

富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金
二〇二二年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2023 年 03 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。本年度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 3 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。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§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	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核报告	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	17
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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.....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	18
§6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息.....	18
6.2 审计报告的基本内容.....	18
§7 年度财务报告	21
7.1 资产负债表.....	21

7.2 利润表.....	22
7.3 净资产（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	25
§8 投资组合报告.....	59
8.1 期末基金资产组合情况.....	59
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	59
8.3 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.....	60
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	75
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	76
8.6 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.....	76
8.7 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.....	76
8.8 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.....	76
8.9 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.....	77
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	77
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	77
8.12 投资组合报告附注.....	77
§9 基金份额持有人信息.....	78
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	78
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	78
9.3 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.....	78
§10 开放式基金份额变动.....	79
§11 重大事件揭示.....	79
11.1 基金份额持有人大会决议.....	79
11.2 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.....	79
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	79
11.4 基金投资策略的改变.....	79
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	79
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	79
11.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	80
11.8 其他重大事件.....	83
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	83
12.1 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.....	83
§13 备查文件目录.....	84

§ 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	91,548,428.71 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)自由贸易试验区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层	北京市西城区金融大街25号
办公地址	上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇办公楼二座27-30层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	裴长江	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2022年	2021年	2020年
本期已实现收益	-17,181,422.00	26,702,262.49	30,269,882.74
本期利润	-32,464,822.62	18,200,231.10	40,290,634.57
加权平均基金份额本期利润	-0.3412	0.2323	0.5560

本期加权平均净值利润率	-17.64%	11.04%	35.34%
本期基金份额净值增长率	-14.82%	12.70%	42.69%
3.1.2 期末数据和指标	2022年12月31日	2021年12月31日	2020年12月31日
期末可供分配利润	76,786,677.22	102,766,254.98	56,616,662.96
期末可供分配基金份额利润	0.8388	1.0937	0.7299
期末基金资产净值	168,335,105.93	202,841,633.87	148,572,330.52
期末基金份额净值	1.8388	2.1588	1.9155
3.1.3 累计期末指标	2022年12月31日	2021年12月31日	2020年12月31日
基金份额累计净值增长率	83.88%	115.88%	91.55%

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
过去三个月	-0.02%	1.14%	1.00%	1.16%	-1.02%	-0.02%
过去六个月	-12.00%	1.01%	-12.39%	1.02%	0.39%	-0.01%
过去一年	-14.82%	1.20%	-19.90%	1.21%	5.08%	-0.01%
过去三年	36.98%	1.26%	3.67%	1.23%	33.31%	0.03%
自基金合同生效起至今	83.88%	1.21%	37.46%	1.21%	46.42%	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。

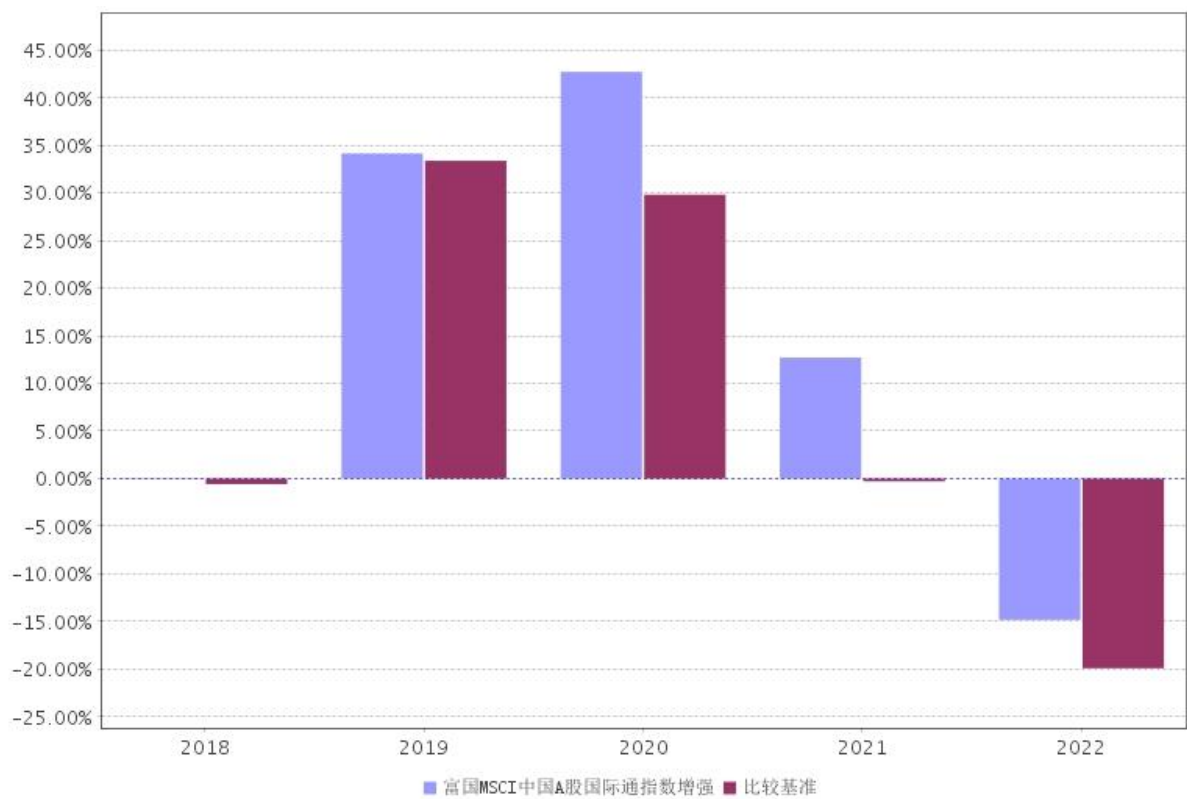
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为2022年12月31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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：2018 年按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：过往三年本基金未进行利润分配。

§ 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 2022 年 12 月 31 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 287 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；现任富国基金量化投资部量化投资总监兼高级定量基金经理。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《证券投资基金经营机构董事、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 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

《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 公平交易制度和控制方法

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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期，在同向交易价差分析方面，公司采集连续四个季度，不同时间窗口（1日内、3日内、5日内）的同向交易样本，在假设同向交易价差为零及95%的置信水平下，对同向交易价差进行t分布假设检验并对检验结果进行跟踪分析。分析结果显示本投资组合与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

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。

4.3.3 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30次同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022年伊始，受美国加息预期升温、俄乌冲突加剧、中概股从纳斯达克退市担忧加剧、上海疫情等多重因素的影响，A股整体出现大幅调整。4月底，经过短期大幅调整后，A股投资性价比显现，同时政治局会议再次强调稳增长目标，5月、6月国内政策环境明显改善，市场信心有所恢复，A股迎来快速反弹。7月市场进入基本面验证期，总体震荡回落。7月中旬，由于部分地区地产断供事件发酵，投资者对地产行业可能带来的系统性风险担忧加剧，金融、地产板块快速回落。8月受中国7月制造业PMI回落至荣枯线以下、政治局会议淡化经济增速目标、台海局势紧张、美联储主席鲍威尔发表鹰派讲话等因素的影响，A股总体持续调整。11月初，随着国务院联防联控机制强调科学精准做好疫情防控，同时房地产股权融资时隔多年后再度放开，市场对经济复苏预期进一步升温，地产、消费等经济相关板块大幅反弹。12月初，随着疫情防控政策发生重大转变，放松管控成为大势所趋。同时，中共中央政治局召开经济工作会议提出要大力提振市场信心，实施扩大内需战略，A股迎来大幅反弹。

总体来看，2022 年上证综指下跌 15.13%，沪深 300 下跌 21.63%，创业板指下跌 29.37%，中证 500 指数下跌 20.31%。

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，力争获取超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.8388 元；份额累计净值为 1.8388 元；本报告期，本基金份额净值增长率为-14.82%，同期业绩比较基准收益率为-19.90%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2023 年，随着疫情影响逐步消退、稳增长政策持续发力，市场有望迎来疫后增长修复的趋势性投资机会：1) 疫情对经济的影响正在逐步消退，国内消费修复仍在稳步进行中。春节假期的高频数据显示，春节期间客流量、国内出游人数、春节档电影票房数据均高于去年同期水平，内需消费修复仍在稳步进行中；2) 稳增长政策有望持续发力。前期中央政治局会议和中央经济工作会议相继召开，后续稳增长政策有望持续发力，支撑国内经济走向实质性复苏；3) 海外风险偏好持续修复。美联储加息节奏放缓，全球流动性有望迎来拐点，海外风险偏好持续修复。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核报告

本基金管理人始终坚持持有人利益优先原则，报告期内持续完善内控管理机制，全方位推动监察稽核工作深入开展。在基础性工作的基础上，2022 年本基金管理人重点开展的监察稽核工作包括以下方面：

（一）持续推进制度流程建设，保障业务合规开展

公司以建立重点业务内控制度体系，规范各业务部门内部管理为重点，持续强化公司内控与风险防范水平。报告期内，公司新增、修订多项内部管理制度，并以制度为基础相应完善业务流程。

（二）深入进行新规学习，扎实推动新规落地

2022 年度，公司从新规解读、制度建立、系统建设、流程改造等方面持续推进各项重要法律法规、监管要求的落地工作，并对落地情况开展专项检查，确保各项业务合法合规开展。

