56,433.00	0.03
126	688299	长阳科技	3,600	56,412.00	0.03
127	603056	德邦股份	3,600	55,512.00	0.03
128	300332	天壕环境	4,800	55,056.00	0.03
129	300294	博雅生物	1,500	54,420.00	0.03
130	603158	腾龙股份	7,000	53,620.00	0.03
131	300457	赢合科技	3,000	52,980.00	0.03
132	300451	创业慧康	6,300	52,794.00	0.03
133	000951	中国重汽	3,000	50,550.00	0.03
134	301202	朗威股份	1,943	50,168.26	0.03
135	688377	迪威尔	2,000	50,100.00	0.03
136	002675	东诚药业	3,400	50,014.00	0.03
137	301261	恒工精密	1,325	48,892.50	0.03
138	002081	金螳螂	10,800	48,708.00	0.03
139	600995	南网储能	4,400	48,444.00	0.03
140	002461	珠江啤酒	5,300	46,693.00	0.03
141	603309	维力医疗	3,000	46,410.00	0.03
142	688639	华恒生物	500	45,240.00	0.02
143	300450	先导智能	1,200	43,404.00	0.02
144	300679	电连技术	1,300	42,965.00	0.02
145	688201	信安世纪	1,000	42,740.00	0.02
146	300855	图南股份	1,200	42,384.00	0.02
147	603919	金徽酒	1,800	42,264.00	0.02
148	000089	深圳机场	6,000	41,700.00	0.02
149	000400	许继电气	1,800	41,490.00	0.02
150	603416	信捷电气	1,000	41,310.00	0.02
151	603186	华正新材	1,200	41,280.00	0.02
152	601975	招商南油	14,000	40,040.00	0.02
153	605111	新洁能	900	39,168.00	0.02
154	688261	东微半导	280	39,163.60	0.02
155	603317	天味食品	2,600	37,986.00	0.02
156	688676	金盘科技	1,200	36,348.00	0.02
157	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.02
158	600986	浙文互联	5,500	35,200.00	0.02
159	000860	顺鑫农业	1,000	33,690.00	0.02
160	688208	道通科技	1,100	33,341.00	0.02

161	600760	中航沈飞	700	31,500.00	0.02
162	688066	航天宏图	513	31,241.70	0.02
163	600956	新天绿能	3,400	29,648.00	0.02
164	688107	安路科技	500	27,695.00	0.02
165	603987	康德莱	1,900	24,548.00	0.01
166	002727	一心堂	900	23,760.00	0.01
167	300636	同和药业	1,900	23,294.00	0.01
168	300860	锋尚文化	400	22,176.00	0.01
169	002312	川发龙蟒	2,700	21,951.00	0.01
170	688235	百济神州	200	21,822.00	0.01
171	688157	松井股份	400	21,040.00	0.01
172	688249	晶合集成	1,160	20,949.60	0.01
173	601311	骆驼股份	2,200	20,416.00	0.01
174	002747	埃斯顿	700	19,600.00	0.01
175	300842	帝科股份	200	18,288.00	0.01
176	002937	兴瑞科技	600	14,760.00	0.01
177	688361	中科飞测-U	223	14,421.41	0.01
178	301293	三博脑科	200	14,284.00	0.01
179	301358	湖南裕能	313	13,424.57	0.01
180	688472	阿特斯	766	13,052.64	0.01
181	688469	中芯集成	2,353	12,729.73	0.01
182	688007	光峰科技	600	12,510.00	0.01
183	301317	鑫磊股份	443	11,593.31	0.01
184	688531	日联科技	75	10,197.75	0.01
185	301315	威士顿	183	9,354.96	0.01
186	301303	真兰仪表	408	9,106.56	0.00
187	688593	新相微	623	9,089.57	0.00
188	688576	西山科技	75	9,030.75	0.00
189	301408	华人健康	528	8,949.60	0.00
190	603303	得邦照明	600	8,286.00	0.00
191	688523	航天环宇	336	8,013.60	0.00
192	301246	宏源药业	248	7,616.08	0.00
193	688484	南芯科技	206	7,562.26	0.00
194	301387	光大同创	165	7,484.40	0.00
195	688352	颀中科技	618	7,459.26	0.00
196	301262	海看股份	286	7,293.00	0.00
197	603067	振华股份	600	7,290.00	0.00
198	603378	亚士创能	800	7,288.00	0.00
199	688543	国科军工	137	7,267.85	0.00
200	600057	厦门象屿	800	6,960.00	0.00
201	301332	德尔玛	505	6,933.65	0.00