（三）夯实合规管理架构，强化合规管理职能

公司以持续完善合规考核体系、优化专兼合规会议机制等作为抓手，加强一道防线合规履职效能，强化合规管理成效，推动合规工作深入开展。

（四）多措并举，全面提升员工合规意识

为持续提高全员合规意识，公司对新员工、特定业务条线员工、全体员工组织不同侧重点的合规培训与宣导，结合合规谈话及合规考试，多维度、多层次地进行文化贯宣，全面提升员工合规意识。

（五）立足于合规，不断拓展风险管理职能

报告期内，公司持续推进旗下组合的投资合规风控阈值多维度排查梳理和日常投资合规监督工作的规范化管理，进一步根据系统升级迭代情况整合优化历史风控工具。公司持续强化合规风控培训工作，提升各部门主动合规的能力和意识。投资风险管理方面，公司针对各类投资品种开展风险管理系列专项工作，加强日常监测和定期风险评估，持续提升对于各类投资标的的风险管理水平。

（六）持续推进合规风控工作的系统化建设

报告期内，公司持续开展合规风控信息化建设，不断提升自主研发能力。通过搭建、完善覆盖事前、事中、事后的风控系统工具体系，助力有效监测、识别投资组合运作过程中的各类风险，提升整体风险防范能力。在合规管理方面，新增或优化系统管理功能模块包括产品营销模块、专兼合规管理模块、新一代报表报送平台等。通过系统建设，提升合规管理工作水平和效率。

（七）推动反洗钱工作深入开展

公司高度重视反洗钱工作，认真贯彻落实各项反洗钱监管要求。除在客户尽职调查、大额和可疑交易报告、客户资料和交易记录保存等反洗钱核心义务方面积极履职外，还通过重点专项工作等方式有序推动反洗钱工作深入开展。报告期内，主要重点工作包括机构洗钱和恐怖融资风险自评估、新产品新业务洗钱风险评估、反洗钱系统建设、多层次立体化文化宣贯等。

（八）加强内部审计，发挥第三道防线功能

公司围绕各条线各部门制度框架体系建立情况、法规落实情况及当年工作重点开展审计工作。通过基础风险点例行检查与法规落实情况、监管重点排查相结合的方式，持续暴露内控缺陷并督导整改完善，切实起到第三道防线自查自纠、防范风险、保驾护航的作用。

（九）全面加强员工行为管理

报告期内，公司持续加强对从业人员的行为管控，内容包括监控录像、电子邮件、电话录音抽查，特定员工通讯工具集中管理，员工证券投资申报管理等方面。通过日常合规管理与定期事后检查相结合的方式，提升全员合规意识，防范利益冲突，确保各项业务合规开展。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 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 托管人对本年度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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2023）审字第 60467606_B121 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相

	信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p>

	<p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	王珊珊	费泽旭
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层	

审计报告日期	2023年03月29日
--------	-------------

§ 7 年度财务报告

7.1 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：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2022年12月 31日	上年度末 2021年12月31 日
资产：		
银行存款	10,845,248.18	13,314,102.62
结算备付金	110,494.89	403,514.71
存出保证金	19,254.50	32,585.80
交易性金融资产	157,642,470.73	189,834,807.12
其中：股票投资	157,642,470.73	189,334,989.52
基金投资	—	—
债券投资	—	499,817.60
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	134,913.22	—
应收股利	—	—
应收申购款	139,616.46	100,556.73
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	2,643.96
资产总计	168,891,997.98	203,688,210.94
负债和净资产	本期末 2022年12月 31日	上年度末 2021年12月31 日
负债：		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付清算款	—	—
应付赎回款	18,002.73	305,132.45
应付管理人报酬	154,956.45	173,543.70
应付托管费	23,243.46	26,031.55

应付销售服务费	—	—
应付投资顾问费	—	—
应交税费	0.43	0.17
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	360,688.98	341,869.20
负债合计	556,892.05	846,577.07
净资产：		
实收基金	91,548,428.71	93,960,909.57
其他综合收益	—	—
未分配利润	76,786,677.22	108,880,724.30
净资产合计	168,335,105.93	202,841,633.87
负债和净资产总计	168,891,997.98	203,688,210.94

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.8388 元，基金份额总额 91,548,428.71 份。

比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号（年度报告和中期报告）》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年度末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年度末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

7.2 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：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日)	上年度可比期间 (2021 年 01 月 01 日 至 2021 年 12 月 31 日)
一、营业总收入	-30,052,787.24	21,017,032.80
1.利息收入	59,289.93	98,145.46
其中：存款利息收入	59,289.93	52,259.22
债券利息收入	—	44,945.97
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	—	940.27
证券出借利息收入	—	—
其他利息收入	—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）	-14,917,597.55	29,255,378.66

其中：股票投资收益	-18,345,665.69	26,602,927.63
基金投资收益	—	—
债券投资收益	153,389.25	154,013.40
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具收益	—	—
股利收益	3,274,678.89	2,498,437.63
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）	-15,283,400.62	-8,502,031.39
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	88,921.00	165,540.07
减：二、营业总支出	2,412,035.38	2,816,801.70
1. 管理人报酬	1,841,513.10	1,644,249.13
2. 托管费	276,226.96	246,637.39
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	0.32	0.15
8. 其他费用	294,295.00	925,915.03
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-32,464,822.62	18,200,231.10
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-32,464,822.62	18,200,231.10
五、其他综合收益的税后净额	—	—
六、综合收益总额	-32,464,822.62	18,200,231.10

注：比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号（年度报告和中期报告）》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

7.3 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：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 (2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 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）	—	—	—
	2,412,480.86	32,094,047.08	34,506,527.94
（一）、综合收益总额	—	—	—
	—	32,464,822.62	32,464,822.62
（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）	—	—	—
	2,412,480.86	370,775.54	2,041,705.32
其中：1. 基金申购款	63,721,778.67	60,888,425.85	124,610,204.52
2. 基金赎回款	—	—	—
	66,134,259.53	60,517,650.31	126,651,909.84
（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）	91,548,428.71	76,786,677.22	168,335,105.93
项目	上年度可比期间 (2021年01月01日至2021年12月31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）	77,563,459.56	71,008,870.96	148,572,330.52
加：会计政策变更	—	—	—
二、本期期初净资产（基金净值）	77,563,459.56	71,008,870.96	148,572,330.52
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	16,397,450.01	37,871,853.34	54,269,303.35
（一）、综合收益总额	—	18,200,231.10	18,200,231.10
（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）	16,397,450.01	19,671,622.24	36,069,072.25
其中：1.基金申购款	96,128,389.09	108,437,834.81	204,566,223.90

2.基金赎回款	-	-	-
	79,730,939.08	88,766,212.57	168,497,151.65
(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）	93,960,909.57	108,880,724.30	202,841,633.87

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 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： $95\% \times \text{MSCI 中国 A 股国际通指数收益率} + 5\% \times \text{银行人民币活期存款利率（税后）}$ 。

7.4.2 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 2 号《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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说

明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额

计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，

假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基

金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金

融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、本基金收益分配方式默认为现金分红；基金份额持有人可以事先选择将所获分配的现金红利，按照基金合同有关基金份额申购的约定转为基金份额；基金份额持有人事先未做出选择的，基金管理人应当支付现金；

2、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

3、每一基金份额享有同等分配权；如本基金在未来条件成熟时，增减基金份额类别，则同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

7.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理。此外，本基金亦已执行财政部于 2022 年发布的《关于印发〈资产管理产品相关会计处理规定〉的通知》（财会[2022]14 号）。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”

项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

根据新金融工具准则的衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与原准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。于首次执行日（2022年1月1日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币13,314,102.62元，自应收利息转入的重分类金额为人民币1,627.97元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币13,315,730.59元。

结算备付金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币403,514.71元，自应收利息转入的重分类金额为人民币199.76元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币403,714.47元。

存出保证金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币32,585.80元，自应收利息转入的重分类金额为人民币16.06元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币32,601.86元。

应收利息于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币2,643.96元，转出至银行存款的重分类金额为人民币1,627.97元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币199.76元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币16.06元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币800.17元。经上

述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 189,834,807.12 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 800.17 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 189,835,607.29 元。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 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

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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 (2022年12月31日)	上年度末 (2021年12月31日)
活期存款	10,845,248.18	13,314,102.62
等于：本金	10,843,459.01	13,314,102.62
加：应计利息	1,789.17	—
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	10,845,248.18	13,314,102.62

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有定期存款。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末(2022年12月31日)			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	165,489,840.68	—	157,642,470.73	—
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	165,489,840.68	—	157,642,470.73	—
项目	上年度末(2021年12月31日)			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	181,903,796.45	—	189,334,989.52	7,431,193.07
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—

债券	交易所市场	494,980.00	—	499,817.60	4,837.60
	银行间市场	—	—	—	—
	合计	494,980.00	—	499,817.60	4,837.60
资产支持证券		—	—	—	—
基金		—	—	—	—
其他		—	—	—	—
合计		182,398,776.45	—	189,834,807.12	7,436,030.67

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本报告期末及上年度末本基金未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
应收利息	—	2,643.96
其他应收款	—	—
待摊费用	—	—
合计	—	2,643.96

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
应付券商交易单元保证金	—	—
应付赎回费	42.40	1,092.56
应付证券出借违约金	—	—
应付交易费用	218,767.58	158,898.14
其中：交易所市场	218,767.58	158,898.14

银行间市场	—	—
应付利息	—	—
应付指数使用费	103,879.00	31,878.50
预提审计费	38,000.00	30,000.00
预提信息披露费	—	120,000.00
合计	360,688.98	341,869.20

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年12月31日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	93,960,909.57	93,960,909.57
本期申购	63,721,778.67	63,721,778.67
本期赎回（以“-”号填列）	-66,134,259.53	-66,134,259.53
本期末	91,548,428.71	91,548,428.71

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 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	102,766,254.98	6,114,469.32	108,880,724.30
本期利润	-17,181,422.00	-15,283,400.62	-32,464,822.62
本期基金份额交易产生的变动数	-2,673,695.50	3,044,471.04	370,775.54
其中：基金申购款	62,189,153.75	-1,300,727.90	60,888,425.85
基金赎回款	-64,862,849.25	4,345,198.94	-60,517,650.31
本期已分配利润	—	—	—
本期末	82,911,137.48	-6,124,460.26	76,786,677.22

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年12月31日）	上年度可比期间（2021年01月01日至2021年12月31日）
活期存款利息收入	51,715.49	39,938.74
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	4,990.56	2,617.34
其他	2,583.88	9,703.14
合计	59,289.93	52,259.22

7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年12月31日）	上年度可比期间（2021年01月01日至2021年12月31日）

	日至 2022 年 12 月 31 日)	月 01 日至 2021 年 12 月 31 日)
卖出股票成交总额	489,460,992.85	197,484,609.97
减：卖出股票成本总额	506,366,047.51	170,881,682.34
减：交易费用	1,440,611.03	—
买卖股票差价收入	-18,345,665.69	26,602,927.63

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年12月31日）	上年度可比期间（2021年01月01日至2021年12月31日）
债券投资收益——利息收入	3,786.32	—
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	149,602.93	154,013.40
合计	153,389.25	154,013.40

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年12月31日）	上年度可比期间（2021年01月01日至2021年12月31日）
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,049,286.37	3,888,341.36
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	895,080.00	3,663,378.00
减：应计利息总额	4,589.13	70,949.96
减：交易费用	14.31	—
债券投资收益-差价收入	149,602.93	154,013.40

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

7.4.7.13 贵金属投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖贵金属交易。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年12月31日）	上年度可比期间（2021年01月01日至2021年12月31日）
股票投资产生的股利收益	3,274,678.89	2,498,437.63
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	3,274,678.89	2,498,437.63

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2022年01月01日至2022年12月31日）	上年度可比期间（2021年01月01日至2021年12月31日）
1. 交易性金融资产	-15,283,400.62	-8,502,031.39
股票投资	-15,278,563.02	-8,497,514.79
债券投资	-4,837.60	-4,516.60
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	-15,283,400.62	-8,502,031.39

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年12月31日）	上年度可比期间（2021年01月01日至2021年12月31日）
基金赎回费收入	88,517.53	164,757.13
转换费收入	403.47	782.94
合计	88,921.00	165,540.07

7.4.7.18 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年12月31日）	上年度可比期间（2021年01月01日至2021年12月31日）
审计费用	38,000.00	30,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	—	—
交易费用	—	643,701.25
银行费用	675.00	2,391.28
指数使用费	135,620.00	129,462.50
其他	—	360.00
合计	294,295.00	925,915.03

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
山东省国际信托股份有限公司	基金管理人的股东（2022年12月22日前）

山东省金融资产管理股份有限公司	基金管理人的股东（自 2022 年 12 月 22 日起）
蒙特利尔银行	基金管理人的股东
申万宏源证券承销保荐有限责任公司 （“申万宏源承销保荐”）	基金管理人的股东控制的子公司

注：（1）根据富国基金管理有限公司股东会决议，并经中国证监会《关于核准富国基金管理有限公司变更持股 5%以上股东的批复》（证监许可[2022]3007 号）批准，富国基金管理有限公司原股东山东省国际信托股份有限公司将其持有的富国基金管理有限公司 16.675%股权转让给山东省金融资产管理股份有限公司。上述事项已于 2022 年 12 月 22 日完成工商变更登记手续。

（2）以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日）		上年度可比期间（2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 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	159,656,252.68	16.43	106,046,090.88	24.95
申万宏源	113,766,222.21	11.70	24,082,102.38	5.66

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日）		上年度可比期间（2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 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	163,616.86	19.37	1,187,476.38	65.96

申万宏源	33,960.37	4.02	111,877.07	6.21
------	-----------	------	------------	------

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2022年01月01日至2022年12月31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	144,272.41	16.92	29,358.34	13.42
申万宏源	102,296.88	12.00	20,646.73	9.44
关联方名称	上年度可比期间（2021年01月01日至2021年12月31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	21,949.92	5.67	10,560.88	6.65
海通证券	96,640.34	24.95	58,049.44	36.53

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年12月31日）	上年度可比期间（2021年01月01日至2021年12月31日）
当期发生的基金应支付的管理费	1,841,513.10	1,644,249.13
其中：支付销售机构的客户维护费	327,725.74	187,338.23

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年12月31日）	上年度可比期间（2021年01月01日至2021年12月31日）
当期发生的基金应支付的托管费	276,226.96	246,637.39

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。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期（2022年01月01日至2022年12月31日）		上年度可比期间（2021年01月01日至2021年12月31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	10,845,248.18	51,715.49	13,314,102.62	39,938.74

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期（2022年01月01日至2022年12月31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	688271	联影医疗	IPO网下申购	1,031	113,852.71
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
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

金额单位：人民币元

上年度可比期间（2021年01月01日至2021年12月31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	301039	中集车	IPO网	7,259	50,522.64

有限公司		辆	下申购		
海通证券股份 有限公司	300981	中红医 疗	IPO网 下申购	1,158	56,267.22
申万宏源证券 承销保荐有限 责任公司	300937	药易购	IPO网 下申购	2,434	29,816.50
海通证券股份 有限公司	688187	时代电 气	IPO网 下申购	3,273	103,220.27
海通证券股份 有限公司	688701	卓锦股 份	IPO网 下申购	2,340	17,590.72
海通证券股份 有限公司	688217	睿昂基 因	IPO网 下申购	1,040	19,252.58
海通证券股份 有限公司	688685	迈信林	IPO网 下申购	2,612	23,678.04
海通证券股份 有限公司	688682	霍莱沃	IPO网 下申购	788	36,207.50
海通证券股份 有限公司	688092	爱科科 技	IPO网 下申购	1,137	21,836.71
海通证券股份 有限公司	688626	翔宇医 疗	IPO网 下申购	1,122	32,497.72
海通证券股份 有限公司	688329	艾隆科 技	IPO网 下申购	1,846	31,186.42
海通证券股份 有限公司	688665	四方光 电	IPO网 下申购	1,378	40,895.80
海通证券股份 有限公司	688687	凯因科 技	IPO网 下申购	2,945	56,175.58

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。

7.4.12 期末（2022年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

7.4.12.1.1 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	认购	期末估	数量	期末	期末	备
------	------	-------	-----	-----	----	-----	----	----	----	---

				限类型	价格	值单价	(单位: 股)	成本总额	估值总额	注
301095	广立微	2022-07-28	6 个月	新股限售	58.00	86.49	170	9,860.00	14,703.30	—
301115	建科股份	2022-08-23	6 个月	新股限售	42.05	24.04	215	9,040.75	5,168.60	—
301152	天力锂能	2022-08-19	6 个月	新股限售	57.00	46.64	145	8,265.00	6,762.80	—
301171	易点天下	2022-08-10	6 个月	新股限售	18.18	17.72	332	6,035.76	5,883.04	—
301223	中荣股份	2022-10-13	6 个月	新股限售	26.28	18.13	337	8,856.36	6,109.81	—
301227	森鹰窗业	2022-09-16	6 个月	新股限售	38.25	29.49	232	8,874.00	6,841.68	—
301269	华大九天	2022-07-21	6 个月	新股限售	32.69	87.94	219	7,159.11	19,258.86	—
301276	嘉曼服饰	2022-09-01	6 个月	新股限售	40.66	22.61	186	7,562.76	4,205.46	—
301280	珠城科技	2022-12-19	6 个月	新股限售	67.40	44.80	128	8,627.20	5,734.40	—
301283	聚胶股份	2022-08-26	6 个月	新股限售	52.69	51.41	133	7,007.77	6,837.53	—
301285	鸿日达	2022-09-21	6 个月	新股限售	14.60	12.60	446	6,511.60	5,619.60	—
301290	东星医疗	2022-11-23	6 个月	新股限售	44.09	35.13	163	7,186.67	5,726.19	—
301308	江波龙	2022-07-27	6 个月	新股限售	55.67	56.72	195	10,855.65	11,060.40	—
301309	万得凯	2022-09-08	6 个月	新股限售	39.00	24.46	137	5,343.00	3,351.02	—
301313	凡拓数创	2022-09-22	6 个月	新股限售	25.25	29.14	224	5,656.00	6,527.36	—
301316	慧博云通	2022-09-29	6 个月	新股限售	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88	—
301319	唯特偶	2022-09-22	6 个月	新股限售	47.75	53.27	87	4,154.25	4,634.49	—
301327	华宝新能	2022-09-08	6 个月	新股限售	237.50	176.97	73	17,337.50	12,918.81	—
301349	信德新材	2022-08-30	6 个月	新股限售	138.88	103.52	43	5,971.84	4,451.36	—
301356	天振股份	2022-11-03	6 个月	新股限售	63.00	43.33	129	8,127.00	5,589.57	—
301363	美好医疗	2022-09-28	6 个月	新股限售	30.66	37.85	203	6,223.98	7,683.55	—
301365	矩阵股份	2022-11-14	6 个月	新股限售	34.72	23.87	227	7,881.44	5,418.49	—
301367	怡和嘉业	2022-10-21	6 个月	新股限售	119.88	175.78	55	6,593.40	9,667.90	—
301389	隆扬电子	2022-10-18	6 个月	新股限售	22.50	17.16	357	8,032.50	6,126.12	—
301396	宏景科技	2022-11-04	6 个月	新股限售	40.13	31.90	233	9,350.29	7,432.70	—
688381	帝奥微	2022-08-15	6 个月	新股限售	41.68	37.98	1,433	59,727.44	54,425.34	—
688506	百利天恒	2022-12-28	1 个月内 (含)	新股认购	24.70	24.70	6,360	157,092.00	157,092.00	—