202	001287	中电港	327	6,873.54	0.00
203	688535	华海诚科	134	6,864.82	0.00
204	301225	恒勃股份	204	6,785.04	0.00
205	688458	美芯晟	74	6,716.24	0.00
206	301117	佳缘科技	100	6,462.00	0.00
207	688429	时创能源	249	6,356.97	0.00
208	300804	广康生化	185	6,099.45	0.00
209	301357	北方长龙	124	6,000.36	0.00
210	301203	国泰环保	172	5,916.80	0.00
211	688581	安杰思	50	5,901.50	0.00
212	301322	绿通科技	108	5,749.92	0.00
213	301376	致欧科技	255	5,740.05	0.00
214	301386	未来电器	234	5,566.86	0.00
215	301170	锡南科技	156	5,449.08	0.00
216	002801	微光股份	200	5,412.00	0.00
217	301337	亚华电子	174	5,284.38	0.00
218	301323	新莱福	134	5,274.24	0.00
219	002258	利尔化学	400	5,164.00	0.00
220	688631	莱斯信息	171	5,107.77	0.00
221	301281	科源制药	200	5,020.00	0.00
222	301397	溯联股份	122	4,904.40	0.00
223	300685	艾德生物	200	4,852.00	0.00
224	688623	双元科技	52	4,513.08	0.00
225	688479	友车科技	141	4,158.09	0.00
226	301345	涛涛车业	80	3,731.20	0.00
227	001380	华纬科技	100	3,078.00	0.00
228	002968	新大正	200	3,022.00	0.00
229	001282	三联锻造	91	3,005.73	0.00
230	601065	江盐集团	228	2,699.52	0.00
231	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
232	001360	南矿集团	138	2,052.06	0.00
233	603125	常青科技	79	1,937.87	0.00
234	600556	天下秀	200	1,418.00	0.00
235	002706	良信股份	100	1,125.00	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	000858	五粮液	4,296,952.00	2.55
2	601012	隆基绿能	4,243,966.00	2.52

3	600519	贵州茅台	3,846,622.00	2.29
4	601766	中国中车	3,239,570.00	1.92
5	300059	东方财富	3,076,621.00	1.83
6	000725	京东方A	2,879,445.00	1.71
7	002475	立讯精密	2,806,430.00	1.67
8	600406	国电南瑞	2,760,722.00	1.64
9	600104	上汽集团	2,722,570.00	1.62
10	600050	中国联通	2,717,823.00	1.61
11	601318	中国平安	2,589,278.00	1.54
12	601818	光大银行	2,512,789.00	1.49
13	002049	紫光国微	2,483,278.00	1.48
14	000338	潍柴动力	2,323,318.00	1.38
15	600809	山西汾酒	2,319,296.00	1.38
16	688981	中芯国际	2,268,674.70	1.35
17	300124	汇川技术	2,227,792.00	1.32
18	600926	杭州银行	2,190,724.00	1.30
19	601319	中国人保	2,162,344.00	1.28
20	600845	宝信软件	2,062,490.40	1.23

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	000568	泸州老窖	3,675,388.00	2.18
2	002594	比亚迪	3,452,879.00	2.05
3	600519	贵州茅台	3,110,686.00	1.85
4	601012	隆基绿能	2,869,278.00	1.70
5	600926	杭州银行	2,688,551.00	1.60
6	601390	中国中铁	2,678,751.00	1.59
7	601857	中国石油	2,444,075.00	1.45
8	688981	中芯国际	2,416,349.34	1.44
9	601899	紫金矿业	2,347,084.00	1.39
10	600809	山西汾酒	2,319,929.00	1.38
11	600438	通威股份	2,291,448.00	1.36
12	600050	中国联通	2,190,590.00	1.30
13	600845	宝信软件	2,112,480.10	1.25
14	601998	中信银行	2,105,352.00	1.25
15	601881	中国银河	2,090,270.00	1.24
16	601238	广汽集团	2,075,335.00	1.23
17	002049	紫光国微	2,071,361.60	1.23