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2022 年 12 月 31 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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。

7.4.13.2.1 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。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
AAA	—	279,000.00
AAA以下	—	20,737.60
未评级	—	—
合计	—	299,737.60

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。

7.4.13.2.3 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。

7.4.13.2.4 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。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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7.4.12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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 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（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
上年度末（2021年12月31日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	13,314,102.62	—	—	—	—	—	13,314,102.62
结算备付金	403,514.71	—	—	—	—	—	403,514.71

存出保证金	32,585.80	—	—	—	—	—	32,585.80
交易性金融资产	—	—	499,817.60	—	—	189,334,989.52	189,834,807.12
应收申购款	21,855.00	—	—	—	—	78,701.73	100,556.73
其他资产	—	—	—	—	—	2,643.96	2,643.96
资产总计	13,772,058.13	—	499,817.60	—	—	189,416,335.21	203,688,210.94
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	305,132.45	305,132.45
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	173,543.70	173,543.70
应付托管费	—	—	—	—	—	26,031.55	26,031.55
应交税费	—	—	—	—	—	0.17	0.17
其他负债	—	—	—	—	—	341,869.20	341,869.20
负债总计	—	—	—	—	—	846,577.07	846,577.07
利率敏感度缺口	13,772,058.13	—	499,817.60	—	—	188,569,758.14	202,841,633.87

7.4.13.4.1.2 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（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	1. 基准点利率增加 0.1%	—	-162.10
	2. 基准点利率减少 0.1%	—	162.10

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 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（2022 年 12 月 31 日）		上年度末（2021 年 12 月 31 日）	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	157,642,470.73	93.65	189,334,989.52	93.34
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	499,817.60	0.25
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	0.00
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	157,642,470.73	93.65	189,834,807.12	93.59

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关；2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。
----	---

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
	1. 业绩比较基准增加 1%	1,653,000.88	2,116,437.47
2. 业绩比较基准减少 1%	-1,653,000.88	-2,116,437.47	

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 (2022年12月31日)	上年度末 (2021年12月31日)
第一层次	157,248,099.47	187,926,965.46
第二层次	157,092.00	484,584.49
第三层次	237,279.26	1,423,257.17
合计	157,642,470.73	189,834,807.12

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期（2022年01月01日至2022年12月31日）		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	—	1,423,257.17	1,423,257.17
当期购买	—	252,969.67	252,969.67
当期出售/结算	—	—	—
转入第三层次	—	—	—
转出第三层次	—	1,241,693.43	1,241,693.43
当期利得或损失总额	—	-197,254.15	-197,254.15
其中：计入损益的利得或损失	—	-197,254.15	-197,254.15
期末余额	—	237,279.26	237,279.26
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	—	-15,690.41	-15,690.41
项目	上年度可比期间（2021年01月01日至2021年12月31日）		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	—	369,128.87	369,128.87
当期购买	—	392,754.15	392,754.15
当期出售/结算	—	118,110.54	118,110.54
转入第三层次	—	—	—
转出第三层次	—	254,298.82	254,298.82
当期利得或损失总额	—	1,033,783.51	1,033,783.51
其中：计入损益的利得或损失	—	1,033,783.51	1,033,783.51
期末余额	—	1,423,257.17	1,423,257.17

期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	—	1,030,503.02	1,030,503.02
--	---	--------------	--------------

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	237,279.26	平均价格亚式期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.2127-2.4756	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	1,423,257.17	平均价格亚式期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.3022-2.7417	负相关

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 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。

7.4.15.2 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	157,642,470.73	93.34
	其中：股票	157,642,470.73	93.34
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	10,955,743.07	6.49
8	其他各项资产	293,784.18	0.17
9	合计	168,891,997.98	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末按行业分类的境内股票投资组合

8.2.1.1 期末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	160,975.00	0.10
B	采矿业	42,860.00	0.03
C	制造业	20,539,677.25	12.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	619,605.00	0.37
E	建筑业	888,722.00	0.53
F	批发和零售业	12,054.00	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	619,200.00	0.37
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,918,299.14	1.14
J	金融业	2,229,668.00	1.32
K	房地产业	34,088.00	0.02
L	租赁和商务服务业	70,757.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	135,669.09	0.08

N	水利、环境和公共设施管理业	172,348.00	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	469,787.00	0.28
R	文化、体育和娱乐业	246,012.00	0.15
S	综合	—	—
	合计	28,159,721.48	16.73

8.2.1.2 期末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	1,481,103.00	0.88
B	采矿业	8,703,759.00	5.17
C	制造业	76,877,000.91	45.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,924,342.00	1.14
E	建筑业	3,617,701.00	2.15
F	批发和零售业	894,184.00	0.53
G	交通运输、仓储和邮政业	3,684,194.00	2.19
H	住宿和餐饮业	250,905.00	0.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,591,504.04	2.13
J	金融业	22,933,050.30	13.62
K	房地产业	2,432,927.00	1.45
L	租赁和商务服务业	64,355.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	1,642,050.00	0.98
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	—	—
Q	卫生和社会工作	1,385,674.00	0.82
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	129,482,749.25	76.92

8.3 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

8.3.1 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	5,400	9,325,800.00	5.54
2	002594	比亚迪	13,300	3,417,701.00	2.03

3	000568	泸州老窖	14,000	3,139,920.00	1.87
4	300750	宁德时代	7,700	3,029,334.00	1.80
5	002304	洋河股份	14,800	2,375,400.00	1.41
6	600438	通威股份	47,600	1,836,408.00	1.09
7	601899	紫金矿业	181,900	1,819,000.00	1.08
8	601390	中国中铁	313,400	1,742,504.00	1.04
9	000858	五粮液	9,500	1,716,555.00	1.02
10	601857	中国石油	343,200	1,705,704.00	1.01
11	601658	邮储银行	367,300	1,696,926.00	1.01
12	601006	大秦铁路	230,600	1,540,408.00	0.92
13	600887	伊利股份	48,300	1,497,300.00	0.89
14	601336	新华保险	47,000	1,413,760.00	0.84
15	000538	云南白药	25,940	1,410,098.40	0.84
16	600015	华夏银行	263,600	1,368,084.00	0.81
17	600547	山东黄金	70,300	1,346,948.00	0.80
18	600018	上港集团	252,200	1,346,748.00	0.80
19	600036	招商银行	35,200	1,311,552.00	0.78
20	600276	恒瑞医药	33,420	1,287,672.60	0.76
21	600919	江苏银行	174,970	1,275,531.30	0.76
22	603259	药明康德	15,475	1,253,475.00	0.74
23	300015	爱尔眼科	40,300	1,252,121.00	0.74
24	601318	中国平安	25,700	1,207,900.00	0.72
25	600028	中国石化	273,400	1,192,024.00	0.71
26	300760	迈瑞医疗	3,700	1,169,089.00	0.69
27	600926	杭州银行	88,300	1,154,964.00	0.69
28	601211	国泰君安	83,800	1,138,842.00	0.68
29	601012	隆基绿能	25,600	1,081,856.00	0.64
30	603185	上机数控	10,200	1,079,670.00	0.64
31	601600	中国铝业	240,100	1,073,247.00	0.64
32	601881	中国银河	115,300	1,071,137.00	0.64
33	603369	今世缘	21,000	1,068,900.00	0.63
34	601668	中国建筑	196,300	1,065,909.00	0.63
35	300498	温氏股份	53,100	1,042,353.00	0.62
36	300274	阳光电源	9,300	1,039,740.00	0.62
37	601688	华泰证券	81,200	1,034,488.00	0.61
38	601838	成都银行	66,800	1,022,040.00	0.61
39	002129	TCL 中环	27,100	1,020,586.00	0.61
40	605117	德业股份	3,000	993,600.00	0.59
41	002938	鹏鼎控股	36,100	990,584.00	0.59
42	601319	中国人保	189,300	988,146.00	0.59
43	688063	派能科技	3,100	978,515.00	0.58

44	000651	格力电器	30,200	976,064.00	0.58
45	300496	中科创达	9,700	972,910.00	0.58
46	601169	北京银行	209,400	902,514.00	0.54
47	002371	北方华创	4,000	901,200.00	0.54
48	601601	中国太保	36,600	897,432.00	0.53
49	603993	洛阳钼业	194,300	884,065.00	0.53
50	601088	中国神华	31,700	875,554.00	0.52
51	002812	恩捷股份	6,600	866,514.00	0.51
52	601238	广汽集团	75,200	829,456.00	0.49
53	300014	亿纬锂能	9,300	817,470.00	0.49
54	601138	工业富联	88,200	809,676.00	0.48
55	601229	上海银行	136,600	807,306.00	0.48
56	600436	片仔癀	2,700	778,842.00	0.46
57	600600	青岛啤酒	7,200	774,000.00	0.46
58	600019	宝钢股份	138,400	773,656.00	0.46
59	603605	珀莱雅	4,560	763,708.80	0.45
60	603456	九洲药业	17,700	751,011.00	0.45
61	603392	万泰生物	5,920	750,064.00	0.45
62	600362	江西铜业	42,000	732,060.00	0.43
63	300122	智飞生物	8,200	720,206.00	0.43
64	000876	新希望	54,200	699,722.00	0.42
65	600741	华域汽车	39,660	687,307.80	0.41
66	601108	财通证券	95,000	676,400.00	0.40
67	000002	万科A	36,800	669,760.00	0.40
68	600160	巨化股份	43,100	668,481.00	0.40
69	000596	古井贡酒	2,500	667,250.00	0.40
70	002756	永兴材料	7,199	663,531.83	0.39
71	600233	圆通速递	32,700	656,943.00	0.39
72	000933	神火股份	43,300	647,768.00	0.38
73	600000	浦发银行	88,000	640,640.00	0.38
74	600256	广汇能源	70,200	633,204.00	0.38
75	600141	兴发集团	21,800	632,200.00	0.38
76	600584	长电科技	26,400	608,520.00	0.36
77	002466	天齐锂业	7,400	584,526.00	0.35
78	300763	锦浪科技	3,200	576,160.00	0.34
79	688385	复旦微电	8,244	575,513.64	0.34
80	600809	山西汾酒	2,000	569,980.00	0.34
81	601577	长沙银行	84,100	568,516.00	0.34
82	600905	三峡能源	98,800	558,220.00	0.33
83	002001	新和成	29,600	555,000.00	0.33
84	300390	天华超净	9,900	553,212.00	0.33

85	000661	长春高新	3,300	549,285.00	0.33
86	301035	润丰股份	6,000	522,600.00	0.31
87	600383	金地集团	49,200	503,316.00	0.30
88	601166	兴业银行	28,500	501,315.00	0.30
89	000750	国海证券	149,200	496,836.00	0.30
90	600690	海尔智家	20,300	496,538.00	0.29
91	600050	中国联通	110,800	496,384.00	0.29
92	600027	华电国际	83,400	490,392.00	0.29
93	601360	三六零	74,600	487,884.00	0.29
94	300373	扬杰科技	9,100	478,660.00	0.28
95	002030	达安基因	30,200	469,912.00	0.28
96	600845	宝信软件	10,298	461,350.40	0.27
97	601328	交通银行	95,900	454,566.00	0.27
98	601916	浙商银行	154,600	454,524.00	0.27
99	600848	上海临港	37,700	449,384.00	0.27
100	002714	牧原股份	9,000	438,750.00	0.26
101	688396	华润微	8,100	426,465.00	0.25
102	688599	天合光能	6,604	421,071.04	0.25
103	601117	中国化学	52,200	414,468.00	0.25
104	600346	恒力石化	25,800	400,674.00	0.24
105	000932	华菱钢铁	85,000	399,500.00	0.24
106	002463	沪电股份	33,500	398,650.00	0.24
107	300896	爱美客	700	396,445.00	0.24
108	601865	福莱特	11,800	393,058.00	0.23
109	300776	帝尔激光	3,100	390,600.00	0.23
110	600048	保利发展	25,500	385,815.00	0.23
111	002600	领益智造	83,800	380,452.00	0.23
112	300919	中伟股份	5,700	373,977.00	0.22
113	002384	东山精密	15,100	373,423.00	0.22
114	002709	天赐材料	8,400	368,424.00	0.22
115	688777	中控技术	4,000	363,320.00	0.22
116	000895	双汇发展	13,800	357,834.00	0.21
117	000963	华东医药	7,200	336,960.00	0.20
118	601669	中国电建	47,300	334,884.00	0.20
119	600795	国电电力	76,400	326,228.00	0.19
120	000001	平安银行	23,500	309,260.00	0.18
121	002353	杰瑞股份	11,000	307,010.00	0.18
122	603127	昭衍新药	5,200	303,732.00	0.18
123	601607	上海医药	16,800	299,544.00	0.18
124	002625	光启技术	16,458	280,115.16	0.17
125	603218	日月股份	13,600	276,080.00	0.16

126	002459	晶澳科技	4,440	266,799.60	0.16
127	002065	东华软件	46,900	265,454.00	0.16
128	605358	立昂微	6,076	258,837.60	0.15
129	601077	渝农商行	73,300	258,749.00	0.15
130	002673	西部证券	41,800	254,562.00	0.15
131	300595	欧普康视	7,100	253,470.00	0.15
132	600219	南山铝业	76,800	251,136.00	0.15
133	600754	锦江酒店	4,300	250,905.00	0.15
134	600885	宏发股份	7,500	250,575.00	0.15
135	002049	紫光国微	1,900	250,458.00	0.15
136	600699	均胜电子	17,700	248,685.00	0.15
137	603501	韦尔股份	3,210	247,458.90	0.15
138	002507	涪陵榨菜	9,500	244,815.00	0.15
139	000027	深圳能源	37,100	235,956.00	0.14
140	002602	世纪华通	61,200	233,172.00	0.14
141	603613	国联股份	2,581	228,263.64	0.14
142	000100	TCL 科技	60,300	224,316.00	0.13
143	000050	深天马 A	25,800	223,428.00	0.13
144	601615	明阳智能	8,200	207,132.00	0.12
145	601689	拓普集团	3,400	199,172.00	0.12
146	002497	雅化集团	8,500	197,625.00	0.12
147	603290	斯达半导	600	197,580.00	0.12
148	600176	中国巨石	14,300	196,053.00	0.12
149	600153	建发股份	14,200	193,830.00	0.12
150	300433	蓝思科技	18,171	191,340.63	0.11
151	603707	健友股份	10,420	187,976.80	0.11
152	000703	恒逸石化	26,000	182,780.00	0.11
153	000630	铜陵有色	56,500	176,280.00	0.10
154	601985	中国核电	29,200	175,200.00	0.10
155	600085	同仁堂	3,900	174,252.00	0.10
156	000069	华侨城 A	31,900	170,027.00	0.10
157	002152	广电运通	16,300	162,022.00	0.10
158	001979	招商蛇口	12,400	156,612.00	0.09
159	601398	工商银行	35,400	153,636.00	0.09
160	000783	长江证券	28,800	153,504.00	0.09
161	000729	燕京啤酒	14,300	151,866.00	0.09
162	002736	国信证券	16,900	150,072.00	0.09
163	300529	健帆生物	4,800	148,656.00	0.09
164	002493	荣盛石化	11,900	146,370.00	0.09
165	002465	海格通信	17,500	142,100.00	0.08
166	002294	信立泰	4,300	141,255.00	0.08

167	300059	东方财富	7,100	137,740.00	0.08
168	002916	深南电路	1,900	137,085.00	0.08
169	600029	南方航空	17,600	133,760.00	0.08
170	002422	科伦药业	5,000	133,050.00	0.08
171	603882	金城医学	1,700	132,940.00	0.08
172	688122	西部超导	1,400	132,566.00	0.08
173	002841	视源股份	2,200	129,888.00	0.08
174	601766	中国中车	24,800	126,728.00	0.08
175	600660	福耀玻璃	3,600	126,252.00	0.08
176	600348	华阳股份	8,700	123,975.00	0.07
177	000725	京东方 A	34,200	115,596.00	0.07
178	000338	潍柴动力	11,100	112,998.00	0.07
179	600875	东方电气	5,000	105,100.00	0.06
180	002821	凯莱英	700	103,600.00	0.06
181	600999	招商证券	7,700	102,410.00	0.06
182	688363	华熙生物	747	101,054.16	0.06
183	300033	同花顺	1,000	98,610.00	0.06
184	002244	滨江集团	11,100	98,013.00	0.06
185	300124	汇川技术	1,400	97,300.00	0.06
186	000988	华工科技	5,400	88,614.00	0.05
187	000401	冀东水泥	10,500	86,415.00	0.05
188	000425	徐工机械	16,700	84,669.00	0.05
189	600380	健康元	7,400	83,546.00	0.05
190	600900	长江电力	3,900	81,900.00	0.05
191	300207	欣旺达	3,700	78,255.00	0.05
192	600188	兖矿能源	2,300	77,234.00	0.05
193	300357	我武生物	1,400	77,140.00	0.05
194	688516	奥特维	380	76,380.00	0.05
195	600309	万华化学	800	74,120.00	0.04
196	600918	中泰证券	11,200	71,792.00	0.04
197	600989	宝丰能源	5,900	71,213.00	0.04
198	600585	海螺水泥	2,600	71,188.00	0.04
199	688202	美迪西	300	64,167.00	0.04
200	600563	法拉电子	400	63,952.00	0.04
201	002078	太阳纸业	4,900	56,448.00	0.03
202	002145	中核钛白	9,000	55,440.00	0.03
203	601991	大唐发电	19,600	54,684.00	0.03
204	601618	中国中冶	16,400	52,152.00	0.03
205	600406	国电南瑞	2,100	51,240.00	0.03
206	601216	君正集团	12,500	49,875.00	0.03
207	600998	九州通	3,800	49,552.00	0.03