18	000002	万科A	2,070,899.00	1.23
19	300750	宁德时代	2,069,775.00	1.23
20	601318	中国平安	1,993,849.00	1.18

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	365,154,463.02
卖出股票收入（成交）总额	354,828,071.61

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	31,812.08
2	应收清算款	9,611,605.90
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	593,879.43
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	10,237,297.41

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

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(%)
10,772	8,990.69	50,430,706.57	52.07	46,416,963.29	47.93

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	408,060.77	0.4213

8.3 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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2018年12月25日)基金份额总额	227,607,631.34
报告期期初基金份额总额	91,548,428.71
本报告期基金总申购份额	51,560,407.52
减：本报告期基金总赎回份额	46,261,166.37
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	96,847,669.86

§ 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	35,523,639.15	4.97	25,621.38	4.96	—
长江证券	3	42,683,158.52	5.97	30,787.71	5.97	—

德邦证券	2	—	—	—	—	—
东北证券	2	29,890.72	0.00	21.56	0.00	—
东财证券	2	56,522,211.88	7.90	40,770.12	7.90	—
方正证券	2	20,716,094.56	2.90	14,941.62	2.90	—
高盛中国	1	207,354.54	0.03	191.04	0.04	—
光大证券	2	38,399,599.70	5.37	27,693.63	5.37	—
广发证券	2	26,087,486.62	3.65	18,817.41	3.65	—
国海证券	2	—	—	—	—	—
国盛证券	2	75,122,860.07	10.50	54,185.61	10.50	—
国泰君安	2	9,600,845.88	1.34	6,924.88	1.34	—
国信证券	2	—	—	—	—	—
海通证券	2	86,197,652.23	12.05	62,171.76	12.05	—
华泰证券	1	50,398.20	0.01	36.35	0.01	—
平安证券	2	—	—	—	—	—
瑞银证券	2	—	—	—	—	—
上海证券	1	—	—	—	—	—
申万宏源	2	93,318,899.29	13.04	67,312.53	13.04	—
太平洋证券	2	8,864,201.98	1.24	6,393.53	1.24	—
天风证券	2	14,747,981.00	2.06	10,637.89	2.06	—
西南证券	2	—	—	—	—	—
湘财证券	1	—	—	—	—	—
信达证券	2	—	—	—	—	—
兴业证券	1	23,104,137.89	3.23	16,665.07	3.23	—
招商证券	1	30,170,759.61	4.22	21,762.91	4.22	—
中航证券	2	43,529,869.64	6.08	31,397.97	6.08	—
中金公司	2	—	—	—	—	—
中泰证券	2	63,017,404.34	8.81	45,452.90	8.81	—
中信建投	1	11,635,459.35	1.63	8,392.68	1.63	—
中信证券	2	35,865,548.25	5.01	25,870.58	5.01	—
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	7,761.59	0.08	—	—	—	—
德邦证券	—	—	—	—	—	—
东北证券	—	—	—	—	—	—
东财证券	6,037.20	0.07	—	—	—	—
方正证券	4,506,525.00	49.25	—	—	—	—
高盛中国	—	—	—	—	—	—
光大证券	—	—	—	—	—	—
广发证券	—	—	—	—	—	—
国海证券	6,946.88	0.08	—	—	—	—
国盛证券	47,143.20	0.52	—	—	—	—
国泰君安	4,505,670.00	49.24	—	—	—	—
国信证券	—	—	—	—	—	—
海通证券	39,970.07	0.44	—	—	—	—
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	29,210.50	0.32	—	—	—	—
招商证券	—	—	—	—	—	—
中航证券	1,514.86	0.02	—	—	—	—
中金公司	—	—	—	—	—	—

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

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2023年02月02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	2023年03月25日
3	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2023年05月04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	2023-01-16 至 2023-05-24	—	26,562,601.91	26,562,601.91	—	—
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MSCI中国A股国际通指数增强型证券投资基金的文件 2、富国MSCI中国A股国际通指数增强型证券投资基金基金合同 3、富国MSCI中国A股国际通指数增强型证券投资基金托管协议 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MSCI中国A股国际通指数增强型证券投资基金财务报表及报表附注 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告	中国(上海)自由贸易试验区 世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费） 公司地址： http://www.fullgoal.com.cn 。