208	000423	东阿阿胶	1,200	48,840.00	0.03
209	000157	中联重科	8,600	46,784.00	0.03
210	300769	德方纳米	200	45,918.00	0.03
211	300363	博腾股份	1,100	44,935.00	0.03
212	600030	中信证券	2,200	43,802.00	0.03
213	002475	立讯精密	1,363	43,275.25	0.03
214	002027	分众传媒	6,400	42,752.00	0.03
215	000063	中兴通讯	1,600	41,376.00	0.02
216	688009	中国通号	8,630	41,337.70	0.02
217	601168	西部矿业	3,800	38,760.00	0.02
218	601009	南京银行	3,500	36,470.00	0.02
219	002180	纳思达	700	36,323.00	0.02
220	688006	杭可科技	800	35,016.00	0.02
221	600522	中天科技	2,100	33,915.00	0.02
222	688187	时代电气	600	32,742.00	0.02
223	600104	上汽集团	2,100	30,261.00	0.02
224	601288	农业银行	10,100	29,391.00	0.02
225	300073	当升科技	500	28,200.00	0.02
226	600089	特变电工	1,400	28,112.00	0.02
227	002202	金风科技	2,400	26,400.00	0.02
228	600177	雅戈尔	4,000	25,320.00	0.02
229	000739	普洛药业	1,100	23,694.00	0.01
230	601888	中国中免	100	21,603.00	0.01
231	002506	协鑫集成	7,300	21,243.00	0.01
232	688099	晶晨股份	300	21,153.00	0.01
233	603659	璞泰来	400	20,756.00	0.01
234	300676	华大基因	400	20,676.00	0.01
235	300142	沃森生物	500	20,095.00	0.01
236	601555	东吴证券	2,800	18,284.00	0.01
237	002236	大华股份	1,600	18,096.00	0.01
238	601198	东兴证券	2,300	17,756.00	0.01
239	300661	圣邦股份	100	17,260.00	0.01
240	000807	云铝股份	1,400	15,568.00	0.01
241	000738	航发控制	600	15,384.00	0.01
242	300832	新产业	300	15,042.00	0.01
243	601058	赛轮轮胎	1,500	15,030.00	0.01
244	300957	贝泰妮	100	14,924.00	0.01
245	600884	杉杉股份	700	12,740.00	0.01
246	600132	重庆啤酒	100	12,738.00	0.01
247	603833	欧派家居	100	12,153.00	0.01
248	601377	兴业证券	2,100	12,054.00	0.01

249	600566	济川药业	400	10,888.00	0.01
250	002920	德赛西威	100	10,534.00	0.01
251	600056	中国医药	600	10,338.00	0.01
252	603986	兆易创新	100	10,247.00	0.01
253	002340	格林美	1,200	8,916.00	0.01
254	601233	桐昆股份	600	8,670.00	0.01
255	603260	合盛硅业	100	8,294.00	0.00
256	002487	大金重工	200	8,274.00	0.00
257	600039	四川路桥	700	7,784.00	0.00
258	688005	容百科技	100	6,875.00	0.00
259	002241	歌尔股份	400	6,732.00	0.00
260	002738	中矿资源	100	6,666.00	0.00
261	603806	福斯特	100	6,644.00	0.00
262	000301	东方盛虹	500	6,520.00	0.00
263	688180	君实生物	100	6,260.00	0.00
264	300628	亿联网络	100	6,059.00	0.00
265	002352	顺丰控股	100	5,776.00	0.00
266	601225	陕西煤业	300	5,574.00	0.00
267	603799	华友钴业	100	5,563.00	0.00
268	002405	四维图新	500	5,510.00	0.00
269	600745	闻泰科技	100	5,258.00	0.00
270	300604	长川科技	100	4,458.00	0.00
271	600893	航发动力	100	4,228.00	0.00
272	603233	大参林	100	3,960.00	0.00
273	600196	复星医药	100	3,524.00	0.00
274	000513	丽珠集团	100	3,248.00	0.00
275	300408	三环集团	100	3,071.00	0.00
276	002268	电科网安	100	3,053.00	0.00
277	002603	以岭药业	100	2,996.00	0.00
278	000408	藏格矿业	100	2,597.00	0.00
279	600111	北方稀土	100	2,505.00	0.00
280	300003	乐普医疗	100	2,297.00	0.00
281	002007	华兰生物	100	2,263.00	0.00
282	002080	中材科技	100	2,143.00	0.00
283	601966	玲珑轮胎	100	2,048.00	0.00
284	600549	厦门钨业	100	1,955.00	0.00
285	000938	紫光股份	100	1,951.00	0.00
286	002056	横店东磁	100	1,874.00	0.00
287	002555	三七互娱	100	1,810.00	0.00
288	603866	桃李面包	100	1,540.00	0.00
289	000960	锡业股份	100	1,410.00	0.00

290	601666	平煤股份	100	1,081.00	0.00
291	600021	上海电力	100	1,001.00	0.00
292	600011	华能国际	100	761.00	0.00
293	000937	冀中能源	100	636.00	0.00
294	000728	国元证券	100	633.00	0.00
295	002044	美年健康	100	613.00	0.00
296	000987	越秀资本	100	599.00	0.00
297	601872	招商轮船	100	559.00	0.00
298	601818	光大银行	100	307.00	0.00
299	601992	金隅集团	100	254.00	0.00

8.3.2 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	002597	金禾实业	26,100	848,250.00	0.50
2	601231	环旭电子	50,800	824,484.00	0.49
3	600732	爱旭股份	21,100	798,002.00	0.47
4	002085	万丰奥威	125,800	748,510.00	0.44
5	002258	利尔化学	41,300	741,748.00	0.44
6	600481	双良节能	53,000	685,820.00	0.41
7	003000	劲仔食品	51,400	606,006.00	0.36
8	600063	皖维高新	102,300	598,455.00	0.36
9	002517	恺英网络	90,900	596,304.00	0.35
10	601186	中国铁建	76,100	588,253.00	0.35
11	600873	梅花生物	57,200	582,296.00	0.35
12	603323	苏农银行	121,600	570,304.00	0.34
13	600582	天地科技	105,500	548,600.00	0.33
14	000915	华特达因	11,900	541,450.00	0.32
15	603228	景旺电子	26,600	538,384.00	0.32
16	600867	通化东宝	50,600	464,508.00	0.28
17	002839	张家港行	97,600	449,936.00	0.27
18	688223	晶科能源	30,300	443,895.00	0.26
19	300481	濮阳惠成	16,300	435,699.00	0.26
20	300244	迪安诊断	16,900	424,697.00	0.25
21	002036	联创电子	34,200	423,054.00	0.25
22	603612	索通发展	15,500	403,310.00	0.24
23	600901	江苏租赁	71,400	391,272.00	0.23
24	688617	惠泰医疗	1,200	368,316.00	0.22
25	688559	海目星	6,200	358,608.00	0.21
26	688589	力合微	10,600	358,492.00	0.21

27	002273	水晶光电	27,200	320,688.00	0.19
28	600025	华能水电	48,500	320,100.00	0.19
29	688123	聚辰股份	3,143	318,071.60	0.19
30	301193	家联科技	9,600	317,856.00	0.19
31	301004	嘉益股份	10,600	315,668.00	0.19
32	688981	中芯国际	7,600	312,664.00	0.19
33	300888	稳健医疗	4,300	307,450.00	0.18
34	688800	瑞可达	2,800	298,704.00	0.18
35	600377	宁沪高速	34,800	286,056.00	0.17
36	603920	世运电路	19,300	277,534.00	0.16
37	600718	东软集团	27,700	275,615.00	0.16
38	002324	普利特	17,200	275,200.00	0.16
39	000090	天健集团	48,900	266,994.00	0.16
40	002312	川发龙蟒	24,800	260,896.00	0.15
41	600927	永安期货	15,800	254,696.00	0.15
42	601801	皖新传媒	40,600	211,526.00	0.13
43	600548	深高速	23,300	209,234.00	0.12
44	688778	厦钨新能	2,576	200,103.68	0.12
45	002050	三花智控	9,400	199,468.00	0.12
46	688066	航天宏图	2,300	196,650.00	0.12
47	300602	飞荣达	13,300	191,387.00	0.11
48	000877	天山股份	21,500	183,180.00	0.11
49	688100	威胜信息	7,400	170,866.00	0.10
50	603681	永冠新材	7,900	168,902.00	0.10
51	002961	瑞达期货	12,300	163,959.00	0.10
52	300761	立华股份	4,700	160,975.00	0.10
53	688126	沪硅产业	9,100	160,251.00	0.10
54	600597	光明乳业	14,700	158,172.00	0.09
55	688819	天能股份	4,300	157,982.00	0.09
56	688506	百利天恒	6,360	157,092.00	0.09
57	603898	好莱客	13,300	150,556.00	0.09
58	300803	指南针	3,200	146,304.00	0.09
59	000726	鲁泰 A	19,500	143,910.00	0.09
60	601717	郑煤机	12,700	141,732.00	0.08
61	002957	科瑞技术	9,300	140,709.00	0.08
62	002139	拓邦股份	13,200	136,884.00	0.08
63	002391	长青股份	19,300	135,679.00	0.08
64	002832	比音勒芬	5,100	130,611.00	0.08
65	688088	虹软科技	5,500	123,805.00	0.07
66	600323	瀚蓝环境	6,600	121,836.00	0.07
67	603236	移远通信	1,200	120,984.00	0.07

68	600612	老凤祥	2,700	115,560.00	0.07
69	603515	欧普照明	6,400	99,072.00	0.06
70	300775	三角防务	2,600	98,800.00	0.06
71	603348	文灿股份	1,700	97,869.00	0.06
72	000997	新大陆	7,400	96,274.00	0.06
73	003816	中国广核	35,700	96,033.00	0.06
74	300443	金雷股份	2,300	92,644.00	0.06
75	002807	江阴银行	23,000	91,310.00	0.05
76	600908	无锡银行	17,300	91,171.00	0.05
77	601369	陕鼓动力	7,900	90,534.00	0.05
78	300684	中石科技	6,100	90,341.00	0.05
79	002937	兴瑞科技	3,900	88,335.00	0.05
80	603305	旭升集团	2,600	83,824.00	0.05
81	601816	京沪高铁	17,000	83,640.00	0.05
82	300861	美畅股份	1,700	83,572.00	0.05
83	300570	太辰光	5,600	80,976.00	0.05
84	300610	晨化股份	6,400	80,256.00	0.05
85	688155	先惠技术	1,500	78,435.00	0.05
86	688733	壹石通	2,000	75,340.00	0.04
87	600483	福能股份	7,100	75,118.00	0.04
88	603019	中科曙光	3,300	73,062.00	0.04
89	000785	居然之家	17,300	70,757.00	0.04
90	601998	中信银行	14,200	70,716.00	0.04
91	688162	巨一科技	1,600	69,312.00	0.04
92	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.04
93	600129	太极集团	2,200	66,132.00	0.04
94	300953	震裕科技	800	66,120.00	0.04
95	000553	安道麦 A	7,000	63,350.00	0.04
96	688550	瑞联新材	1,300	60,593.00	0.04
97	688196	卓越新能	1,000	58,020.00	0.03
98	688381	帝奥微	1,433	54,425.34	0.03
99	002545	东方铁塔	6,200	51,398.00	0.03
100	002993	奥海科技	1,500	51,015.00	0.03
101	300298	三诺生物	1,500	50,595.00	0.03
102	002034	旺能环境	2,800	50,512.00	0.03
103	688169	石头科技	200	49,550.00	0.03
104	300494	盛天网络	3,300	49,269.00	0.03
105	688208	道通科技	1,500	47,325.00	0.03
106	688499	利元亨	300	47,214.00	0.03
107	603859	能科科技	1,800	47,034.00	0.03
108	002484	江海股份	2,100	46,977.00	0.03

109	301221	光庭信息	1,200	46,692.00	0.03
110	300679	电连技术	1,200	44,400.00	0.03
111	301267	华夏眼科	600	43,866.00	0.03
112	688676	金盘科技	1,200	43,416.00	0.03
113	600497	驰宏锌锗	8,300	41,998.00	0.02
114	002570	贝因美	7,700	41,657.00	0.02
115	300575	中旗股份	1,900	41,553.00	0.02
116	300607	拓斯达	2,800	40,740.00	0.02
117	600995	南网储能	2,800	40,376.00	0.02
118	001289	龙源电力	2,200	40,194.00	0.02
119	603667	五洲新春	3,000	39,930.00	0.02
120	688106	金宏气体	2,100	39,396.00	0.02
121	603890	春秋电子	4,300	39,302.00	0.02
122	688389	普门科技	2,200	39,226.00	0.02
123	000598	兴蓉环境	8,000	39,120.00	0.02
124	603600	永艺股份	4,000	39,000.00	0.02
125	600562	国睿科技	2,300	38,985.00	0.02
126	002068	黑猫股份	3,200	38,304.00	0.02
127	688139	海尔生物	600	37,980.00	0.02
128	300118	东方日升	1,500	37,230.00	0.02
129	300856	科思股份	700	36,505.00	0.02
130	603067	振华股份	2,800	35,924.00	0.02
131	002446	盛路通信	3,700	35,372.00	0.02
132	688518	联赢激光	1,200	35,052.00	0.02
133	300258	精锻科技	3,000	34,890.00	0.02
134	300319	麦捷科技	4,400	34,232.00	0.02
135	000970	中科三环	2,400	32,736.00	0.02
136	000402	金融街	6,200	32,550.00	0.02
137	300928	华安鑫创	900	32,445.00	0.02
138	000555	神州信息	2,900	31,233.00	0.02
139	603959	百利科技	2,900	30,653.00	0.02
140	688039	当虹科技	800	30,128.00	0.02
141	601098	中南传媒	2,900	28,942.00	0.02
142	003021	兆威机电	600	28,842.00	0.02
143	000902	新洋丰	2,400	27,624.00	0.02
144	300873	海晨股份	1,000	27,150.00	0.02
145	000860	顺鑫农业	900	26,838.00	0.02
146	002675	东诚药业	1,600	26,496.00	0.02
147	688779	长远锂科	1,786	26,057.74	0.02
148	000581	威孚高科	1,300	23,049.00	0.01
149	688690	纳微科技	400	20,708.00	0.01

150	688556	高测股份	268	20,105.36	0.01
151	300012	华测检测	900	20,070.00	0.01
152	000400	许继电气	1,000	19,970.00	0.01
153	688668	鼎通科技	300	19,800.00	0.01
154	688665	四方光电	200	19,800.00	0.01
155	688408	中信博	200	19,680.00	0.01
156	688366	昊海生科	200	19,508.00	0.01
157	301269	华大九天	219	19,258.86	0.01
158	688680	海优新材	100	18,530.00	0.01
159	002865	钧达股份	100	18,510.00	0.01
160	300294	博雅生物	500	18,280.00	0.01
161	000682	东方电子	2,100	16,884.00	0.01
162	300296	利亚德	2,900	16,414.00	0.01
163	603527	众源新材	1,100	15,488.00	0.01
164	300770	新媒股份	400	15,064.00	0.01
165	301095	广立微	170	14,703.30	0.01
166	002967	广电计量	800	13,424.00	0.01
167	300580	贝斯特	700	13,034.00	0.01
168	301327	华宝新能	73	12,918.81	0.01
169	603713	密尔克卫	100	11,666.00	0.01
170	600398	海澜之家	2,200	11,660.00	0.01
171	688166	博瑞医药	500	11,285.00	0.01
172	301308	江波龙	195	11,060.40	0.01
173	688116	天奈科技	138	10,645.32	0.01
174	605369	拱东医疗	100	10,561.00	0.01
175	688022	瀚川智能	200	9,680.00	0.01
176	301367	怡和嘉业	55	9,667.90	0.01
177	600886	国投电力	800	8,664.00	0.01
178	300009	安科生物	900	8,424.00	0.01
179	605266	健之佳	100	8,007.00	0.00
180	301050	雷电微力	100	7,717.00	0.00
181	301363	美好医疗	203	7,683.55	0.00
182	688329	艾隆科技	200	7,622.00	0.00
183	301396	宏景科技	233	7,432.70	0.00
184	300820	英杰电气	100	7,348.00	0.00
185	688026	洁特生物	300	7,218.00	0.00
186	688076	诺泰生物	300	6,882.00	0.00
187	301227	森鹰窗业	232	6,841.68	0.00
188	301283	聚胶股份	133	6,837.53	0.00
189	301096	百诚医药	100	6,831.00	0.00
190	301152	天力锂能	145	6,762.80	0.00

191	301313	凡拓数创	224	6,527.36	0.00
192	601728	中国电信	1,500	6,285.00	0.00
193	301389	隆扬电子	357	6,126.12	0.00
194	301223	中荣股份	337	6,109.81	0.00
195	002410	广联达	100	5,995.00	0.00
196	300866	安克创新	100	5,927.00	0.00
197	301171	易点天下	332	5,883.04	0.00
198	301280	珠城科技	128	5,734.40	0.00
199	301290	东星医疗	163	5,726.19	0.00
200	300979	华利集团	100	5,711.00	0.00
201	301285	鸿日达	446	5,619.60	0.00
202	301356	天振股份	129	5,589.57	0.00
203	601928	凤凰传媒	700	5,544.00	0.00
204	300633	开立医疗	100	5,483.00	0.00
205	301365	矩阵股份	227	5,418.49	0.00
206	688315	诺禾致源	200	5,278.00	0.00
207	301115	建科股份	215	5,168.60	0.00
208	301122	采纳股份	100	5,168.00	0.00
209	301316	慧博云通	359	5,140.88	0.00
210	300855	图南股份	100	4,679.00	0.00
211	301319	唯特偶	87	4,634.49	0.00
212	603529	爱玛科技	100	4,587.00	0.00
213	301349	信德新材	43	4,451.36	0.00
214	600389	江山股份	100	4,408.00	0.00
215	003038	鑫铂股份	100	4,408.00	0.00
216	688521	芯原股份	100	4,407.00	0.00
217	300653	正海生物	100	4,300.00	0.00
218	301276	嘉曼服饰	186	4,205.46	0.00
219	603876	鼎胜新材	100	4,104.00	0.00
220	603883	老百姓	100	4,047.00	0.00
221	603896	寿仙谷	100	3,966.00	0.00
222	002876	三利谱	100	3,640.00	0.00
223	002741	光华科技	200	3,610.00	0.00
224	301309	万得凯	137	3,351.02	0.00
225	300482	万孚生物	100	3,187.00	0.00
226	002984	森麒麟	100	3,079.00	0.00
227	002623	亚玛顿	100	3,014.00	0.00
228	600329	达仁堂	100	2,910.00	0.00
229	603098	森特股份	100	2,822.00	0.00
230	301069	凯盛新材	100	2,758.00	0.00
231	603538	美诺华	100	2,575.00	0.00

232	000768	中航西飞	100	2,545.00	0.00
233	002262	恩华药业	100	2,455.00	0.00
234	300171	东富龙	100	2,373.00	0.00
235	000403	派林生物	100	2,276.00	0.00
236	002810	山东赫达	100	2,242.00	0.00
237	688303	大全能源	47	2,240.96	0.00
238	300682	朗新科技	100	2,198.00	0.00
239	300677	英科医疗	100	2,103.00	0.00
240	300035	中科电气	100	2,058.00	0.00
241	603309	维力医疗	100	1,998.00	0.00
242	300994	久祺股份	100	1,972.00	0.00
243	600557	康缘药业	100	1,875.00	0.00
244	300463	迈克生物	100	1,730.00	0.00
245	002461	珠江啤酒	200	1,602.00	0.00
246	001914	招商积余	100	1,538.00	0.00
247	300378	鼎捷软件	100	1,533.00	0.00
248	600131	国网信通	100	1,496.00	0.00
249	300636	同和药业	100	1,481.00	0.00
250	601137	博威合金	100	1,481.00	0.00
251	002643	万润股份	100	1,466.00	0.00
252	601126	四方股份	100	1,460.00	0.00
253	603565	中谷物流	100	1,454.00	0.00
254	300401	花园生物	100	1,439.00	0.00
255	603987	康德莱	100	1,378.00	0.00
256	601567	三星医疗	100	1,348.00	0.00
257	600285	羚锐制药	100	1,304.00	0.00
258	002399	海普瑞	100	1,285.00	0.00
259	002019	亿帆医药	100	1,225.00	0.00
260	000516	国际医学	100	1,224.00	0.00
261	002203	海亮股份	100	1,130.00	0.00
262	600366	宁波韵升	100	1,055.00	0.00
263	300115	长盈精密	100	1,033.00	0.00
264	002649	博彦科技	100	1,029.00	0.00
265	002003	伟星股份	100	1,012.00	0.00
266	600143	金发科技	100	969.00	0.00
267	002166	莱茵生物	100	950.00	0.00
268	600201	生物股份	100	901.00	0.00
269	601898	中煤能源	100	862.00	0.00
270	600888	新疆众和	100	819.00	0.00
271	300647	超频三	100	807.00	0.00
272	600929	雪天盐业	100	801.00	0.00

273	002270	华明装备	100	770.00	0.00
274	002390	信邦制药	100	470.00	0.00
275	002132	恒星科技	100	444.00	0.00
276	600782	新钢股份	100	409.00	0.00
277	000778	新兴铸管	100	365.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600519	贵州茅台	6,785,732.00	3.35
2	600030	中信证券	5,804,518.70	2.86
3	002594	比亚迪	4,759,340.00	2.35
4	601288	农业银行	4,083,591.00	2.01
5	601318	中国平安	3,883,454.00	1.91
6	600438	通威股份	3,805,994.00	1.88
7	603392	万泰生物	3,725,231.60	1.84
8	002304	洋河股份	3,691,535.00	1.82
9	000651	格力电器	3,581,516.00	1.77
10	300498	温氏股份	3,529,927.00	1.74
11	600741	华域汽车	3,344,306.60	1.65
12	002460	赣锋锂业	3,215,098.00	1.59
13	000858	五粮液	3,066,040.00	1.51
14	002180	纳思达	3,010,532.00	1.48
15	601658	邮储银行	2,976,908.00	1.47
16	601857	中国石油	2,930,023.00	1.44
17	601881	中国银河	2,853,568.59	1.41
18	600061	国投资本	2,837,549.00	1.40
19	002466	天齐锂业	2,820,733.00	1.39
20	601390	中国中铁	2,811,392.00	1.39

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。

8.4.2 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	600030	中信证券	6,629,161.00	3.27
2	300750	宁德时代	4,690,641.74	2.31
3	601318	中国平安	4,654,567.00	2.29

4	002129	TCL 中环	4,581,947.10	2.26
5	000625	长安汽车	4,495,906.08	2.22
6	600104	上汽集团	4,408,414.00	2.17
7	600438	通威股份	4,326,679.00	2.13
8	000933	神火股份	4,293,412.00	2.12
9	300760	迈瑞医疗	4,002,660.00	1.97
10	000001	平安银行	3,845,045.00	1.90
11	601288	农业银行	3,824,275.00	1.89
12	600256	广汇能源	3,680,881.00	1.81
13	600809	山西汾酒	3,667,917.00	1.81
14	300059	东方财富	3,623,261.80	1.79
15	300122	智飞生物	3,601,409.00	1.78
16	600089	特变电工	3,453,904.00	1.70
17	600519	贵州茅台	3,422,271.00	1.69
18	000830	鲁西化工	3,376,032.00	1.66
19	600036	招商银行	3,286,982.00	1.62
20	002460	赣锋锂业	3,091,824.00	1.52

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。

8.4.3 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	489,952,091.74
卖出股票收入（成交）总额	489,460,992.85

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	19,254.50
2	应收清算款	134,913.22
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	139,616.46
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	293,784.18

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 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。

8.12.5.2 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。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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(%)
12,312	7,435.71	48,644,611.69	53.14	42,903,817.02	46.86

9.2 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	282,974.07	0.3091

9.3 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、基金投资和研发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	0~10

§ 10 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	93,960,909.57
本报告期基金总申购份额	63,721,778.67
减：本报告期基金总赎回份额	66,134,259.53
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	91,548,428.71

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

11.5 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。本基金本年度支付给审计机构安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 3.8 万元人民币，其已提供审计服务的连续年限为 20 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 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，托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	8,405,805.89	0.86	7,743.93	0.91	—
渤海证券	2	—	—	—	—	—
长城证券	1	63,931.48	0.01	58.90	0.01	—
长江证券	3	88,626,222.32	9.12	81,274.26	9.53	—
德邦证券	2	—	—	—	—	—
东北证券	2	24,116,449.74	2.48	22,217.53	2.61	—
东财证券	2	125,536,216.99	12.92	109,979.07	12.90	—
方正证券	2	5,820,052.62	0.60	5,362.15	0.63	—
高华证券	1	12,261,419.87	1.26	11,296.49	1.33	—
光大证券	2	38,087,348.58	3.92	30,572.49	3.59	—
广发证券	2	60,880,842.48	6.26	55,616.89	6.52	—
国海证券	2	—	—	—	—	—
国盛证券	2	112,043.47	0.01	102.10	0.01	—
国泰君安	2	—	—	—	—	—
国信证券	2	57,316,973.85	5.90	41,346.87	4.85	—
海通证券	2	159,656,252.68	16.43	144,272.41	16.92	—
华泰证券	1	33,985,359.30	3.50	31,311.12	3.67	—
平安证券	2	—	—	—	—	—
瑞银证券	2	—	—	—	—	—
上海证券	1	—	—	—	—	—
申万宏源	2	113,766,222.21	11.70	102,296.88	12.00	—
太平洋证券	2	—	—	—	—	—
天风证券	2	123,852,233.35	12.74	99,651.99	11.69	—
西南证券	2	307,174.00	0.03	279.91	0.03	—
湘财证券	1	—	—	—	—	—
信达证券	2	—	—	—	—	—

兴业证券	1	3,293,341.30	0.34	3,031.13	0.36	—
招商证券	1	6,932,360.51	0.71	6,386.81	0.75	—
中航证券	2	51,684,806.85	5.32	47,596.93	5.58	—
中金公司	2	9,552,557.17	0.98	8,800.25	1.03	—
中泰证券	2	17,967,977.37	1.85	16,065.10	1.88	—
中信建投	1	11,439,098.64	1.18	10,539.09	1.24	—
中信证券	2	18,295,698.17	1.88	16,673.87	1.96	—
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。本报告期本基金退租券商交易单元：中航证券（25818）。本报告期本基金新增券商交易单元：中航证券（54707）。

11.7.2 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	17,295.04	2.05	—	—	—	—
长江证券	—	—	—	—	—	—
德邦证券	—	—	—	—	—	—
东北证券	—	—	—	—	—	—
东财证券	—	—	—	—	—	—
方正证券	—	—	—	—	—	—
高华证券	—	—	—	—	—	—
光大证券	101,855.10	12.06	—	—	—	—
广发证券	158,163.70	18.72	—	—	—	—
国海证券	—	—	—	—	—	—
国盛证券	321,779.30	38.09	—	—	—	—
国泰君安	—	—	—	—	—	—
国信证券	—	—	—	—	—	—
海通证券	163,616.86	19.37	—	—	—	—
华泰证券	—	—	—	—	—	—

平安证券	—	—	—	—	—	—
瑞银证券	—	—	—	—	—	—
上海证券	—	—	—	—	—	—
申万宏源	33,960.37	4.02	—	—	—	—
太平洋证券	—	—	—	—	—	—
天风证券	—	—	—	—	—	—
西南证券	20,015.20	2.37	—	—	—	—
湘财证券	—	—	—	—	—	—
信达证券	—	—	—	—	—	—
兴业证券	—	—	—	—	—	—
招商证券	—	—	—	—	—	—
中航证券	28,160.80	3.33	—	—	—	—
中金公司	—	—	—	—	—	—
中泰证券	—	—	—	—	—	—
中信建投	—	—	—	—	—	—
中信证券	—	—	—	—	—	—
中银证券	—	—	—	—	—	—

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	富国基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具准则的公告	规定披露媒介	2022年01月01日
2	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2022年01月07日
3	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2022年01月07日
4	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2022年02月10日
5	富国基金管理有限公司关于调整旗下基金长期停牌股票估值方法的公告	规定披露媒介	2022年04月27日
6	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	规定披露媒介	2022年08月15日
7	富国基金管理有限公司关于公司股权变更的公告	规定披露媒介	2022年12月28日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

机构	1	2022-01-01 至 2022-06-13	19,769 ,235.4 2	4,596,4 61.10	22,615 ,766.9 0	1,749,929.6 2	1.91%
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>							

§ 13 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	中国(上海)自由贸易试验区 世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费）公司网址： http://www.fullgoal.com.cn 。
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		